

**华夏中证沪港深 500 交易型开放式指数  
证券投资基金  
2022 年中期报告  
2022 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：二〇二二年八月三十日

## §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 2022 年 8 月 26 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 2022 年 1 月 1 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.....	4
§4 管理人报告.....	5
§5 托管人报告.....	11
§6 中期报告财务会计报告（未经审计）.....	11
6.1 资产负债表.....	11
6.2 利润表.....	13
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	14
6.4 报表附注.....	16
§7 投资组合报告.....	34
7.1 期末基金资产组合情况.....	34
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	35
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.....	36
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	47
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.....	49
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.....	49
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.....	49
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.....	49
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	49
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	49
7.12 投资组合报告附注.....	49
§8 基金份额持有人信息.....	50
§9 开放式基金份额变动.....	51
§10 重大事件揭示.....	51
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	54
§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	华夏中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	华夏中证沪港深 500ETF
场内简称	沪港深 E (扩位简称: 沪港深 ETF)
基金主代码	517170
交易代码	517170
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2021 年 4 月 7 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	41,131,846.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2021 年 4 月 20 日

### 2.2 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	主要投资策略包括完全复制策略，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	中证沪港深 500 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。 基金资产投资于港股，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括港股市场股价波动较大的风险、汇率风险、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险等。

### 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
	联系电话	400-818-6666
	电子邮箱	service@ChinaAMC.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	《中国证券报》
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	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

# §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（2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	-3,658,554.62
本期利润	-1,676,675.91
加权平均基金份额本期利润	-0.0420
本期加权平均净值利润率	-5.04%
本期基金份额净值增长率	-7.76%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022年6月30日)
期末可供分配利润	-5,996,737.21
期末可供分配基金份额利润	-0.1458
期末基金资产净值	35,135,108.79
期末基金份额净值	0.8542
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-14.58%

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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。

## 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

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差	①—③	②—④
----	----------	------------	------------	--------------	-----	-----

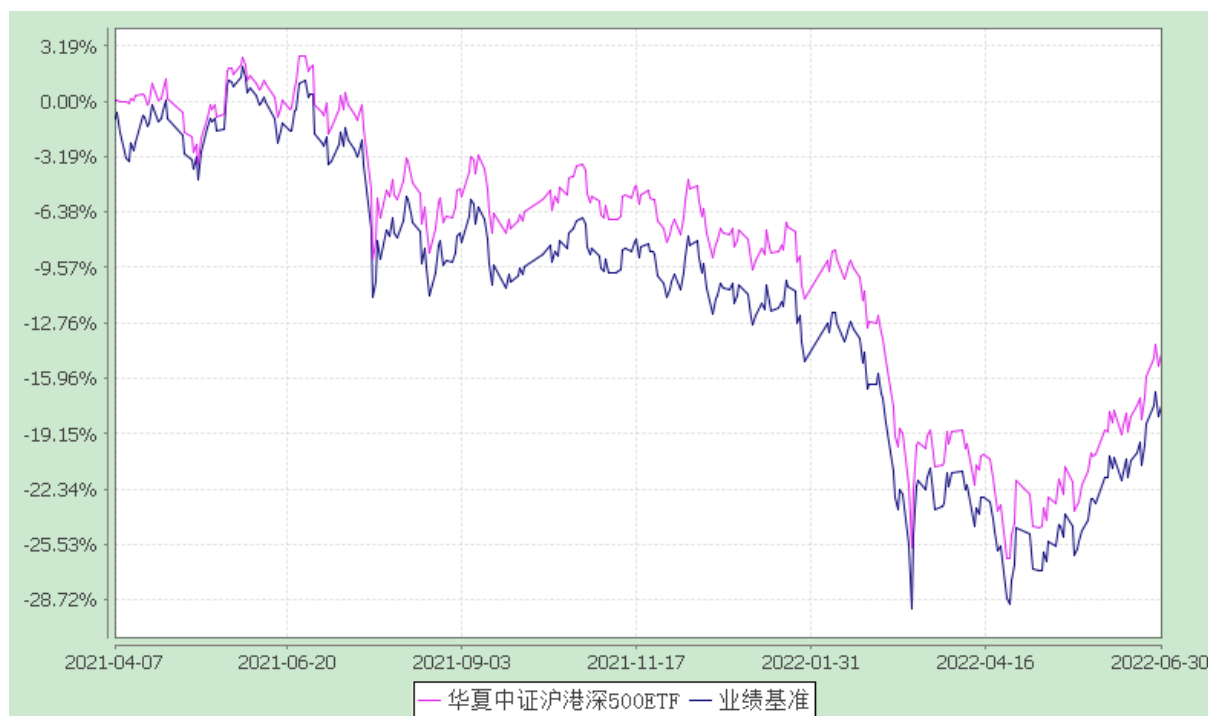
		②		准差④		
过去一个月	7.16%	1.09%	6.87%	1.13%	0.29%	-0.04%
过去三个月	6.48%	1.37%	5.93%	1.36%	0.55%	0.01%
过去六个月	-7.76%	1.45%	-7.78%	1.55%	0.02%	-0.10%
过去一年	-16.21%	1.25%	-17.88%	1.31%	1.67%	-0.06%
自基金合同生效起至今	-14.58%	1.17%	-17.56%	1.24%	2.98%	-0.07%

