

恒生交易型开放式指数  
证券投资基金联接基金  
2021 年第 3 季度报告  
2021 年 9 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：二〇二一年十月二十六日

## §1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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 10 月 22 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

## §2 基金产品概况

### 2.1 基金产品概况

|             |                                                                                                                                       |               |
|-------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------|
| 基金简称        | 华夏恒生 ETF 联接                                                                                                                           |               |
| 基金主代码       | 000071                                                                                                                                |               |
| 基金运作方式      | 契约型开放式                                                                                                                                |               |
| 基金合同生效日     | 2012 年 8 月 21 日                                                                                                                       |               |
| 报告期末基金份额总额  | 2,374,156,368.84 份                                                                                                                    |               |
| 投资目标        | 本基金主要通过对恒生 ETF 基金份额的投资，追求跟踪标的指数，获得与指数收益相似的回报。                                                                                         |               |
| 投资策略        | 本基金主要通过交易所买卖或申购赎回的方式投资于目标 ETF。基金也可以通过买入恒生指数成份股来跟踪标的指数。为了更好地实现投资目标，基金还可投资于境外证券市场的股票、债券、跟踪同一标的指数的其他基金、金融衍生工具等产品，并在法规允许的条件下参与证券借贷，以增加收益。 |               |
| 业绩比较基准      | 经人民币汇率调整的恒生指数收益率×95%+人民币活期存款税后利率×5%。                                                                                                  |               |
| 风险收益特征      | 本基金为恒生 ETF 的联接基金，恒生 ETF 为股票型指数基金，因此本基金的风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。                                                                       |               |
| 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                                                                                                                            |               |
| 境外资产托管人英文名称 | Bank of China (Hong Kong) Limited                                                                                                     |               |
| 境外资产托管人中文名称 | 中国银行（香港）有限公司                                                                                                                          |               |
| 下属分级基金的基金简称 | 华夏恒生 ETF 联接 A                                                                                                                         | 华夏恒生 ETF 联接 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 000071                                                                                                                                | 006381        |

|                 |                    |                  |
|-----------------|--------------------|------------------|
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 1,801,903,175.40 份 | 572,253,193.44 份 |
|-----------------|--------------------|------------------|

## 2.1.1 目标基金基本情况

|              |                  |
|--------------|------------------|
| 基金名称         | 恒生交易型开放式指数证券投资基金 |
| 基金主代码        | 159920           |
| 基金运作方式       | 交易型开放式           |
| 基金合同生效日      | 2012 年 8 月 9 日   |
| 基金份额上市的证券交易所 | 深圳证券交易所          |
| 上市日期         | 2012 年 10 月 22 日 |
| 基金管理人名称      | 华夏基金管理有限公司       |
| 基金托管人名称      | 中国银行股份有限公司       |

## 2.1.2 目标基金产品概况

|        |                                                                                                                                                                                            |
|--------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标   | 紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。                                                                                                                                                                  |
| 投资策略   | 主要投资策略包括组合复制策略、替代性策略、衍生品投资策略等。                                                                                                                                                             |
| 业绩比较基准 | 本基金的业绩比较基准为经人民币汇率调整的恒生指数收益率。                                                                                                                                                               |
| 风险收益特征 | 本基金属于股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股，在股票基金中属于中等风险、中等收益的产品。本基金为境外证券投资的基金，主要投资于香港证券市场中具有良好流动性的金融工具。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，本基金还面临汇率风险、香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。 |

## §3 主要财务指标和基金净值表现

## 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期<br>(2021 年 7 月 1 日-2021 年 9 月 30 日) |               |
|--------|-----------------------------------------|---------------|
|        | 华夏恒生 ETF 联接 A                           | 华夏恒生 ETF 联接 C |

|                |                  |                 |
|----------------|------------------|-----------------|
| 1.本期已实现收益      | -12,885,970.34   | -4,617,311.37   |
| 2.本期利润         | -338,264,439.85  | -112,300,575.18 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.2019          | -0.2128         |
| 4.期末基金资产净值     | 2,389,485,100.87 | 752,518,016.70  |
| 5.期末基金份额净值     | 1.3261           | 1.3150          |

