华夏消费龙头混合型证券投资基金

2021 年中期报告

2021 年 6 月 30 日

基金管理人：华夏基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二一年八月三十日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 2 月 3 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录 1
§2 基金简介 3
§3 主要财务指标和基金净值表现 4
3.1 主要会计数据和财务指标 4
3.2 基金净值表现 5
§4 管理人报告 6
§5 托管人报告 12
§6 中期报告财务会计报告（未经审计） 12
6.1 资产负债表 12
6.2 利润表 14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表 15
6.4 报表附注 15
§7 投资组合报告 44
7.1 期末基金资产组合情况 44
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 45
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 46
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 49
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 50
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 50
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 50
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 50
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 50
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 50
7.12 投资组合报告附注 50
§8 基金份额持有人信息 51
§9 开放式基金份额变动 52
§10 重大事件揭示 52
§11 影响投资者决策的其他重要信息 55
§12 备查文件目录 55

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华夏消费龙头混合型证券投资基金	
基金简称	华夏消费龙头混合	
基金主代码	011282	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 2 月 3 日	
基金管理人	华夏基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	3,449,601,620.31 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华夏消费龙头混合 A	华夏消费龙头混合 C
下属分级基金的交易代码	011282	011283
报告期末下属分级基金的份额总额	3,265,214,493.64 份	184,387,126.67 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的前提下，专注消费行业及其产业链的投资机会，力求实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	主要投资策略包括资产配置策略，股票投资策略，债券投资策略，可转换债券、可交换债券投资策略，资产支持证券投资策略，股指期货投资策略，股票期权投资策略，国债期货投资策略等。 股票投资策略部分，本基金主要投资于消费行业及其产业链的龙头上市公司股票。传统消费行业指居民为了满足个人物质或文化生活需要，购买使用商品或接受相关服务而产生的行业，其中商品消费包括食品饮料、纺织服装、家用电器、商业贸易、家居轻工、汽车、农业、房地产等行业；服务消费包括文化传媒、休闲服务、医疗服务、教育、汽车和房地产后服务等行业。伴随着技术变革、产业升级等一系列变化，动漫游戏、电商零售、消费电子、新能源车、互联网医疗、互联网金融等新兴消费层出不穷，本基金在传统消费行业的基础上，将这类行业也划入消费定义范畴，选择符合未来消费趋势，具有核心竞争优势和长期持续增长模式的优质公司构建投资组合。
业绩比较基准	中证内地消费主题指数收益率*65%+中证港股通大消费主题指数收益率*15%+中债综合指数收益率*20%（如需调整汇率，指数收益率为人民币汇率调整后的）。
风险收益特征	本基金为混合基金，60%-95%的基金资产投资于股票，其预期风险和预期收益低于股票基金，高于债券基金与货币市场基金。本基金还将通过港股通渠道投资于香港证券市场，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还将面临汇率风险、香港市场风险等特殊投资风险。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华夏基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李彬	许俊
	联系电话	400-818-6666	010-66594319
	电子邮箱	service@ChinaAMC.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-818-6666	95566
传真		010-63136700	010-66594942
注册地址		北京市顺义区安庆大街甲3号院	北京市西城区复兴门内大街1号
办公地址		北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座8层	北京市西城区复兴门内大街1号
邮政编码		100033	100818
法定代表人		杨明辉	刘连舸

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.ChinaAMC.com
基金中期报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	华夏基金管理有限公司	北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 8 层

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2021 年 2 月 3 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日）	
	华夏消费龙头混合 A	华夏消费龙头混合 C
本期已实现收益	-35,777,446.56	-2,495,051.90
本期利润	-121,101,767.35	-7,360,499.08
加权平均基金份额本期利润	-0.0358	-0.0364
本期加权平均净值利润率	-3.64%	-3.71%
本期基金份额净值增长率	-3.61%	-3.81%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)	
	华夏消费龙头混合 A	华夏消费龙头混合 C
期末可供分配利润	-118,001,649.36	-7,021,765.15

期末可供分配基金份额利润	-0.0361	-0.0381
期末基金资产净值	3,147,212,844.28	177,365,361.52
期末基金份额净值	0.9639	0.9619
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)	
	华夏消费龙头混合 A	华夏消费龙头混合 C
基金份额累计净值增长率	-3.61%	-3.81%

注：①所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

②本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

③期末可供分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

④本基金合同于 2021 年 2 月 3 日生效。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华夏消费龙头混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	-3.53%	0.60%	-2.54%	0.73%	-0.99%	-0.13%
过去三个月	-1.80%	0.64%	2.98%	1.00%	-4.78%	-0.36%
自基金合同生效起至今	-3.61%	0.61%	-7.00%	1.39%	3.39%	-0.78%

华夏消费龙头混合 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	-3.58%	0.60%	-2.54%	0.73%	-1.04%	-0.13%
过去三个月	-1.93%	0.64%	2.98%	1.00%	-4.91%	-0.36%
自基金合同生效起至今	-3.81%	0.61%	-7.00%	1.39%	3.19%	-0.78%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华夏消费龙头混合型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2021 年 2 月 3 日至 2021 年 6 月 30 日）

华夏消费龙头混合 A

华夏消费龙头混合 C

注：①本基金合同于 2021 年 2 月 3 日生效。

②根据本基金的基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同中投资范围、投资限制的有关约定。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

华夏基金管理有限公司成立于 1998 年 4 月 9 日，是经中国证监会批准成立的首批全国性基金管理公司之一。公司总部设在北京，在北京、上海、深圳、成都、南京、杭州、广州和青岛设有分公司，在香港、深圳、上海设有子公司。公司是首批全国社保基金管理人、首批企业年金基金管理人、境内首批 QDII 基金管理人、境内首只 ETF 基金管理人、境内首只沪港通 ETF 基金管理人、首批内地与香港基金互认基金管理人、首批基本养老保险基金投资管理人资格、首家加入联合国责任投资原则组织的公募基金公司、首批公募 FOF 基金管理人、首批公募养老目标基金管理人、境内首批中日互通 ETF 基金管理人，首批商品期货 ETF 基金管理人，以及特定客户资产管理人、保险资金投资管理人，香港子公司是首批 RQFII 基金管理人。华夏基金是业务领域最广泛的基金管理公司之一。

华夏基金是境内 ETF 基金资产管理规模最大的基金管理公司之一，在 ETF 基金管理方面积累了丰富的经验，目前旗下管理上证 50ETF（510050）、300ETF 基金（510330）、MSCIA 股 ETF（512990）、500ETF 基金（512500）、中小 100（159902）、双创基金(159783)、创业板 HX（159957）、科创 50ETF（588000）、中证 1000（159845）、央企改革 ETF（512950）、四川国改（159962）、浙江国资 ETF（515760）、战略新兴 ETF（512770）、5GETF（515050）、人工智能 AIETF（515070）、芯片 ETF（159995）、新能源车 ETF（515030）、智能车(159888)、高端装备 ETF(516320)、大湾区（159983）、沪港深 ETF(517170)、消费 ETF 基金（510630）、金融地产 ETF（510650）、医药卫生 ETF（510660）、食品饮料 ETF（515170）、券商 ETF 基金（515010）、银行 ETF 华夏（515020）、房地产 ETF 基金（515060）、大数据 50ETF（516000）、生物科技 ETF（516500）、新能源 80ETF（516850）、游戏 ETF（159869）、有色 50ETF(516650)、创蓝筹（159966）、创成长（159967）、恒生 ETF（513660）、恒生 ETF（159920）、恒生科技指数 ETF(513180)、恒生互联网 ETF（513330）、H 股 50（159850）、日经 ETF（513520）、纳斯达克 ETF（513300）、中期信用 ETF（511280）、豆粕 ETF（159985）、黄金 ETF9999（518850），初步形成了覆盖大盘蓝筹、宽基指数、中小创指数、主题指数、行业指数、Smart Beta 策略、海外市场指数、信用债指数、商品指数等较为完整的产品线。