### 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

华夏中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金

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 4 月 7 日至 2022 年 6 月 30 日)



注：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,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 2022 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:在偏股型基金(股票上限 95%)(A 类)中华夏兴和混合排序第 1/188、华夏兴华混合(A 类)排序第 16/188;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 2/14;在定开偏股型基金(A 类)中华夏磐利一年定开混合(A 类)排序第 2/77、华夏磐锐一年定开混合(A 类)排序第 10/77、华夏磐益一年定开混合排序第 11/77、华夏成长精选 6 个月定开混合(A 类)排序第 24/77;在医药医疗健康行业偏股型基金(股票上下限 60%-95%)(A 类)中华夏逸享健康混合(A 类)排序第 9/52;在消费行业偏股型基金(股票上下限 60%-95%)(A 类)中华夏网购精选混合(A 类)排序第 10/53;在偏股型基金(股票上限 80%)(A 类)中华夏经典混合排序第 22/134;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 29/905、华夏产业升级混合(A 类)排序第 55/905、华夏盛世混合排序第 67/905;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 59/286;在灵活配置型基金(基准股票比例 60%-100%)(A 类)中华夏圆和混合(A 类)排序第 74/436。

固收与固收+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;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 3/13;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 7/98;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 21/84;在长期纯债债券型基金(A 类)中华夏鼎航债券(A 类)排序第 28/642;在偏债型

基金(A类)中华夏磐泰混合(LOF)(A类)排序第 32/350、华夏睿磐泰盛混合排序第 36/350、华夏永康添福混合(A类)排序第 46/350、华夏睿磐泰利混合(A类)排序第 63/350。

指数与量化产品：在 QDII 跨境股票 ETF 基金中华夏纳斯达克 100ETF (QDII) 排序第 4/19；在规模指数股票 ETF 基金中华夏中证 1000ETF 排序第 3/116、华夏中证 500ETF 排序第 18/116；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 3/60、华夏中证央企 ETF 联接(A类)排序第 15/60；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 4/24、华夏中证银行 ETF 联接(A类)排序第 6/24；在行业指数股票 ETF 基金中华夏中证全指房地产 ETF 排序第 7/41、华夏中证银行 ETF 排序第 10/41；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 15/80；在主题指数股票 ETF 基金中华夏中证新能源 ETF 排序第 14/169、华夏中证四川国改 ETF 排序第 17/169、华夏中证新能源汽车 ETF 排序第 24/169。