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。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 本报告期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

华夏恒生 ETF 联接 A：

| 阶段             | 净值增长率<br>① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①—③   | ②—④    |
|----------------|------------|---------------|----------------|-----------------------|-------|--------|
| 过去三个月          | -13.45%    | 1.39%         | -13.94%        | 1.39%                 | 0.49% | 0.00%  |
| 过去六个月          | -12.81%    | 1.16%         | -13.92%        | 1.16%                 | 1.11% | 0.00%  |
| 过去一年           | 0.55%      | 1.17%         | -0.55%         | 1.17%                 | 1.10% | 0.00%  |
| 过去三年           | -11.97%    | 1.25%         | -15.23%        | 1.25%                 | 3.26% | 0.00%  |
| 过去五年           | 8.11%      | 1.12%         | 2.46%          | 1.12%                 | 5.65% | 0.00%  |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 32.61%     | 1.08%         | 24.13%         | 1.10%                 | 8.48% | -0.02% |

华夏恒生 ETF 联接 C：

| 阶段             | 净值增长率<br>① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①—③   | ②—④   |
|----------------|------------|---------------|----------------|-----------------------|-------|-------|
| 过去三个月          | -13.52%    | 1.39%         | -13.94%        | 1.39%                 | 0.42% | 0.00% |
| 过去六个月          | -12.94%    | 1.16%         | -13.92%        | 1.16%                 | 0.98% | 0.00% |
| 过去一年           | 0.25%      | 1.17%         | -0.55%         | 1.17%                 | 0.80% | 0.00% |
| 过去三年           | -12.78%    | 1.25%         | -15.23%        | 1.25%                 | 2.45% | 0.00% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | -11.00%    | 1.25%         | -13.55%        | 1.24%                 | 2.55% | 0.01% |

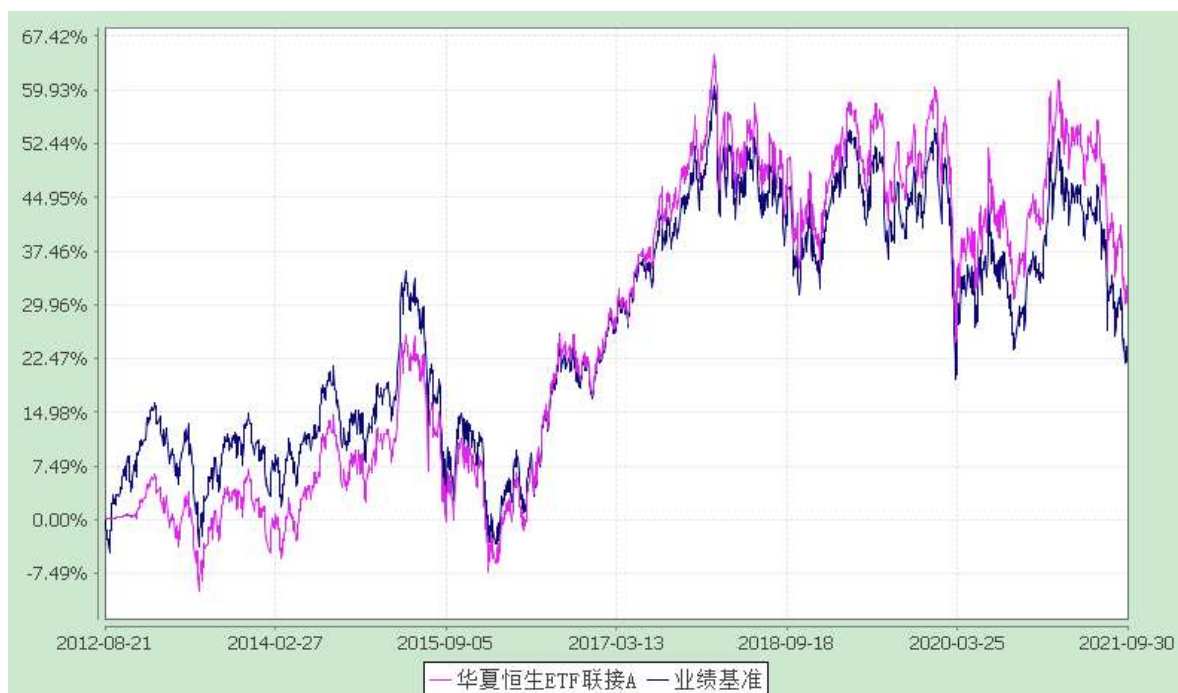
#### 3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