华夏基金以深入的投资研究为基础，尽力捕捉市场机会，为投资人谋求良好的回报。根据银河证券基金研究中心《中国基金业绩评价报告》，截至 2021 年 6 月 30 日，华夏基金旗下多只产品近 1 年同类排名领先（基金排名不作为产品未来表现的保证），其中：

主动权益产品：在 QDII 混合基金（A 类）中华夏新时代混合（QDII）排序第 1/36、华夏移动互联混合（QDII）排序第 4/36；在其他行业股票型基金（A 类）中华夏能源革新股票排序第 2/36；在消费行业偏股型基金（股票上下限 60%-95%）（A 类）中华夏新兴消费混合(A 类)排序第 2/21；在

标准股票型基金（A 类）中华夏潜龙精选股票排序第 37/226；在绝对收益目标基金（A 类）中华夏回报混合(A 类)排序第 25/139、华夏回报二号混合排序第 27/139；在灵活配置型基金（股票上下限 0-95%+基准股票比例 30%60%）（A 类）中华夏军工安全混合排序第 39/491；在灵活配置型基金（股票上下限 0-95%+基准股票比例 30%-60%）（A 类）中华夏高端制造混合排序第 15/491、华夏稳盛混合排序第 54/491；在偏股型基金（股票上下限 60%-95%）（A 类）中华夏行业景气混合排序第 9/566、华夏行业龙头混合排序第 36/566；在偏股型基金（股票上限 80%）（A 类）中华夏经典混合排序第 11/128；在偏股型基金（股票上限 95%）（A 类）中华夏兴和混合排序第 11/168、华夏兴华混合(A 类)排序第 32/168、华夏大盘精选混合(A 类)排序第 40/168；在偏债型基金（A 类）中华夏睿磐泰茂混合(A 类)排序第 44/149。FOF 类产品中，在养老目标风险 FOF（权益资产 0-30%）（A 类）中华夏稳健养老一年持有混合（FOF）排序第 4/20；在 QDII 混合基金（A 类）中华夏全球聚享（QDII）(A 类)排序第 10/36；

固收与固收+产品：在普通债券型基金（可投转债）（A 类）中华夏聚利债券排序第 1/196、华夏双债债券(A 类)排序第 3/196、华夏债券(A/B 类)排序第 12/196；在可转换债券型基金（A 类）中华夏可转债增强债券(A 类)排序第 3/34；在定期开放式纯债债券型基金（摊余成本法）（A 类）中华夏恒泰 64 个月定开债券排序第 12/73；在短期纯债债券型基金（A 类）中华夏短债债券(A 类)排序第 12/53；在偏债型基金（A 类）中华夏永康添福混合排序第 18/149；在普通债券型基金（二级）（A 类）中华夏安康债券(A 类)排序第 40/248、华夏鼎利债券(A 类)排序第 41/248。在 QDII 债券型基金（非 A 类）中华夏收益债券（QDII）(A 类)(美元)排序第 2/35、华夏大中华信用债券（QDII）(A 类)（美元）排序第 4/35；

指数与量化产品：在策略指数股票 ETF 基金中华夏创成长 ETF 排序第 1/22、华夏创蓝筹 ETF 排序第 6/22；在规模指数股票 ETF 基金中华夏创业板 ETF 排序第 1/90、华夏 MSCI 中国 A 股国际通 ETF 排序第 26/90；在行业指数股票 ETF 基金中华夏消费 ETF 排序第 4/39、华夏医药 ETF 排序第 5/39；在增强规模指数股票型基金（A 类）中华夏中证 500 指数增强(A 类)排序第 6/93；在主题指数股票 ETF 基金中华夏中证新能源汽车 ETF 排序第 3/88、华夏中证四川国改 ETF 排序第 8/88、华夏战略新兴成指 ETF 排序第 11/88。

在《上海证券报》主办的第十八届“金基金”奖评选活动上，华夏基金凭借卓越的投资实力以及优秀的中长期业绩回报，荣膺四大奖项：公司层面，华夏基金荣获“金基金 被动投资基金管理公司奖”；产品层面，华夏创新前沿股票荣获“金基金 股票型基金三年期奖”，华夏沪深 300ETF 荣获“金基金 指数基金三年期奖”，华夏能源革新股票荣获“金基金 社会责任投资（ESG）基金奖”。

在客户服务方面，2021 年上半年度，华夏基金继续以客户需求为导向，努力提高客户使用的便

利性和服务体验:（1）华夏基金管家客户端上线理财小管家和微信登录等功能，方便客户及时了解市场观点、投资者教育等信息，也为客户提供了多样的登录方式；（2）华夏基金公众号上线选基助手微信小程序，包含花样选基、目标选基、我的实验田等 5 大功能模块，帮助客户进行产品筛选；（3）与民商基金销售、众惠基金等代销机构合作，提供更多便捷的理财渠道；（4）开展“都 2021 年了，你还要自己记么？”、“震荡市需要口服镇心丸”、“风往哪吹”等活动，为客户提供了多样化的投资者教育和关怀服务。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
黄文倩	本基金的基金经理、投委会成员	2021-02-03	-	13 年	硕士。曾任中国国际金融有限公司高级经理。2011 年 11 月加入华夏基金管理有限公司。曾任投资研究部研究员、投资经理、华夏新兴消费混合型证券投资基金基金经理（2018 年 11 月 7 日至 2020 年 5 月 7 日期间)等。

注：①上述任职日期”和“离任日期”为根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。首任基金经理的，其“任职日期”为基金合同生效日。

②证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值(元)	任职时间
黄文倩	公募基金	4	8,197,474,657.66	2016/2/3
	私募资产管理计划	1	59,723,352.30	2021/3/15
	其他组合	-	-	-
	合计	5	8,257,198,009.96	

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《基金管理公司开展投资、研究活动防控内幕交易指导意见》等法律法规和基金合同，本着诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在严格控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《华夏基金管理有限公司公平交易制度》的规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，本基金管理人旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的交易共有 41 次，其中 20 次为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易，其余 21 次为不同基金经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易，有关基金经理已根据公司管理要求提供决策依据。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2021 年上半年，中国 PMI 和出口仍在上升通道，国内经济仍然处于较好状态，但到二季度经济加速修复期基本结束，PPI 加速上冲，5 月冲击全年同比高点，CPI 温和回升。新冠病毒复发，但国内外管控手段进步，加上疫苗接种加速，对生产影响较小，对国内消费有一定负面影响，使得上半年消费同比 2019 年同期的增长并不理想，大众耐用消费和餐饮出行消费甚至低于 2019 年同期。另外，在消费的部分领域，教育、互联网，国家出台以反垄断、公平、减负、数据安全为导向的政策调整和监管，对相关领域发展带来干扰。全球在接种新冠疫苗过程中，经济复苏开始分化，欧美发达国家好于新兴国家，美国恢复好于欧洲，但在变异毒株流行后，疫苗有效率下降，二季度末欧美发达国家新增病例又开始抬升。流动性预期两次急转，2 月初中国和美国国债利率快速抬升，中央工作会议对“不急转弯的”定调和美国对退出 QE 预期，导致流动性预期变差，但 4 月后货币政策基调调整为以金融稳定为核心，流动性预期明显好转，美联储也偏鸽派，希望拉开削减 QE 和加息的距离。美国和中国在新疆问题上的摩擦，美国对中概股的审计要求，对市场的风险偏好有进一步冲击。