在证券时报主办的第十七届中国基金业明星基金奖评选活动上，在最具含金量、最能体现基金公司综合实力的“年度十大明星基金公司奖”评选中，华夏基金凭借在多项业务中的优异中长期表现，成功获奖。此外，凭借 QDII 基金的良好业绩表现，以及在境内外市场的持续布局，华夏基金还获得“三年海外投资明星基金公司奖”。

在客户服务方面，2022 年上半年，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）华夏基金直销上线北京银行、广发银行快捷等支付方式，拓展支付渠道的同时交易额度也得到进一步提升，满足客户支付需求；（2）华夏基金管家客户端优化资料上传、定投收益展示等功能，增加客户操作便利性；（3）与兰州银行、九江银行、晋商银行、九州证券等代销机构合作，拓展更加丰富的客户理财渠道；（4）开展“压岁钱手账”、“基金视力表”、“与干饭人灵魂相认”、“童言童语话理财”、“FOF 产品不是小透明”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		
徐猛	本基金的基金经理、投委会成员	2021-04-07	-	19 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。历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



				<p>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)、上证金融地产交易型开放式指数发起式证券投资基金基金经理(2013年4月8日至2021年7月19日期间)、华夏创业板交易型开放式指数证券投资基金基金经理(2017年12月8日至2021年7月19日期间)、战略新兴成指交易型开放式指数证券投资基金基金经理(2018年7月13日至2021年7月19日期间)、华夏创业板交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理(2018年8月14日至2021年7月19日期间)、战略新兴成指交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理(2019年6月5日至2021年7月19日期间)、华夏中小企业100交易型开放式指数基金发起式联接基金基金经理(2018年9月10日至2021年9月10日期间)等。</p>
--	--	--	--	-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

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 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 54 次，其中 3 次为投资策略需要所致，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；其余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 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

本基金跟踪的标的指数中证沪港深 500 指数（指数代码：H30455，指数简称：沪港深 500）发布于 2014 年 11 月 28 日，该指数选取沪港深交易所上市的互联互通范围内上市公司证券作为指数样本，以全面反映沪港深三地上市企业证券的整体表现。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。

上半年，外部形势较为复杂，全球通胀和衰退风险给中国外需带来了一定的压力。美国与欧洲均面临高通胀的困扰，全球 PMI 进入下降周期，多个指标表明全球经济面临衰退风险。国内方面，上半年疫情对经济带来了一定程度的冲击，但近期负面影响正在逐步消退。在克服了国际环境复杂多变、国内疫情反复冲击等诸多不利因素后，5 月主要经济指标降幅收窄，6 月多项经济数据企稳回升，二季度经济实现正增长。6 月我国消费增速由负转正，同比增长 3.1%；服务业生产指数同比增长 1.3%；总体来看，上半年国内生产总值同比增长 2.5%，其中二季度国内生产总值同比增长 0.4%。

市场方面，受通胀及地缘政治的影响，海外市场上半年大多呈现单边下跌的走势；而在国内稳健的货币政策以及稳中向好的宏观经济形势的支撑下，今年前六个月，A 股市场的走势呈现 V 型反转。一季度，受疫情冲击与俄乌冲突影响，A 股呈现出震荡下行的总体走势；而进入二季度以来，虽然国际大环境的不确定性程度依然较高，但 A 股市场却体现出了十足的韧性，走势相对独立，收获了较高的涨幅。

基金投资运作方面，作为被动指数基金，本基金主要采取复制指数的投资策略，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、赎回和成份股调整等工作。

为促进本基金的市场流动性和平稳运行，经上海证券交易所同意，部分证券公司被确认为本基金的流动性服务商。目前，本基金的流动性服务商包括中泰证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司等。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2022 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 0.8542 元，本报告期份额净值增长率为-7.76%，同期经估值汇率调整的业绩比较基准增长率为-7.78%。本基金本报告期跟踪偏离度为+0.02%，与业绩比较基准产生偏离的主要原因为成份股分红、日常运作费用、指数结构调整、申购赎回等产生的差异。