恒生交易型开放式指数证券投资基金联接基金

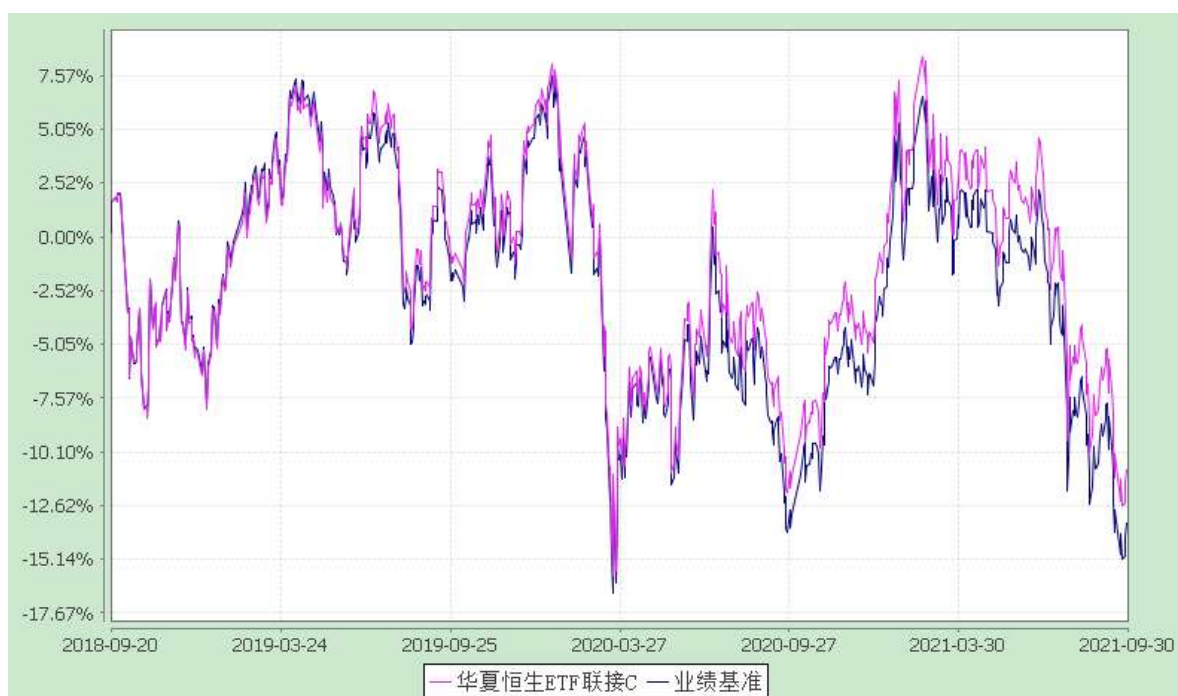
累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2012 年 8 月 21 日至 2021 年 9 月 30 日)

华夏恒生 ETF 联接 A:



华夏恒生 ETF 联接 C:



## §4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | 证券从业年 | 说明 |
|----|----|-------------|-------|----|
|----|----|-------------|-------|----|

|    |                | 任职日期       | 离任日期 | 限    |                                                                                                                                                                                                                                                               |
|----|----------------|------------|------|------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 徐猛 | 本基金的基金经理、投委会成员 | 2015-12-21 | -    | 18 年 | 硕士。曾任财富证券助理研究员，原中关村证券研究员等。2006 年 2 月加入华夏基金管理有限公司。曾任数量投资部基金经理助理、上证原材料交易型开放式指数发起式证券投资基金基金经理（2016 年 1 月 29 日至 2016 年 3 月 28 日期间）、华夏沪港通恒生交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2015 年 3 月 12 日至 2021 年 2 月 1 日期间）、华夏沪港通恒生交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（2015 年 3 月 12 日至 2021 年 2 月 1 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。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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 公平交易专项说明

