

华夏上证科创板 50 成份交易型开放式指数

证券投资基金发起式联接基金

2021 年第 4 季度报告

2021 年 12 月 31 日

基金管理人：华夏基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二二年一月二十一日

§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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 1 月 19 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 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§2 基金产品概况

2.1 基金产品概况

基金简称	华夏上证科创板 50 成份 ETF 联接	
基金主代码	011612	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 3 月 4 日	
报告期末基金份额总额	4,826,133,289.56 份	
投资目标	通过对目标 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。本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%, 年跟踪误差不超过 4%。	
投资策略	主要投资策略包括目标 ETF 投资策略、股票投资策略、存托凭证投资策略、债券投资策略、衍生品投资策略、资产支持证券投资策略、可转换债券和可交换债券投资策略、参与转融通证券出借业务策略等。	
业绩比较基准	上证科创板 50 成份指数收益率×95%+人民币活期存款税后利率×5%	
风险收益特征	本基金为目标 ETF 的联接基金, 目标 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。本基金资产投资于科创板, 会面临科创板机制下因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险, 包括但不限于科创板上市公司股票价格波动较大的风险、流动性风险、退市风险等。	
基金管理人	华夏基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	华夏上证科创板 50 成份 ETF 联接 A	华夏上证科创板 50 成份 ETF 联接 C
下属分级基金的交易代码	011612	011613
报告期末下属分级基金的份额总额	1,907,141,861.62 份	2,918,991,427.94 份

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	华夏上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	588000
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2020 年 9 月 28 日
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2020 年 11 月 16 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	招商银行股份有限公司
---------	------------

2.1.2 目标基金产品说明

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。本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。
投资策略	主要投资策略包括组合复制策略，替代性策略，存托凭证投资策略、衍生品投资策略，债券投资策略，资产支持证券投资策略，融资、转融通证券出借业务投资策略等。
业绩比较基准	上证科创板 50 成份指数收益率。
风险收益特征	本基金为股票基金，其预期风险和预期收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金资产投资于科创板，会面临科创板机制下因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括但不限于科创板上市公司股票价格波动较大的风险、流动性风险、退市风险等。

§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 (2021 年 10 月 1 日-2021 年 12 月 31 日)	
	华夏上证科创板 50 成份 ETF 联接 A	华夏上证科创板 50 成份 ETF 联接 C
1.本期已实现收益	7,431,937.50	8,982,973.33
2.本期利润	43,523,123.12	77,157,393.66
3.加权平均基金份额本期利润	0.0234	0.0275
4.期末基金资产净值	2,089,839,307.91	3,192,045,971.35
5.期末基金份额净值	1.0958	1.0935

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

华夏上证科创板 50 成份 ETF 联接 A:

阶段	净值增长率 ①	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
过去三个月	2.08%	1.10%	2.07%	1.12%	0.01%	-0.02%

过去六个月	-11.02%	1.37%	-11.34%	1.39%	0.32%	-0.02%
自基金合同生效起至今	9.58%	1.31%	2.84%	1.47%	6.74%	-0.16%

华夏上证科创板 50 成份 ETF 联接 C:

阶段	净值增长率 ①	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
过去三个月	2.02%	1.10%	2.07%	1.12%	-0.05%	-0.02%
过去六个月	-11.13%	1.37%	-11.34%	1.39%	0.21%	-0.02%
自基金合同生效起至今	9.35%	1.31%	2.84%	1.47%	6.51%	-0.16%