#### 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，国际方面，全球通胀水平持续攀升，主要经济体偿债压力不断加大，稳定外需难度也在明显增加，外部环境更趋复杂严峻。随着美联储等海外主要央行货币紧缩进程的加快，当前国际金融市场的关注焦点正从通胀转向衰退。国内方面，下半年外部不稳定、不确定的因素仍较多，但随着一系列稳增长政策措施的落地见效，以及高效统筹疫情防控和经济社会发展成效的持续显现，下半年我国经济有望继续回升并运行在合理区间。

市场方面，下半年股市结构性机会仍存，业绩增速较快、具有较高景气度与盈利确定性的板块值得重点关注；此外，国内外压力之下，市场仍存在一定的不确定性，从降低风险的角度来看，低估值、高股息板块具有一定的配置价值。

本基金将会根据基金合同要求，在紧密跟踪标的指数的基础上，做好相关投资工作。

珍惜基金份额持有人的每一份投资和每一份信任，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

本基金自 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 3 月 14 日、2022 年 3 月 16 日至 2022 年 6 月 13 日出现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”）在华夏中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金（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：华夏中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	1,455,460.55	1,561,320.14
结算备付金		0.09	1,565,913.23
存出保证金		12,593.51	17,632.25

交易性金融资产	6.4.7.2	33,652,119.57	46,175,983.86
其中：股票投资		33,652,119.57	46,175,983.86
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		-	80,149.63
应收股利		88,800.10	3,295.20
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	319.02
资产总计		35,208,973.82	49,404,613.33
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2021 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
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		-	-
应付清算款		2.85	4.20
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		13,414.39	21,983.22
应付托管费		2,682.89	4,396.66
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	3.03
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	57,764.90	2,023,901.96
负债合计		73,865.03	2,050,289.07
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	41,131,846.00	51,131,846.00
未分配利润	6.4.7.8	-5,996,737.21	-3,777,521.74
净资产合计		35,135,108.79	47,354,324.26
负债和净资产总计		35,208,973.82	49,404,613.33

注：①报告截止日 2022 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.8542 元，基金份额总额 41,131,846.00 份。

②本基金合同于 2021 年 4 月 7 日生效，上年度可比期间自 2021 年 4 月 7 日至 2021 年 6 月 30 日。

③以下比较数据已根据本年《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>》中的资产负债表格式的要求进行列示：2021 年年度报告资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目的“本期末”余额合并列示在 2022 年中期报告资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额，2021 年年度报告资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在 2022 年中期报告资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额。

## 6.2 利润表

会计主体：华夏中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 4 月 7 日（基金 合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		-1,529,075.81	2,259,810.28
1.利息收入		5,696.68	135,970.47
其中：存款利息收入	6.4.7.9	5,696.68	135,970.45
债券利息收入		-	0.02
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-3,718,155.82	1,392,082.97
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-4,045,067.83	823,552.62
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	301.50	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	733.71	-
股利收益	6.4.7.14	325,876.80	568,530.35
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	1,981,878.71	543,039.08
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	201,504.62	188,717.76
<b>减：二、营业总支出</b>		147,600.10	777,593.00
1.管理人报酬		82,576.84	130,512.19
2.托管费		16,515.40	26,102.43
3.销售服务费		-	-
4.投资顾问费		-	-

5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.信用减值损失	6.4.7.17	-	-
7.税金及附加		2.67	-
8.其他费用	6.4.7.18	48,505.19	620,978.38
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-1,676,675.91	1,482,217.28
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-1,676,675.91	1,482,217.28
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-1,676,675.91	1,482,217.28