报告期内，A 股市场伴随流动性预期和影响风险偏好事件的发生，在 2 月出现核心资产急跌，4 月后 PMI 驱动的周期板块和新能源为代表的成长板块大幅反弹。6-7 月教育培训政策出台，导致美股教培行业暴跌，联动港股互联网和 A 股外资持股占比较大的板块急跌，进一步拖累消费股表现。上半年，消费板块大幅跑输大盘，内地消费指数下跌 17%，中证医药指数微跌。成长性较好的板块，白酒医药医美等表现较好，美国和中国在新疆棉上的摩擦，催生国民品牌服装、尤其运动服销售高涨，受原材料成本上涨负面影响的家电行业表现最差。港股市场表现弱于 A 股，主要受互联网反垄

断和教育培训政策影响，导致港股互联网和教育相关股票大幅回撤。

报告期内，本基金完成建仓，严格控制买入成本，春节前主要加仓价格合理的家电、低估值品种，3-4 月逆向加仓 2-3 月下跌较多的优质资产，包括白酒、运动服等，5 月加仓受益民促法的高教个股，7 月加仓错杀的免税行业。但受 6-7 月教育培训政策出台，外资持仓较多的白酒、互联网、高教行业出现大幅回调，基金净值受挫。我们减仓了高教和互联网，但保持了对白酒的仓位，认为属于恐慌性下跌，并加仓了恐慌情绪下下跌的医药和医疗服务个股。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2021 年 6 月 30 日，华夏消费龙头混合 A 基金份额净值为 0.9639 元，本报告期份额净值增长率为-3.61%;华夏消费龙头混合 C 基金份额净值为 0.9619 元，本报告期份额净值增长率为-3.81%，同期业绩比较基准增长率为-7.00%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，疫情零星反复下，经济仍然有较强韧性，如果全球疫情反复导致上游供给仍然不足，会导致 PPI 维持高位，下游消费品竞争格局较好的行业也会有持续提价（高端白酒、家电、乳制品等），有望在 2022 年迎来较好的利润增长，因此经过上半年的下跌和估值消化，我们认为下半年是布局消费的好机会。此外，我们将更多的机会放在新兴需求的研究上，会挖掘更多类似扫地机的智能化硬件、关注显示行业的技术变化，在医疗服务、疫苗、医美挖掘价格合适的新标的，对政策负面影响的电子烟、互联网领域保持持续跟踪。

珍惜基金份额持有人的每一分投资和每一份信任，本基金将继续奉行华夏基金管理有限公司“为信任奉献回报”的经营理念，规范运作，审慎投资，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求长期、稳定的回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及基金合同约定，本基金管理人为准确、及时进行基金估值和份额净值计价，制定了基金估值和份额净值计价的业务管理制度，建立了估值委员会，使用可靠的估值业务系统，设有完善的风险监测、控制和报告机制。本基金托管人审阅本基金管理人采用的估值原则及技术，并复核、审查基金资产净值和基金份额申购、赎回价格。会计师事务所在估值调整导致基金资产净值的变化在 0.25%以上时对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性发表专业意见。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在华夏消费龙头混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§6 中期报告财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华夏消费龙头混合型证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日
资产：		-
银行存款	6.4.7.1	794,454,769.69
结算备付金		2,467,899.14
存出保证金		636,353.88

交易性金融资产	6.4.7.2	2,519,059,924.73
其中：股票投资		2,519,059,924.73
基金投资		-
债券投资		-
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-
应收证券清算款		29,299,085.71
应收利息	6.4.7.5	103,475.44
应收股利		1,032,949.28
应收申购款		1,044,229.26
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		3,348,098,687.13
负债和所有者权益	**附注号**	**本期末 2021 年 6 月 30 日**
负债：		-
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		-
应付赎回款		16,749,894.85
应付管理人报酬		4,244,380.62
应付托管费		707,396.78
应付销售服务费		76,173.98
应付交易费用	6.4.7.7	1,633,188.82
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	109,446.28
负债合计		23,520,481.33
所有者权益：		-
实收基金	6.4.7.9	3,449,601,620.31
未分配利润	6.4.7.10	-125,023,414.51
所有者权益合计		3,324,578,205.80
负债和所有者权益总计		3,348,098,687.13

注：①报告截止日 2021 年 6 月 30 日，华夏消费龙头混合 A 基金份额净值 0.9639 元，华夏消费龙头混合 C 基金份额净值 0.9619 元；华夏消费龙头混合基金份额总额 3,449,601,620.31 份（其中 A 类 3,265,214,493.64 份，C 类 184,387,126.67 份）。

②本基金合同于 2021 年 2 月 3 日生效，本报告期自 2021 年 2 月 3 日至 2021 年 6 月 30 日。

6.2 利润表

会计主体：华夏消费龙头混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 2 月 3 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 2 月 3 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
一、收入		-99,527,015.77
1.利息收入		6,837,501.00
其中：存款利息收入	6.4.7.11	2,462,567.86
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		4,374,933.14
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-16,668,811.56
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-28,150,236.54
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.14	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-
股利收益	6.4.7.17	11,481,424.98
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-90,189,767.97
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	494,062.76
减：二、费用		28,935,250.66
1.管理人报酬		21,360,254.53
2.托管费		3,560,042.37
3.销售服务费		400,593.87
4.交易费用	6.4.7.20	3,522,812.94
5.利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6.税金及附加		-
7.其他费用	6.4.7.21	91,546.95
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-128,462,266.43
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-128,462,266.43

注：本基金合同于 2021 年 2 月 3 日生效，本报告期自 2021 年 2 月 3 日至 2021 年 6 月 30 日。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华夏消费龙头混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 2 月 3 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 2 月 3 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	3,629,639,400.20	-	3,629,639,400.20
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-128,462,266.43	-128,462,266.43
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-180,037,779.89	3,438,851.92	-176,598,927.97
其中：1.基金申购款	33,851,155.08	-654,247.78	33,196,907.30
2.基金赎回款	-213,888,934.97	4,093,099.70	-209,795,835.27
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	3,449,601,620.31	-125,023,414.51	3,324,578,205.80

注：本基金合同于 2021 年 2 月 3 日生效，本报告期自 2021 年 2 月 3 日至 2021 年 6 月 30 日。报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：杨明辉，主管会计工作负责人：朱威，会计机构负责人：朱威

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华夏消费龙头混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）已获中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2020]3445 号《关于准予华夏消费龙头混合型证券投资基金注册的批复》，由华夏基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《华夏消费龙头混合型证券投资基金基金合同》及其他有关法律法规负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限为不定期。本基金自 2021 年 1 月 28 日至 2021 年 2 月 1 日共募集 3,629,409,813.85 元（不含认购资金利息），业经安永华明会计师事

务所（特殊普通合伙）安永华明（2021）验字第 60739337_A17 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华夏消费龙头混合型证券投资基金基金合同》于 2021 年 2 月 3 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 3,629,639,400.20 份基金份额，其中认购资金利息折合 229,586.35 份基金份额。本基金的基金管理人为华夏基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和本基金基金合同的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行或上市的股票(包括中小板、创业板、存托凭证及其他中国证监会核准或注册上市的股票)、港股通标的股票、债券(包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、衍生品（包括股指期货、国债期货、股票期权等）、资产支持证券、货币市场工具（含同业存单）、债券回购、银行存款以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