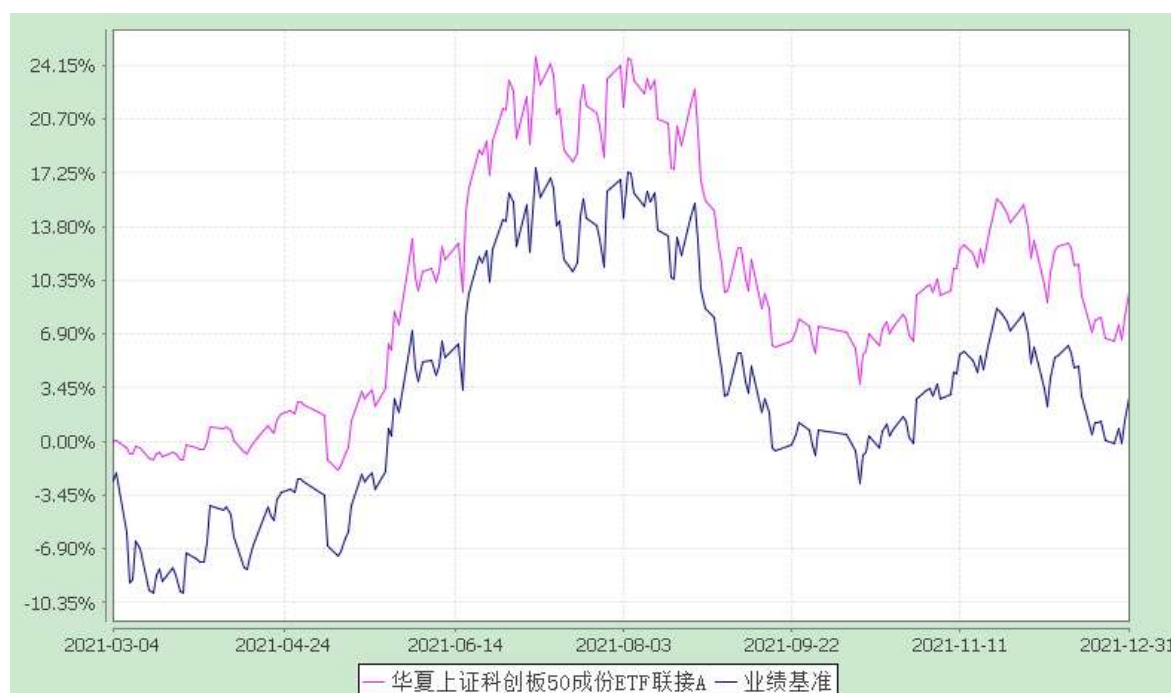
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华夏上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金

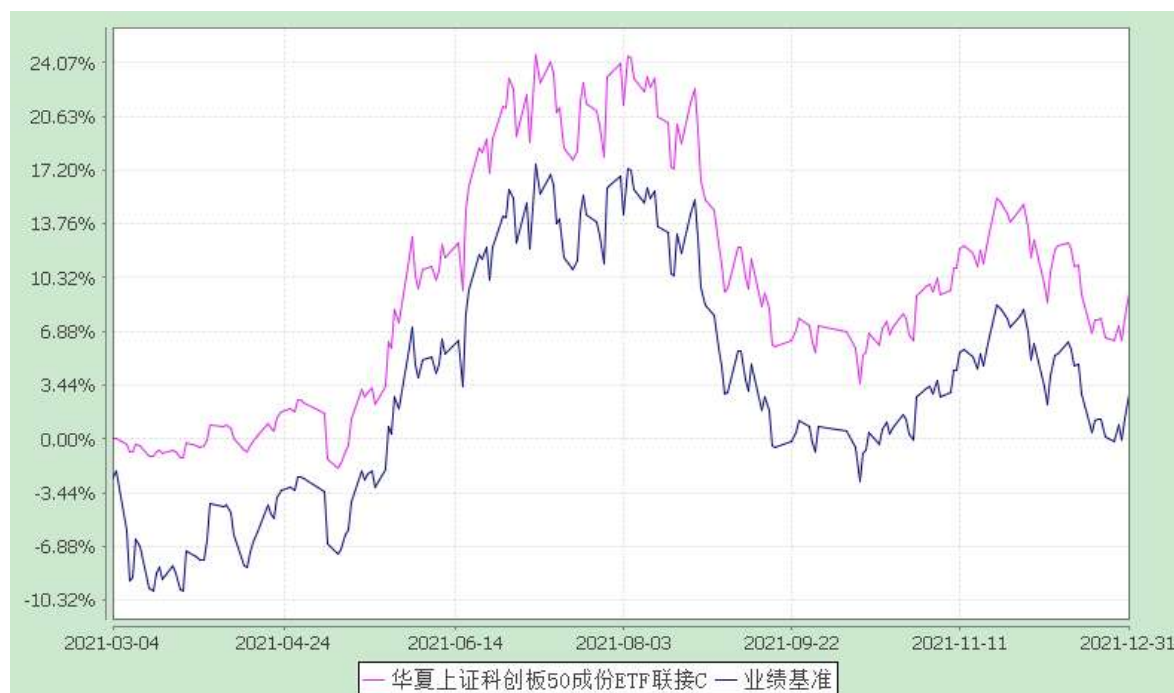
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2021 年 3 月 4 日至 2021 年 12 月 31 日)

华夏上证科创板 50 成份 ETF 联接 A:



华夏上证科创板 50 成份 ETF 联接 C:



注：①本基金合同于 2021 年 3 月 4 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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张弘弢	本基金的基金经理、投委会成员	2021-03-04	-	21 年	硕士。2000 年 4 月加入华夏基金管理有限公司。曾任研究发展部总经理、数量投资部副总经理、上证能源交易型开放式指数发起式证券投资基金基金经理（2013 年 3 月 28 日至 2016 年 3 月 28 日期间）、恒生交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2012 年 8 月 9 日至 2017 年 11 月 10 日期间）、恒生交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（2012 年 8 月 21 日至 2017 年 11 月 10 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(2014年12月23日至2017年11月10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1月13日至2017年11月10日期间)、MSCI中国A股交易型开放式指数证券投资基金基金经理(2015年2月12日至2017年11月10日期间)、MSCI中国A股交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理(2015年2月12日至2017年11月10日期间)、华夏睿磐泰利六个月定期开放混合型证券投资基金基金经理(2017年12月27日至2019年2月26日期间)、华夏睿磐泰盛六个月定期开放混合型证券投资基金基金经理(2017年3月15日至2021年1月5日期间)、华夏睿磐泰兴混合型证券投资基金基金经理(2017年7月14日至2021年5月26日期间)、华夏睿磐泰茂混合型证券投资基金基金经理(2017年12月6日至2021年5月26日期间)、华夏睿磐泰荣混合型证券投资基金基金经理(2017年12月27日至2021年5月26日期间)、华夏睿磐泰利混合型证券投资基金基金经理(2019年2月27日至2021年5月26日期间)、华夏睿磐泰盛混合型证券投资基金基金经理(2021年1月6日至2021年5月26日期间)、上证医药卫生交易型开放式指数发起式证券投资基金基金经理(2013年3月28日至2021年5月27日期间)等。
荣膺	本基金的基金经理、投委会成员	2021-03-04	-	11年	硕士。2010年7月加入华夏基金管理有限公司。曾任研究发展部高级产品经理,数量投资部研究员、投资经理、基金经理助理、MSCI中国A股交易型开放式指

					数证券投资基金基金经理（2016 年 10 月 20 日至 2018 年 9 月 16 日期间）、MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（2016 年 10 月 20 日至 2018 年 9 月 16 日期间）、上证主要消费交易型开放式指数发起式证券投资基金基金经理（2015 年 11 月 6 日至 2020 年 3 月 18 日期间）、华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金基金经理（2018 年 3 月 6 日至 2020 年 3 月 18 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。

4.1.1 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
张弘毅	公募基金	9	139,429,961,194.45	2009-07-10
	私募资产管理计划	2	43,657,877.66	2021-07-16
	其他组合	-	-	-
	合计	11	139,473,619,072.11	-

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 18 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上证科创板 50 成份指数，基金业绩比较基准为：上证科创板 50 成份指数收益率*95%+人民币活期存款利率(税后)*5%。上证科创板 50 成份指数由上海证券交易所科创板中市值大、流动性好的 50 只证券组成，反映最具市场代表性的一批科创企业的整体表现。本基金通过交易所买卖或申购赎回的方式投资于目标 ETF（华夏上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金），从而实现基金投资目标，基金也可以通过买入上证科创板 50 成份指数成份股来跟踪标的指数。

4 季度，疫情层面，新冠病毒不断变异，国内疫情零星散发，海外坚持全民免疫。经济层面，制造业 PMI 连续回落 7 个月后，在 11 月转升至 50 荣枯线上，显示经济有初步企稳迹象。个别房企资金紧张得到市场关注。3 季度困扰市场的通货膨胀问题得到大大改善，资源品价格明显回落，尤其是煤炭库存显著上升，电力短缺问题得到缓解。这打消了此前市场对上游资源挤压中游制造业利润的担忧，投资者开始更多关注利润向中游传导的投资机会。

政策层面，国内外呈现“内松外紧”的差异。国内，中央经济工作会议格外强调以稳为主，提振了市场对明年经济的信心。同时，市场也在观察政策托底经济的力度和方向。货币政策也更强调以我为主。房地产政策强调满足购房者合理需求，出现边际转松迹象。国外，美联储官员态度转鹰，明确 2022 年 taper 路线，预示加息次数不止一次。

市场层面，股市震荡走势，主线行业和市场风格均不明晰。新能源赛道长期成长空间大、中期增速快，但短期拥挤度高。市场增量资金有限的背景下，继续抬估值的动能下降。市场尝试在低拥挤度的行业寻找阶段性机会，比如部分资金回流至调整大半年的白酒行业，围绕新能源车挖掘汽车零部件、汽车电子行业的机会，围绕元宇宙挖掘消费电子、传媒行业的机会，围绕地产政策边际转松带来的地产产业链的机会等。