##### 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，本公司严格执行了《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 14 次，均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。

#### 4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金跟踪的标的指数为香港恒生指数，业绩比较基准为：经人民币汇率调整的恒生指数收益率 $\times 95\%$  + 人民币活期存款税后利率 $\times 5\%$ 。恒生指数目前是以香港股市中市值最大及成交最活跃的 60 家蓝筹股票为成份股样本，以其经调整的流通市值为权数计算得到的加权平均股价指数。该指数自 1969 年 11 月 24 日起正式发布，是香港股市最有影响力的标杆性指数。本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好地跟踪标的指数，实现基金投资目标。

3 季度，新冠病毒在部分国家和地区出现较大反弹，拖累全球经济复苏的步伐，美国面临持续的通货膨胀压力，美联储或将逐步退出量化宽松政策。国内受疫情影响，消费增速下降，国内经济增速有放缓趋势；PPI 高位运行，给中下游企业带来较大压力。中国香港市场受到境外发达市场和 A 股市场的共同影响，国内互联网行业加强监管，互联网龙头企业出现较大跌幅，另外地产公司的信用事件也加大了市场的波动性，恒生指数整体呈现震荡下跌走势。

报告期内，本基金在做好跟踪标的指数的基础上，认真应对投资者日常申购、赎回等工作。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2021 年 9 月 30 日，华夏恒生 ETF 联接 A 份额净值为 1.3261 元，本报告期份额净值增长率为-13.45%，同期业绩比较基准增长率-13.94%，华夏恒生 ETF 联接 A 本报告期跟踪偏离度为+0.49%；华夏恒生 ETF 联接 C 份额净值为 1.3150 元，本报告期份额净值增长率为-13.52%，同期业绩比较基准增长率-13.94%，华夏恒生 ETF 联接 C 本报告期跟踪偏离度为+0.42%。与业绩比较基准产生偏离的主要原因为日常运作费用、指数结构调整、申购赎回、成份股分红等产生的差异。

#### 4.5 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目   | 金额(元) | 占基金总资产的比例(%) |
|----|------|-------|--------------|
| 1  | 权益投资 | -     | -            |

|   |                   |                  |        |
|---|-------------------|------------------|--------|
|   | 其中：普通股            | -                | -      |
|   | 存托凭证              | -                | -      |
|   | 优先股               | -                | -      |
|   | 房地产信托             | -                | -      |
| 2 | 基金投资              | 2,838,675,618.63 | 89.94  |
| 3 | 固定收益投资            | -                | -      |
|   | 其中：债券             | -                | -      |
|   | 资产支持证券            | -                | -      |
| 4 | 金融衍生品投资           | -                | -      |
|   | 其中：远期             | -                | -      |
|   | 期货                | -                | -      |
|   | 期权                | -                | -      |
|   | 权证                | -                | -      |
| 5 | 买入返售金融资产          | -                | -      |
|   | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -                | -      |
| 6 | 货币市场工具            | -                | -      |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计      | 292,262,764.33   | 9.26   |
| 8 | 其他各项资产            | 25,083,437.49    | 0.79   |
| 9 | 合计                | 3,156,021,820.45 | 100.00 |

## 5.2 报告期末在各个国家（地区）证券市场的股票及存托凭证投资分布

本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

## 5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

## 5.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的权益投资明细

### 5.4.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票及存托凭证投资明细

本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

## 5.5 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

## 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

## 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名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。

## 5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

| 序号 | 衍生品类别 | 衍生品名称                      | 公允价值<br>(元) | 占基金资产<br>净值比例 (%) |
|----|-------|----------------------------|-------------|-------------------|
| 1  | 股指期货  | HANG SENG<br>IDX FUT Oct21 | -           | -                 |
| 2  | -     | -                          | -           | -                 |
| 3  | -     | -                          | -           | -                 |
| 4  | -     | -                          | -           | -                 |
| 5  | -     | -                          | -           | -                 |