本基金可根据相关法律法规和《基金合同》的约定，参与融资业务。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布和修订的《企业会计准则－基本准则》、各项具体会计准则及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”) 、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会发布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》和中国证监会、中国基金业协会允许的如财务报表附注 6.4.4 所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本会计报表的实际编制期间为 2021 年 2 月 3 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

1、金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金目前暂无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

2、金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债包括交易性金融负债及衍生金融负债等。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利、债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及金融负债按照公允价值进行后续计量，应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

1、存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应

考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

2、当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

3、如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。对于曾经实施份额拆分或折算的基金，由于基金份额拆分或折算引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日或基金份额折算日根据拆分前或折算前的基金份额数及确定的拆分或折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。对于已开放转换业务的基金，上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

境内基金投资在持有期间应取得的现金红利于除息日确认为投资收益；境外基金投资在持有期间应取得的基金分红收益扣除基金交易所在地适用的预缴所得税后的净额确认投资收益。境内股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益；境外股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除股票交易所在地适用的预缴所得税后的净额确认为投资收益。境内债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。境外债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在交易所在地适用的预缴所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的

预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；处置时其公允价值与初始确认金额之间的差额扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的按直线法近似计算。

6.4.4.10 费用的确认和计量

针对基金合同约定费率和计算方法的费用，本基金在费用涵盖期间按合同约定进行确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的按直线法近似计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

同一类别内的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红权益再投资日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。期末可供分配利润指期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

由于本基金各基金份额类别在费用收取上不同，其对应的可分配收益可能有所不同。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

6.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，与所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

6.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：（1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；（2）本基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；（3）本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个经营分部运作。

6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

1、对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况参考《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》对重大影响基金资产净值的特殊事项停牌股票进行估值。

2、对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6 号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》进行估值。

3、对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场交易的固定收益品种，按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

4、本基金作为境外投资者在各个国家和地区证券市场的投资所得的相关税负是基于其现行的税法法规。各个国家和地区的税收规定可能发生变化，或者实施具有追溯力的修订，从而导致本基金在正常的经营活动中，部分交易和事项的最终税务处理存在不确定性。在计提和处理税收费用时，本基金需要作出相关会计估计。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

根据财税[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]103 号《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81 号《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]125 号《财政部、国家税务总局、证监会关于内地与香港基金互认有关税收政策的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《财政部、国家税务总局关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《财政部、国家税务总局关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

（1）以发行基金方式募集资金不属于增值税征收范围，不征收增值税。

（2）资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。

（3）基金买卖股票、债券的差价收入免征增值税，暂不征收企业所得税。

（4）存款利息收入不征收增值税。

（5）国债、地方政府债利息收入，金融同业往来利息收入免征增值税。

（6）对基金取得的债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

（7）基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

（8）对基金在境内取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利收入时代扣代缴 20%的个人所得税，暂不征收企业所得税。基金在境内从上市公司分配取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，全额计入应纳税所得额，持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，减按 50%计入应纳税所得额，持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20%的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得

的股息红利，由中国结算按照 20%的税率代扣个人所得税。对香港市场投资者取得的股息、红利收入按照 10%的税率代扣所得税。

（9）基金在境内卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

（10）基金在境外证券交易所进行交易或取得的源自境外证券市场的收益，其涉及的税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行。

（11）本基金分别按实际缴纳的增值税额的 5%、3%、2%缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
活期存款	794,454,769.69
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计	794,454,769.69

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2021 年 6 月 30 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		2,609,249,692.70	2,519,059,924.73	-90,189,767.97
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		2,609,249,692.70	2,519,059,924.73	-90,189,767.97

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	98,008.96
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	5,183.68
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	282.80
合计	103,475.44

6.4.7.6 其他资产

无。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	1,633,188.82
银行间市场应付交易费用	-
合计	1,633,188.82

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日

应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	38,019.44
应付证券出借违约金	-
预提费用	71,426.84
合计	109,446.28

6.4.7.9 实收基金

华夏消费龙头混合 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年2月3日（基金合同生效日）至2021年6月30日	
	基金份额	账面金额
基金合同生效日	3,422,279,502.76	3,422,279,502.76
本期申购	23,459,306.75	23,459,306.75
本期赎回（以“-”号填列）	-180,524,315.87	-180,524,315.87
本期末	3,265,214,493.64	3,265,214,493.64

华夏消费龙头混合 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年2月3日（基金合同生效日）至2021年6月30日	
	基金份额	账面金额
基金合同生效日	207,359,897.44	207,359,897.44
本期申购	10,391,848.33	10,391,848.33
本期赎回（以“-”号填列）	-33,364,619.10	-33,364,619.10
本期末	184,387,126.67	184,387,126.67

注：本基金在募集期间共募集有效净认购资金 3,629,409,813.85 元，根据本基金招募说明书的规定，认购资金在募集期间产生的利息 229,586.35 元在本基金合同生效后，折算为 229,586.35 份基金份额，计入基金份额持有者账户。

6.4.7.10 未分配利润

华夏消费龙头混合 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-35,777,446.56	-85,324,320.79	-121,101,767.35
本期基金份额交易产生的变动数	803,489.86	2,296,628.13	3,100,117.99
其中：基金申购款	-122,095.00	-298,866.61	-420,961.61
基金赎回款	925,584.86	2,595,494.74	3,521,079.60
本期已分配利润	-	-	-

本期末	-34,973,956.70	-83,027,692.66	-118,001,649.36

华夏消费龙头混合 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-2,495,051.90	-4,865,447.18	-7,360,499.08
本期基金份额交易产生的变动数	156,886.06	181,847.87	338,733.93
其中：基金申购款	-67,355.29	-165,930.88	-233,286.17
基金赎回款	224,241.35	347,778.75	572,020.10
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-2,338,165.84	-4,683,599.31	-7,021,765.15

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 2 月 3 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	2,284,139.20
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	170,326.10
其他	8,102.56
合计	2,462,567.86

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 2 月 3 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	231,566,114.59
减：卖出股票成本总额	259,716,351.13
买卖股票差价收入	-28,150,236.54

6.4.7.13 债券投资收益

无。

6.4.7.14 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.15 贵金属投资收益

6.4.7.15.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.15.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.15.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.15.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.16 衍生工具收益

6.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年2月3日（基金合同生效日）至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	11,481,424.98
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	11,481,424.98

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年2月3日（基金合同生效日）至2021年6月30日
1.交易性金融资产	-90,189,767.97
——股票投资	-90,189,767.97
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-

合计	-90,189,767.97

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年2月3日（基金合同生效日）至2021年6月30日
基金赎回费收入	494,062.76
合计	494,062.76

6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年2月3日（基金合同生效日）至2021年6月30日
交易所市场交易费用	3,522,812.94
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	3,522,812.94

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年2月3日（基金合同生效日）至2021年6月30日
审计费用	22,288.80
信息披露费	49,138.04
证券出借违约金	-
银行费用	20,120.11
合计	91,546.95

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系

华夏基金管理有限公司	基金管理人
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人
中信证券股份有限公司（“中信证券”）	基金管理人的股东
上海华夏财富投资管理有限公司（“华夏财富”）	基金管理人的子公司
中信证券华南股份有限公司（“中信证券（华南）”）	基金管理人股东控股的公司
中信证券（山东）有限责任公司（“中信证券（山东）”）	基金管理人股东控股的公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年2月3日（基金合同生效日）至2021年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
中信证券	680,988,980.79	22.04%

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年2月3日（基金合同生效日）至2021年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
中信证券	2,458,200,000.00	19.97%

6.4.10.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年2月3日（基金合同生效日）至2021年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
中信证券	514,583.32	23.37%	406,098.72	24.87%