风险层面，关注美股在美联储回收流动性过程中的杀估值压力，以及因国内经济自身惯性动能导致政策托底效果不及预期的影响。

基金投资运作方面，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 12 月 31 日，华夏上证科创板 50 成份 ETF 联接 A 份额净值为 1.0958 元，本报告期份额净值增长率为 2.08%，同期业绩比较基准增长率 2.07%，华夏上证科创板 50 成份 ETF 联接 A 本报告期跟踪偏离度为+0.01%；华夏上证科创板 50 成份 ETF 联接 C 份额净值为 1.0935 元，本报告期份额净值增长率为 2.02%，同期业绩比较基准增长率 2.07%，华夏上证科创板 50 成份 ETF 联接 C 本报告期跟踪偏离度为-0.05%。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。

§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	66,467,598.37	1.25
	其中：股票	66,467,598.37	1.25
2	基金投资	4,908,516,564.50	92.52
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	310,554,167.90	5.85
8	其他各项资产	19,658,204.02	0.37
9	合计	5,305,196,534.79	100.00

5.2 期末投资目标基金明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	华夏上证科创板 50 成份 ETF	股票型	交易型开放式	华夏基金管理 有限公司	4,908,516,564.50	92.93

5.3 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.3.1 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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	50,271,716.64	0.95
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	4,713.80	0.00
F	批发和零售业	-	-
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	16,191,167.93	0.31
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	66,467,598.37	1.26

5.4 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投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	688981	中芯国际	115,377	6,113,827.23	0.12
2	688599	天合光能	53,702	4,237,087.80	0.08
3	688111	金山办公	12,346	3,271,690.00	0.06
4	688008	澜起科技	30,290	2,540,422.30	0.05
5	688036	传音控股	16,102	2,526,403.80	0.05
6	688099	晶晨股份	16,530	2,152,206.00	0.04
7	688012	中微公司	16,504	2,089,406.40	0.04
8	688005	容百科技	18,001	2,080,555.58	0.04
9	688116	天奈科技	12,439	1,857,018.31	0.04
10	688122	西部超导	17,825	1,727,955.50	0.03

5.5 报告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。

5.6 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序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。

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五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险说明
IC2201	中证 500 股指期货 IC2201 合约	27	39,840,120.00	434,640.00	买入股指期货合约的目的是进行更有效地流动性管理，实现投资目标。
公允价值变动总额合计(元)					434,640.00
股指期货投资本期收益(元)					-598,640.00
股指期货投资本期公允价值变动(元)					2,745,360.00

5.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金为指数型联接基金，主要投资于目标 ETF 基金份额、标的指数成份股和备选成份股。本基金根据基金合同规定投资股指期货旨在配合基金日常投资管理需要，更有效地进行流动性管理，以更好地跟踪标的指数，实现投资目标。

5.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.11.1 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。

5.11.2 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。

5.11.3 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。

5.12 投资组合报告附注

5.12.1 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。

5.12.2 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。

5.12.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	6,217,319.85
2	应收证券清算款	72,159.01
3	应收股利	-
4	应收利息	51,695.38
5	应收申购款	13,317,029.78
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	19,658,204.02

5.12.4 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。

5.12.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.12.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华夏上证科创板50成份 ETF联接A	华夏上证科创板50成份 ETF联接C
本报告期期初基金份额总额	1,779,875,537.55	2,740,382,888.61
报告期期间基金总申购份额	408,363,796.96	1,290,097,090.56
减：报告期期间基金总赎回份额	281,097,472.89	1,111,488,551.23
报告期期间基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	1,907,141,861.62	2,918,991,427.94

§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

单位：份

项目	华夏上证科创板50成份 ETF联接A	华夏上证科创板50成份ETF联 接C
报告期初管理人持有的本基 金份额	10,001,944.64	-
报告期期间买入/申购总份额	-	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-	-
报告期期末管理人持有的本基 金份额	10,001,944.64	-
报告期期末持有的本基金份额 占基金总份额比例（%）	0.52	-

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 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总 数	持有份额 占基金总 份额比例	发起份额总 数	发起份额占 基金总份 额比例	发起份额承 诺持有期限
基金管理人固有资金	10,001,944.64	0.21%	10,000,000.00	0.21%	不少于三年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,001,944.64	0.21%	10,000,000.00	0.21%	不少于三年