注：期货投资采用当日无负债结算制度，相关价值已包含在结算备付金中，具体投资情况详见下表（买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示）：

| 代码             | 名称                         | 持仓量（买/卖）<br>（单位：手） | 合约市值           | 公允价值变动         |
|----------------|----------------------------|--------------------|----------------|----------------|
| HIV1 HKG       | HANG SENG<br>IDX FUT Oct21 | 144                | 146,740,295.95 | 509,832.72     |
| 公允价值变动总额合计     |                            |                    |                | 509,832.72     |
| 股指期货投资本期收益     |                            |                    |                | -17,805,375.19 |
| 股指期货投资本期公允价值变动 |                            |                    |                | 738,571.31     |

## 5.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

| 序号 | 基金名称        | 基金类型 | 运作方式       | 管理人            | 公允价值<br>(元)      | 占基金资产<br>净值比例<br>(%) |
|----|-------------|------|------------|----------------|------------------|----------------------|
| 1  | 华夏恒生<br>ETF | 股票型  | 交易型开放<br>式 | 华夏基金管<br>理有限公司 | 2,838,675,618.63 | 90.35                |

## 5.10 投资组合报告附注

5.10.1 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。

5.10.2 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。

### 5.10.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|----|----|-------|
|----|----|-------|

|   |         |               |
|---|---------|---------------|
| 1 | 存出保证金   | 14,459,613.88 |
| 2 | 应收证券清算款 | -             |
| 3 | 应收股利    | -             |
| 4 | 应收利息    | 19,834.10     |
| 5 | 应收申购款   | 10,603,989.51 |
| 6 | 其他应收款   | -             |
| 7 | 待摊费用    | -             |
| 8 | 其他      | -             |
| 9 | 合计      | 25,083,437.49 |

#### 5.10.4 报告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。

#### 5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

#### 5.10.6 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。

## §6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目             | 华夏恒生ETF联接A       | 华夏恒生ETF联接C     |
|----------------|------------------|----------------|
| 本报告期期初基金份额总额   | 1,592,002,621.90 | 620,095,919.18 |
| 报告期期间基金总申购份额   | 332,406,783.37   | 217,837,511.35 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 122,506,229.87   | 265,680,237.09 |
| 报告期期间基金拆分变动份额  | -                | -              |
| 本报告期期末基金份额总额   | 1,801,903,175.40 | 572,253,193.44 |

## §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

#### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

## 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

## §8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 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。

### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

#### 1、报告期内披露的主要事项

本基金本报告期内无需要披露的主要事项。

#### 2、其他相关信息

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，首批公募 MOM 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，国内首家承诺“碳中和”具体目标和路径的公募基金公司，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，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 9 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）中华夏全球聚享（QDII）（A 类）排序第 2/35、华夏新时代混合（QDII）排序第 8/35；在其他行业股票型基金（A 类）中华夏能源革新股票（A 类）排序第 3/37；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 3/614、华夏盛世混合排序第 20/614；在偏股型基金（股票上限 80%）（A 类）中华夏经典混合排序第 6/130；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 8/24；在偏股型

基金（股票上限 95%）（A 类）中华夏兴和混合排序第 10/174、华夏兴华混合(A 类)排序第 16/174；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 33/494、华夏国企改革混合排序第 66/494、华夏新起点混合(A 类)排序第 78/494；在标准股票型基金（A 类）中华夏潜龙精选股票排序第 38/240、华夏优势精选股票排序第 43/240、华夏创新前沿股票排序第 76/240。

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 1/23；在规模指数股票 ETF 基金中华夏创业板 ETF 排序第 1/101；在主题指数股票 ETF 基金中华夏中证新能源汽车 ETF 排序第 3/90、华夏中证四川国改 ETF 排序第 8/90、华夏国证半导体芯片 ETF 排序第 16/90、华夏中证央企 ETF 排序第 24/90、华夏战略新兴成指 ETF 排序第 26/90；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 4/101；在行业指数股票 ETF 基金中华夏中证银行 ETF 排序第 8/43、华夏医药 ETF 排序第 9/43、华夏消费 ETF 排序第 11/43。