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年2月3日（基金合同生效日）至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	21,360,254.53
其中：支付销售机构的客户维护费	9,712,040.76

注：①支付基金管理人的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

②基金管理人报酬计算公式为：日基金管理人报酬＝前一日基金资产净值×1.50%/当年天数。

③客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用按照代销机构所代销基金的份额保有量作为基数进行计算，从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年2月3日（基金合同生效日）至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	3,560,042.37

注：①支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

②基金托管费计算公式为：日基金托管费＝前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2021年2月3日（基金合同生效日）至2021年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华夏消费龙头混合 A	华夏消费龙头混合 C	合计
中国银行	-	61,171.49	61,171.49
华夏基金管理有限公司	-	29,661.06	29,661.06
中信证券	-	5,457.62	5,457.62
华夏财富	-	2,514.55	2,514.55
中信证券（山东）	-	1,263.52	1,263.52
中信证券（华南）	-	547.00	547.00
合计	-	100,615.24	100,615.24

注：①支付基金销售机构的基金销售服务费按 C 类基金份额前一日基金资产净值 0.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给基金管理人，再由基金管理人计算并支付给各基金销售

机构。

②基金销售服务费计算公式为：C 类日基金销售服务费＝前一日 C 类基金资产净值×0.50%/当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年2月3日（基金合同生效日）至2021年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国银行活期存款	794,454,769.69	2,284,139.20

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2021 年 2 月 3 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
中信证券	600905	三峡能源	网下申购	1,296,803	3,436,527.95
中信证券	688660	电气风电	网下申购	51,238	278,734.72
中信证券	688276	百克生物	网下申购	3,486	126,716.10
中信证券	688575	亚辉龙	网下申购	3,435	50,838.00
中信证券	300982	苏文电能	网下申购	3,170	50,181.10

中信证券	300993	玉马遮阳	网下申购	4,097	49,573.70
中信证券	688315	诺禾致源	网下申购	3,711	47,352.36
中信证券	300997	欢乐家	网下申购	9,279	45,838.26
中信证券	603529	爱玛科技	网下申购	1,019	28,389.34
中信证券	688690	纳微科技	网下申购	3,477	28,059.39
中信证券	300966	共同药业	网下申购	2,858	23,549.92
中信证券	688565	力源科技	网下申购	2,464	23,136.96
中信证券	688226	威腾电气	网下申购	2,693	17,289.06
中信证券	605488	福莱新材	网下申购	416	8,498.88
中信证券	001208	华菱线缆	网下申购	1,754	6,437.18
中信证券	003040	楚天龙	网下申购	1,101	5,086.62
中信证券	601279	英利汽车	网下申购	2,004	4,148.28

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配事项。

6.4.12 期末（2021 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600905	三峡能源	2021-06-02	2021-12-10	新发流通受限	2.65	5.67	907,763	2,405,571.95	5,147,016.21	-
688606	奥泰生物	2021-03-17	2021-09-27	新发流通受限	133.67	139.31	2,703	361,310.01	376,554.93	-
300957	贝	2021-03-18	2021-09-27	新	47.33	251.96	853	40,372.49	214,921.88	-

	泰妮			发流通受限						
688499	利元亨	2021-06-23	2021-07-01	新发流通受限	38.85	38.85	2,149	83,488.65	83,488.65	-
300979	华利集团	2021-04-15	2021-10-26	新发流通受限	33.22	87.50	925	30,728.50	80,937.50	-
688239	航宇科技	2021-06-25	2021-07-05	新发流通受限	11.48	11.48	4,926	56,550.48	56,550.48	-
300981	中红医疗	2021-04-19	2021-10-27	新发流通受限	48.59	90.39	601	29,202.59	54,324.39	-
688087	英科再生	2021-06-30	2021-07-09	新发流通受限	21.96	21.96	2,469	54,219.24	54,219.24	-
301017	漱玉平民	2021-06-23	2021-07-05	新发流通受限	8.86	8.86	4,995	44,255.70	44,255.70	-
300973	立高食	2021-04-08	2021-10-15	新发流	28.28	115.71	360	10,180.80	41,655.60	-

	品			通受限						
301020	密封科技	2021-06-28	2021-07-06	新发流通受限	10.64	10.64	3,789	40,314.96	40,314.96	-
688367	工大高科	2021-06-21	2021-12-28	新发流通受限	11.53	17.94	1,717	19,797.01	30,802.98	-
688681	科汇股份	2021-06-04	2021-12-16	新发流通受限	9.56	14.54	1,899	18,154.44	27,611.46	-
301021	英诺激光	2021-06-28	2021-07-06	新发流通受限	9.46	9.46	2,609	24,681.14	24,681.14	-
300953	震裕科技	2021-03-11	2021-09-22	新发流通受限	28.77	99.85	240	6,904.80	23,964.00	-
301015	百洋医药	2021-06-22	2021-12-30	新发流通受限	7.64	38.83	462	3,529.68	17,939.46	-
688226	威腾电气	2021-06-28	2021-07-07	新发流通受	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	-

				限						
300982	苏文电能	2021-04-19	2021-10-27	新发流通受限	15.83	45.29	317	5,018.11	14,356.93	-
300968	格林精密	2021-04-06	2021-10-15	新发流通受限	6.87	12.07	1,162	7,982.94	14,025.34	-
300614	百川畅银	2021-05-18	2021-11-25	新发流通受限	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02	-
301013	利和兴	2021-06-21	2021-12-29	新发流通受限	8.72	27.11	471	4,107.12	12,768.81	-
300997	欢乐家	2021-05-26	2021-12-02	新发流通受限	4.94	13.05	928	4,584.32	12,110.40	-
301002	崧盛股份	2021-05-27	2021-12-07	新发流通受限	18.71	57.62	201	3,760.71	11,581.62	-
605287	德才股份	2021-06-28	2021-07-06	新发流通受限	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-
300955	嘉	2021-03-16	2021-09-24	新	16.53	46.07	232	3,834.96	10,688.24	-

	亨家化			发流通受限						
300996	普联软件	2021-05-26	2021-12-03	新发流通受限	20.81	42.23	241	5,015.21	10,177.43	-
300956	英力股份	2021-03-16	2021-09-27	新发流通受限	12.85	25.80	371	4,767.35	9,571.80	-
300962	中金辐照	2021-03-29	2021-10-11	新发流通受限	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12	-
301016	雷尔伟	2021-06-23	2021-12-30	新发流通受限	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50	-
300966	共同药业	2021-03-31	2021-10-11	新发流通受限	8.24	31.54	286	2,356.64	9,020.44	-
300961	深水海纳	2021-03-23	2021-09-30	新发流通受限	8.48	22.07	394	3,341.12	8,695.58	-
605162	新中港	2021-06-29	2021-07-07	新发流	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39	-

				通受限						
300958	建工修复	2021-03-18	2021-09-29	新发流通受限	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00	-
300986	志特新材	2021-04-21	2021-11-01	新发流通受限	14.79	30.57	264	3,904.56	8,070.48	-
300987	川网传媒	2021-04-28	2021-11-11	新发流通受限	6.79	26.81	301	2,043.79	8,069.81	-
300993	玉马遮阳	2021-05-17	2021-11-24	新发流通受限	12.10	19.29	410	4,961.00	7,908.90	-
300985	致远新能	2021-04-21	2021-10-29	新发流通受限	24.90	24.81	295	7,345.50	7,318.95	-
300971	博亚精工	2021-04-07	2021-10-15	新发流通受限	18.24	28.29	245	4,468.80	6,931.05	-
301004	嘉益股份	2021-06-18	2021-12-27	新发流通受	7.81	21.94	312	2,436.72	6,845.28	-