§9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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。

9.2 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

2021 年 10 月 15 日发布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。

2021 年 10 月 20 日发布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。

2021 年 10 月 22 日发布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。

2021 年 10 月 23 日发布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。

2021 年 11 月 10 日发布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。

2021 年 11 月 22 日发布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。

2021 年 12 月 4 日发布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。

2021 年 12 月 8 日发布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。

2021 年 12 月 10 日发布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。

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、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 12 月 31 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 1/35;在偏股型基金(股票上限 95%)(A 类)中华夏兴和混合排序第 1/176、华夏兴华混合(A 类)排序第 32/176;在定期开放式偏股型基金(A 类)中华夏磐利一年定开混合(A 类)排序第 1/63、华夏成长精选 6 个月定开混合(A 类)排序第 17/63;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 2/692、华夏盛世混合排序第 14/692;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 6/33;在偏股型基金(股票上限 80%)(A 类)中华夏经典混合排序第 10/132;在标准股票型基金(A 类)中华夏智胜价值成长股票(A 类)排序第 41/259;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 79/499。

指数与量化策略产品：在信用债指数债券型基金 (A 类) 中华夏亚债中国指数(A 类)排序第 2/18；在策略指数股票 ETF 联接基金 (A 类) 中华夏创成长 ETF 联接(A 类)排序第 3/14；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 4/103；在主题指数股票 ETF 基金中华夏中证新能源汽车 ETF 排序第 4/95、华夏中证四川国改 ETF 排序第 7/95、华夏国证半导体芯片 ETF 排序第 10/95；在策略指数股票 ETF 基金中华夏创成长 ETF 排序第 5/23；在主题指数股票 ETF 联接基金 (A 类) 中华夏中证四川国改 ETF 联接(A 类)排序第 5/55、华夏国证半导体芯片 ETF 联接(A 类)排序第 7/55；在定期开放式绝对收益目标基金 (A 类) 中华夏安泰对冲策略 3 个月定开混合排序第 5/24；在行业指数股票 ETF 联接基金 (A 类) 中华夏中证全指房地产 ETF 联接(A 类)排序第 7/27、华夏中证银行 ETF 联接(A 类)排序第 8/27；在利率债指数债券型基金 (A 类) 中华夏中债 3-5 年政金债指数(A 类)排序第 8/103；在行业指数股票 ETF 基金中华夏中证全指房地产 ETF 排序第 10/42、；在规模指数股票 ETF 联接基金 (A 类) 中华夏中证 500ETF 联接(A 类)排序第 13/75；在规模指数股票 ETF 基金中华夏中证 500ETF 排序第 16/113、华夏创业板 ETF 排序第 22/113。

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 4/25；在偏债型基金 (A 类) 中华夏永康添福混合排序第 4/231、华夏磐泰混合(LOF)(A 类)排序第 20/231、华夏睿磐泰茂混合(A 类)排序第 26/231、华夏睿磐泰利混合(A 类)排序第 29/231、华夏睿磐泰兴混合排序第 34/231；在长期纯债债券型基金 (A 类) 中华夏鼎航债券(A 类)排序第 29/615、华夏鼎茂债券(A 类)排序第 85/615；在短期纯债债券型基金 (A 类) 中华夏短债债券(A 类)排序第 8/54；在普通债券型基金(可投转债)(A 类)中华夏聚利债券排序第 14/203、华夏双债债券(A 类)排序第 32/203；在普通债券型基金(二级)(A 类) 中华夏鼎泓债券(A 类)排序第 31/258；在定期开放式纯债债券型基金 (A 类) 中华夏鼎瑞三个月定期开放债券(A 类)排序第 80/427。

养老&FOF 产品：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 1/16、华夏聚惠 FOF(A 类)排序第 3/16；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 2/11。

在客户服务方面，4 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) 华夏基金直销上线交通银行卡快捷支付业务，交易额度进一步提升，满足客户支付需求；(2) 华夏基金管家客户端上线非活期通基金的预约赎回功能，增加客户操作便利性；(3) 与排排网基金销售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“披荆斩棘

的投资人”、“华夏亲子财商营”、“定投的良辰吉日”等活动，为客户提供多样化的投资者教育和关怀服务。

§10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予基金注册的文件；
- 2、《华夏上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》；
- 3、《华夏上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金托管协议》；
- 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。

10.2 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。

10.3 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

二〇二二年一月二十一日