固收&“固收+”产品：在 QDII 债券型基金（A 类）中华夏大中华信用债券（QDII）(A 类)排序第 1/25、华夏收益债券（QDII）(A 类)排序第 2/25；在普通债券型基金（可投转债）（A 类）中华夏聚利债券排序第 3/206、华夏双债债券(A 类)排序第 7/206、华夏债券(A/B 类)排序第 23/206；在偏债型基金（A 类）中华夏永康添福混合排序第 4/191、华夏睿磐泰利混合(A 类)排序第 23/191、华夏睿磐泰兴混合排序第 24/191、华夏睿磐泰茂混合(A 类)排序第 29/191、华夏睿磐泰荣混合(A 类)排序第 35/191；在短期纯债债券型基金（A 类）中华夏短债债券(A 类)排序第 6/54；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 12/78；在绝对收益目标基金（A 类）中华夏永福混合(A 类)排序第 39/138；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 8/34；在中短期纯债债券型基金（A 类）中华夏中短债债券(A 类)排序第 14/76；在普通债券型基金（二级）（A 类）中华夏鼎泓债券(A 类)排序第 31/254、华夏鼎利债券(A 类)排序第 72/254；在长期纯债债券型基金(A 类)中华夏鼎航债券(A 类)排序第 27/586、华夏鼎通债券(A 类)排序第 33/586。

养老&FOF 产品：在养老目标日期 FOF（2040）（A 类）中华夏养老 2040 三年持有混合（FOF）排序第 1/10；在混合型 FOF（权益资产 0-30%）（A 类）中华夏聚丰混合（FOF）(A 类)排序第 1/10、华夏聚惠 FOF(A 类)排序第 2/10；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 5/27。

3 季度，在《中国证券报》第十八届中国基金业金牛奖评选中，华夏基金荣获“被动投资金牛基金公司”，成为业内唯一连续 6 年获此殊荣的基金公司。在《证券时报》第十六届中国基金业明星基金奖评选中，公司层面，华夏基金荣获“ETF 管理明星基金公司奖”；产品层面，华夏创新前沿股票荣获“三年持续回报股票型明星基金奖”，华夏永福混合荣获“三年持续回报绝对收益策略明星基金

奖”，华夏移动互联混合（QDII）“三年持续回报主动权益类 QDII 明星基金奖”。在已经举办的十六届基金业明星基金奖评选中，华夏基金累计斩获奖杯数已达 49 座。第三届济安群星汇颁奖盛典获奖名单已发布，华夏基金共获得了 10 个奖项，分别是“基金公司单项奖-指数型”、“基金公司单项奖-一级债”、华夏上证 50ETF 获得“基金产品单项奖-指数型”、华夏聚利债券获得“基金产品单项奖-一级债”、华夏能源革新股票、华夏上证 50ETF、华夏双债债券、华夏新时代混合（QDII）、华夏移动互联混合（QDII）获得“五星基金明星奖”。在《上海证券报》主办的第十八届“金基金”奖评选活动中，华夏基金荣获“金基金 被动投资基金管理公司奖”，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，3 季度，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）华夏基金直销上线招商银行卡大额支付业务，进一步满足客户支付需求；（2）华夏基金管家客户端增加累计收益率、持有收益率、定投标志等信息，并对登录方式进行便捷优化；（3）与泰信财富等销售机构开展代销合作，拓展更加丰富的客户理财渠道；（4）开展“准备好了吗？来跟我们一起碳中和！”、“定位在太空的朋友圈”、“铁柱姑娘想对你说的话”等活动，为客户提供多样化的投资者教育和关怀服务。

## 9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准基金募集的文件；
- 2、《恒生交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》；
- 3、《恒生交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》；
- 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。

### 9.2 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。

### 9.3 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

二〇二一年十月二十六日