				限						
300991	创益通	2021-05-12	2021-11-22	新发流通受限	13.06	26.51	254	3,317.24	6,733.54	-
300975	商络电子	2021-04-14	2021-10-21	新发流通受限	5.48	13.03	492	2,696.16	6,410.76	-
300963	中洲特材	2021-03-30	2021-10-11	新发流通受限	12.13	22.49	283	3,432.79	6,364.67	-
301011	华立科技	2021-06-09	2021-12-17	新发流通受限	14.20	33.84	175	2,485.00	5,922.00	-
300967	晓鸣股份	2021-04-02	2021-10-13	新发流通受限	4.54	11.54	507	2,301.78	5,850.78	-
300972	万辰生物	2021-04-08	2021-10-19	新发流通受限	7.19	12.65	430	3,091.70	5,439.50	-
300960	通业科技	2021-03-22	2021-09-29	新发流通受限	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04	-
301017	漱	2021-06-23	2022-01-05	新	8.86	8.86	555	4,917.30	4,917.30	-

	玉平民			发流通受限						
301020	密封科技	2021-06-28	2022-01-06	新发流通受限	10.64	10.64	421	4,479.44	4,479.44	-
300995	奇德新材	2021-05-17	2021-11-26	新发流通受限	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	-
301007	德迈仕	2021-06-04	2021-12-16	新发流通受限	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	-
300998	宁波方正	2021-05-25	2021-12-02	新发流通受限	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	-
301012	扬电科技	2021-06-15	2021-12-22	新发流通受限	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20	-
300992	泰福泵业	2021-05-17	2021-11-25	新发流通受限	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00	-
301010	晶雪节	2021-06-09	2021-12-20	新发流	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	-

	能			通受限						
301021	英诺激光	2021-06-28	2022-01-06	新发流通受限	9.46	9.46	290	2,743.40	2,743.40	-

注：①根据中国证监会《上市公司证券发行管理办法》、《创业板上市公司证券发行管理暂行办法》以及《上市公司非公开发行股票实施细则》，本基金作为特定投资者所认购的 2020 年 2 月 14 日前发行完毕的非公开发行股份，自发行结束之日起 12 个月内不得转让。根据《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》，本基金持有的上市公司非公开发行股份，采取集中竞价交易方式的，在任意连续 90 日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的 1%，且自股份解除限售之日起 12 个月内，通过集中竞价交易减持的数量不得超过本基金持有该次非公开发行股份数量的 50%；采取大宗交易方式的，在任意连续 90 日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的 2%。本基金通过大宗交易方式受让的原上市公司大股东减持或者特定股东减持的股份，在受让后 6 个月内，不得转让所受让的股份。

根据中国证监会《关于修改<上市公司证券发行管理办法>的决定》、《关于修改<创业板上市公司证券发行管理暂行办法>的决定》以及《关于修改<上市公司非公开发行股票实施细则>的决定》，本基金所认购的 2020 年 2 月 14 日(含)后发行完毕的非公开发行股份，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。此外，本基金减持上述非公开发行股份不适用《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》的有关规定。

②基金还可作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

③根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

④根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不

低于 6 个月的限售期。

⑤基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

⑥以上“可流通日”是根据上市公司公告估算的流通日期，最终日期以上市公司公告为准。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的风险管理政策是使基金投资风险可测、可控、可承担。本基金管理人建立了由风险管理委员会、督察长、法律部、合规部、稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的多层次风险管理架构体系。风险管理团队在识别、衡量投资风险后，通过正式报告的方式，将分析结果及时传达给基金经理、投资总监、投资决策委员会和风险管理委员会，协助制定风险控制决策，实现风险管理目标。

本基金管理人主要通过定性分析和定量分析的方法，估测各种金融工具风险可能产生的损失。本基金管理人从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重性；从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用的金融工具特征，通过特定的风险量化指标、模型和日常的量化报告，参考压力测试结果，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时对各种风险进行监督、检查和评估，并制定相应决策，将风险控制在预期可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指由于基金所投资债券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息，债券发行人信用评级降低导致债券价格下降，或基金在交易过程中发生交收违约，而造成基金资产损失的可能性。

本基金管理人通过信用分析团队建立了内部评级体系和交易对手库，对发行人及债券投资进行

内部评级，对交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度，以控制可能出现的信用风险。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是在市场或持有资产流动性不足的情况下，基金管理人可能无法迅速、低成本地调整基金投资组合，从而对基金收益造成不利影响。

本基金管理人通过限制投资集中度来管理投资品种变现的流动性风险。除在“6.4.12 期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限制的情况外，本基金所投资的证券均能及时变现。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

在日常运作中，本基金的流动性安排能够与基金合同约定的申购赎回安排以及投资者的申购赎回规律相匹配。

在资产端，本基金主要投资于基金合同约定的具有良好流动性的金融工具。基金管理人持续监测本基金持有资产的市场交易量、交易集中度等涉及资产流动性水平的风险指标，并定期开展压力测试，详细评估在不同的压力情景下资产变现情况的变化。

在负债端，基金管理人持续监测本基金开放期内投资者历史申赎、投资者类型和结构变化等数据，审慎评估不同市场环境可能带来的投资者潜在赎回需求，当市场环境或投资者结构发生变化时，及时调整组合资产结构及比例，预留充足现金头寸，保持基金资产可变现规模和期限与负债赎回规模和期限的匹配。

如遭遇极端市场情形或投资者非预期巨额赎回情形，基金管理人将采用本基金合同约定的赎回申请处理方式及其他各类流动性风险管理工具，控制极端情况下的潜在流动性风险。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指由于市场变化或波动所引起的资产损失的可能性，本基金管理人通过监测组合敏感性指标来衡量市场风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率变动引起组合中资产特别是债券投资的市场价格变动，从而影响基金投资收益的风险。

本基金管理人定期对组合中债券投资部分面临的利率风险进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

截至本期末，综合考虑利率债、信用债、同业存单、资产支持证券等资产占基金资产净值的比例，利率变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
银行存款	-	-	-	-
交易性金融资产	-	661,611,246.19	-	661,611,246.19
衍生金融资产	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-
应收股利	-	1,032,949.28	-	1,032,949.28
应收申购款	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产合计	-	662,644,195.47	-	662,644,195.47
以外币计价的负债				
应付在途资金	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-
应付换汇款	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-
应付赎回费	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变。	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末 2021 年 6 月 30 日
	港币相对人民币升值 5%	33,132,209.77
	港币相对人民币贬值 5%	-33,132,209.77

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险为除市场利率和外汇汇率以外的市场因素（单个证券发行主体自身经营情况或证券市场整体波动）发生变动时导致基金资产发生损失的风险。

本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险。此外，本基金管理人对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法进行风险度量和分析，以对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产－股票投资	2,519,059,924.73	75.77
交易性金融资产—基金投资	-	-
交易性金融资产－债券投资	-	-
交易性金融资产－贵金属投资	-	-
衍生金融资产－权证投资	-	-
其他	-	-
合计	2,519,059,924.73	75.77

注：①本表中交易性金融资产-债券投资科目仅包含可转换公司债券和可交换公司债券等。

②由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末 2021 年 6 月 30 日
	-5%	-159,612,923.60
	+5%	159,612,923.60

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

（1）金融工具公允价值计量的方法

根据企业会计准则的相关规定，以公允价值计量的金融工具，其公允价值的计量可分为三个层次：

第一层次：对存在活跃市场报价的金融工具，可以相同资产/负债在活跃市场上的报价确定公允价值。

第二层次：对估值日活跃市场无报价的金融工具，可以类似资产/负债在活跃市场上的报价为依据做必要调整确定公允价值；对估值日不存在活跃市场的金融工具，可以相同或类似资产/负债在非活跃市场上的报价为依据做必要调整确定公允价值。

第三层次：对无法获得相同或类似资产可比市场交易价格的金融工具，可以其他反映市场参与者对资产/负债定价时所使用的参数为依据确定公允价值。

（2） 各层次金融工具公允价值

截至 2021 年 6 月 30 日止，本基金持有的以公允价值计量的金融工具第一层次的余额为 2,512,778,846.39 元，第二层次的余额为 6,281,078.34 元，第三层次的余额为 0 元。

（3）公允价值所属层次间的重大变动

对于特殊事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)的股票，本基金将相关股票公允价值所属层次于其进行估值调整之日起从第一层次转入第二层次或第三层次，于股票复牌能体现公允价值并恢复市价估值之日起从第二层次或第三层次转入第一层次。对于持有的非公开发行股票，本基金于限售期内将相关股票公允价值所属层次列入第二层次，于限售期满并恢复市价估值之日起从第二层次转入第一层次。

（4）第三层次公允价值本期变动金额

本基金持有的以公允价值计量的金融工具第三层次公允价值本期未发生变动。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	2,519,059,924.73	75.24
	其中：股票	2,519,059,924.73	75.24
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	796,922,668.83	23.80
8	其他各项资产	32,116,093.57	0.96
9	合计	3,348,098,687.13	100.00

注：本基金本报告期末通过港股通机制投资香港股票的公允价值为 661,611,246.19 元，占基金资产净值比例为 19.90%。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	26,625,540.90	0.80
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,647,479,000.64	49.55
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,160,291.00	0.16
E	建筑业	25,371.37	0.00
F	批发和零售业	306,699.54	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	34,368.55	0.00
J	金融业	97,319.40	0.00
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	177,683,208.00	5.34
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	36,879.14	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,857,448,678.54	55.87

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
非必需消费品	452,747,849.90	13.62
通信服务	162,515,708.21	4.89
必需消费品	46,347,688.08	1.39
保健	-	-
材料	-	-
房地产	-	-
工业	-	-
公用事业	-	-
金融	-	-
能源	-	-
信息技术	-	-
合计	661,611,246.19	19.90

注：以上分类采用彭博提供的国际通用行业分类标准。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	000858	五 粮 液	1,064,074	316,977,003.86	9.53
2	600519	贵州茅台	150,678	309,899,442.60	9.32
3	601888	中国中免	592,080	177,683,208.00	5.34
4	03690	美团－W	594,900	158,599,407.20	4.77
5	002304	洋河股份	659,714	136,692,740.80	4.11
6	600690	海尔智家	5,180,934	134,237,999.94	4.04
7	00700	腾讯控股	275,400	133,826,421.89	4.03
8	000333	美的集团	1,868,121	133,327,795.77	4.01
9	01691	ＪＳ环球生活	5,209,000	94,704,558.13	2.85
10	603755	日辰股份	1,244,037	77,652,789.54	2.34
11	600809	山西汾酒	165,000	73,920,000.00	2.22
12	000651	格力电器	1,322,551	68,904,907.10	2.07
13	06169	宇华教育	10,754,000	62,905,763.89	1.89
14	000568	泸州老窖	259,099	61,131,818.06	1.84
15	688169	石头科技	45,231	57,036,291.00	1.72
16	600887	伊利股份	1,499,922	55,242,127.26	1.66
17	000661	长春高新	116,649	45,143,163.00	1.36
18	00291	华润啤酒	706,000	40,974,531.48	1.23
19	603486	科沃斯	177,600	40,507,008.00	1.22
20	000921	海信家电	2,375,329	34,133,477.73	1.03
21	02020	安踏体育	224,000	34,071,346.18	1.02
22	01890	中国科培	6,888,000	32,095,655.42	0.97
23	00839	中教控股	2,204,000	31,763,222.82	0.96
24	002832	比音勒芬	1,234,223	31,583,766.57	0.95
25	603866	桃李面包	954,020	29,765,424.00	0.90
26	01981	华夏视听教育	6,385,000	28,689,286.32	0.86
27	002714	牧原股份	437,556	26,612,155.92	0.80
28	01765	希望教育	14,798,000	23,025,534.10	0.69
29	002291	星期六	928,300	17,433,474.00	0.52
30	002241	歌尔股份	385,700	16,484,818.00	0.50
31	00667	中国东方教育	1,535,000	15,582,362.16	0.47
32	06969	思摩尔国际	150,000	5,373,156.60	0.16
33	600905	三峡能源	907,803	5,147,270.61	0.15
34	600276	恒瑞医药	54,942	3,734,407.74	0.11
35	688690	纳微科技	3,477	408,547.50	0.01
36	688606	奥泰生物	2,703	376,554.93	0.01

37	688276	百克生物	3,486	364,565.88	0.01
38	688161	威高骨科	3,069	325,467.45	0.01
39	301015	百洋医药	4,614	251,115.78	0.01
40	300957	贝泰妮	923	233,940.18	0.01
41	300973	立高食品	1,593	232,770.60	0.01
42	688601	力芯微	1,174	216,133.40	0.01
43	301013	利和兴	4,704	168,966.51	0.01
44	605499	东鹏饮料	632	158,505.60	0.00
45	688216	气派科技	2,000	133,400.00	0.00
46	301016	雷尔伟	2,747	115,711.58	0.00
47	301004	嘉益股份	3,115	90,654.98	0.00
48	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.00
49	300979	华利集团	925	80,937.50	0.00
50	601665	齐鲁银行	6,731	62,598.30	0.00
51	603529	爱玛科技	1,019	59,224.28	0.00
52	301012	扬电科技	1,691	56,994.16	0.00
53	688239	航宇科技	4,926	56,550.48	0.00
54	300981	中红医疗	601	54,324.39	0.00
55	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.00
56	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.00
57	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.00
58	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.00
59	688367	工大高科	1,717	30,802.98	0.00
60	688681	科汇股份	1,899	27,611.46	0.00
61	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.00
62	300953	震裕科技	240	23,964.00	0.00
63	001207	联科科技	682	22,581.02	0.00
64	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
65	300614	百川畅银	383	16,272.30	0.00
66	300968	格林精密	1,220	14,941.74	0.00
67	300955	嘉亨家化	314	14,830.88	0.00
68	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00
69	300996	普联软件	310	14,068.34	0.00
70	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
71	300997	欢乐家	979	13,067.16	0.00
72	300966	共同药业	358	12,311.56	0.00
73	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
74	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
75	300962	中金辐照	657	11,373.12	0.00
76	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
77	300958	建工修复	393	10,879.74	0.00
78	300956	英力股份	407	10,548.12	0.00
79	300971	博亚精工	345	10,457.05	0.00

80	300993	玉马遮阳	497	10,079.55	0.00
81	300961	深水海纳	436	9,727.10	0.00
82	300991	创益通	335	9,662.50	0.00
83	301011	华立科技	250	9,424.50	0.00
84	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
85	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
86	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
87	300963	中洲特材	330	7,821.67	0.00
88	300960	通业科技	332	7,806.84	0.00
89	301010	晶雪节能	372	7,514.96	0.00
90	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00
91	300992	泰福泵业	298	6,885.42	0.00
92	300967	晓鸣股份	561	6,749.88	0.00
93	300972	万辰生物	500	6,635.10	0.00
94	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
95	301007	德迈仕	341	5,156.98	0.00
96	300995	奇德新材	209	5,008.52	0.00
97	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
98	300998	宁波方正	203	4,347.24	0.00
99	605378	野马电池	73	3,353.62	0.00

注：所用证券代码采用当地市场代码。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	333,776,338.72	10.04
2	000858	五 粮 液	322,752,841.58	9.71
3	000333	美的集团	174,926,031.70	5.26
4	601888	中国中免	174,778,656.54	5.26
5	03690	美团－W	155,196,998.52	4.67
6	00700	腾讯控股	151,482,910.53	4.56
7	600690	海尔智家	146,288,982.10	4.40
8	000651	格力电器	139,023,752.00	4.18
9	002304	洋河股份	130,415,664.76	3.92
10	01691	Ｊ Ｓ环球生活	99,603,323.51	3.00
11	603755	日辰股份	76,995,734.34	2.32
12	00667	中国东方教育	68,301,388.51	2.05
13	600276	恒瑞医药	68,224,470.02	2.05
14	06169	宇华教育	68,216,866.88	2.05
15	600887	伊利股份	65,677,054.17	1.98

16	000661	长春高新	53,527,771.66	1.61
17	002714	牧原股份	53,166,067.96	1.60
18	000568	泸州老窖	52,868,497.96	1.59
19	688169	石头科技	52,043,395.54	1.57
20	600809	山西汾酒	51,886,013.08	1.56

注：“买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例（%）
1	000651	格力电器	52,270,532.87	1.57
2	600276	恒瑞医药	46,552,452.76	1.40
3	00667	中国东方教育	31,193,421.60	0.94
4	603486	科沃斯	26,740,186.10	0.80
5	002714	牧原股份	15,627,880.60	0.47
6	002705	新宝股份	13,145,260.68	0.40
7	603233	大参林	12,701,691.40	0.38
8	002832	比音勒芬	9,279,273.00	0.28
9	06969	思摩尔国际	6,537,726.00	0.20
10	600905	三峡能源	2,824,140.00	0.08
11	300957	贝泰妮	1,730,438.87	0.05
12	688538	和辉光电	1,506,375.56	0.05
13	300979	华利集团	773,297.53	0.02
14	688131	皓元医药	718,799.60	0.02
15	300981	中红医疗	687,017.02	0.02
16	688660	电气风电	518,544.38	0.02
17	688076	诺泰生物	393,571.00	0.01
18	300973	立高食品	279,994.00	0.01
19	688626	翔宇医疗	265,876.33	0.01
20	300953	震裕科技	234,226.50	0.01

注：“卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	2,868,966,043.83
卖出股票的收入（成交）总额	231,566,114.59

注：“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无股指期货投资。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末无股指期货投资。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末无国债期货投资。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无国债期货投资。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货投资。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 报告期内，本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求，未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	636,353.88
2	应收证券清算款	29,299,085.71
3	应收股利	1,032,949.28
4	应收利息	103,475.44

5	应收申购款	1,044,229.26
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	32,116,093.57

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
华夏消费龙头混合 A	39,089	83,532.82	15,978,923.44	0.49%	3,249,235,570.20	99.51%
华夏消费龙头混合 C	8,906	20,703.70	-	-	184,387,126.67	100.00%
合计	47,995	71,874.19	15,978,923.44	0.46%	3,433,622,696.87	99.54%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	华夏消费龙头混合 A	855,952.22	0.03%
	华夏消费龙头混合 C	50,111.26	0.03%
	合计	906,063.48	0.03%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	华夏消费龙头混合 A	0
	华夏消费龙头混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本	华夏消费龙头混合 A	10~50

开放式基金	华夏消费龙头混合 C	0
	合计	10~50

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华夏消费龙头混合 A	华夏消费龙头混合 C
基金合同生效日（2021 年 2 月 3 日）基金份额总额	3,422,279,502.76	207,359,897.44
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	23,459,306.75	10,391,848.33
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	180,524,315.87	33,364,619.10
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	3,265,214,493.64	184,387,126.67

注：本基金合同于 2021 年 2 月 3 日生效。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金管理人于 2021 年 4 月 9 日发布公告，郑煜女士、孙彬先生担任华夏基金管理有限公司副总经理，蔡向阳先生担任华夏基金管理有限公司高级管理人员。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金所聘用的会计师事务所未发生改变。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人、基金托管人涉及托管业务的部门及其高级管理人员在本报告期内无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华创证券	1	853,946,760.92	27.63%	395,988.93	17.99%	-
中信证券	3	680,988,980.79	22.04%	514,583.32	23.37%	-
安信证券	1	395,330,276.69	12.79%	370,261.25	16.82%	-
兴业证券	1	372,008,349.90	12.04%	272,048.62	12.36%	-
太平洋证券	1	321,540,603.69	10.41%	307,734.62	13.98%	-
民生证券	1	285,907,519.82	9.25%	209,084.63	9.50%	-
山西证券	1	109,618,741.78	3.55%	80,160.46	3.64%	-
东北证券	1	53,550,730.91	1.73%	39,161.14	1.78%	-
信达证券	1	17,083,178.00	0.55%	12,492.96	0.57%	-
海通证券	2	116,618.30	0.00%	108.61	0.00%	-

注：①为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择券商的标准，即：

ⅰ经营行为规范，在近一年内无重大违规行为。

ⅱ公司财务状况良好。

ⅲ有良好的内控制度，在业内有良好的声誉。

ⅳ有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告。

ⅴ建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯和服务。

②券商专用交易单元选择程序：

ⅰ对交易单元候选券商的研究服务进行评估

本基金管理人组织相关人员依据交易单元选择标准对交易单元候选券商的服务质量和研究实力进行评估，确定选用交易单元的券商。

ⅱ协议签署及通知托管人

本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。

③本基金合同于 2021 年 2 月 3 日生效，除本表列示外，本基金还选择了渤海证券、长城证券、

第一创业证券、东兴证券、方正证券、国泰君安证券、国信证券、恒泰证券、华安证券、华融证券、华泰证券、江海证券、开源证券、天风证券、万和证券、中泰证券、中信建投证券的交易单元作为本基金交易单元，本报告期无股票交易及应付佣金。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例
华创证券	-	-	-	-
中信证券	-	-	2,458,200,000.00	19.97%
安信证券	-	-	-	-
兴业证券	-	-	2,796,400,000.00	22.71%
太平洋证券	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-
山西证券	-	-	5,677,400,000.00	46.12%
东北证券	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-
海通证券	-	-	1,379,000,000.00	11.20%

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华夏消费龙头混合型证券投资基金基金合同生效公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-02-04
2	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-02-24
3	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-12
4	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-02
5	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-07
6	华夏基金管理有限公司公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-09
7	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-09
8	华夏消费龙头混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换、定期定额申购业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-13
9	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-21
10	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关	中国证监会指定报刊及	2021-05-08

	联方承销证券的公告	网站	
11	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-05-12
12	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-05-13
13	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-05-19
14	华夏基金管理有限公司关于深圳分公司营业场所变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-05-25
15	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-05-28
16	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-06-04
17	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-06-09
18	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-06-17
19	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-06-18
20	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-06-19
21	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-06-30

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

1、中国证监会准予基金注册的文件；

2、《华夏消费龙头混合型证券投资基金基金合同》；

3、《华夏消费龙头混合型证券投资基金托管协议》；

4、法律意见书；

5、基金管理人业务资格批件、营业执照；

6、基金托管人业务资格批件、营业执照。

12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

12.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的住所免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

华夏基金管理有限公司

二〇二一年八月三十日