注：①本基金合同于 2021 年 4 月 7 日生效，上年度可比期间自 2021 年 4 月 7 日至 2021 年 6 月 30 日。

②以下比较数据已根据本年《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>》中的利润表格式的要求进行列示：2021 年中期报告利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在 2022 年中期报告利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：华夏中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合 收益（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	51,131,846.00	-	-3,777,521.74	47,354,324.26
二、本期期初净资产（基金净值）	51,131,846.00	-	-3,777,521.74	47,354,324.26
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-10,000,000.00	-	-2,219,215.47	-12,219,215.47
（一）、综合收益总额	-	-	-1,676,675.91	-1,676,675.91
（二）、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）	-10,000,000.00	-	-542,539.56	-10,542,539.56

其中：1.基金申购款	65,000,000.00	-	-14,607,818.96	50,392,181.04
2.基金赎回款	-75,000,000.00	-	14,065,279.40	-60,934,720.60
(三)、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)	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	41,131,846.00	-	-5,996,737.21	35,135,108.79
项目	上年度可比期间 2021年4月7日(基金合同生效日)至2021年6月30日			
	实收基金	其他综合收益(若有)	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	301,131,846.00	-	-	301,131,846.00
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-260,000,000.00	-	797,587.61	-259,202,412.39
(一)、综合收益总额	-	-	1,482,217.28	1,482,217.28
(二)、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)	-260,000,000.00	-	-684,629.67	-260,684,629.67
其中：1.基金申购款	-	-	-	-
2.基金赎回款	-260,000,000.00	-	-684,629.67	-260,684,629.67
(三)、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)	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	41,131,846.00	-	797,587.61	41,929,433.61

注：本基金合同于 2021 年 4 月 7 日生效，上年度可比期间自 2021 年 4 月 7 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

华夏中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金（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]3529 号《关于准予华夏中证沪港深 500 交易型开放式指数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》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《华夏中证沪港深 500 交易型开放式指数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。本基金为交易型开放式，存续期限为不定期。本基金于 2021 年 3 月 29 日至 2021 年 3 月 31 日募集 301,129,596.00 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\_A48 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华夏中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2021 年 4 月 7 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 301,131,846.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 2,250.00 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：本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，基金还可投资于非成份股（含中小板、创业板、依法发行上市的港股通投资标的股票及中国证监会注册或核准上市的股票）、债券（包括国债、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、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、股票期权、国债期货）、资产支持证券、货币市场工具（含同业存单、债券回购等）、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。本基金可根据法律法规的规定参与融资、转融通证券出借业务。

本基金投资范围中的股票包含存托凭证。

##### 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净资产变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

除下述变更后的会计政策外，本基金报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

#### 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

根据《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》、《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（统称“新金融工具准则”）、《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》的规定和相关法律法规的要求，本基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。根据衔接规定，对可比期间信息不予调整，首日执行新金融工具准则的累积影响数调整本报告期期初未分配利润。

新金融工具准则改变了金融资产的分类和计量方式，将金融工具分类为以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。本基金考虑自身业务模式，以及金融资产的合同现金流特征进行上述分类。于 2021 年 12 月 31 日及 2022 年 1 月 1 日，本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

新金融工具准则要求对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于 2021 年 12 月 31 日，银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、交易性金融资产、卖出回购金融资产款等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”或“应付利息”科目中。于 2022 年 1 月 1 日，根据新金融工具准则下的计量类别，将上述应计利息分别转入银行存款、结算备付金、存出保证金、交易性金融资产、买入返售金融资产、卖出回购金融资产款等科目项下列示，同时以摊余成本法计量的金融资产按照预期信用损失为基准，计提损失准备 0.00 元，对本基金期初未分配利润无影响。

于 2022 年 1 月 1 日，本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则

的规定进行分类和计量的结果如下：

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、应收利息、应收证券清算款和应收股利，金额分别为 1,561,320.14 元、1,565,913.23 元、17,632.25 元、319.02 元、80,149.63 元和 3,295.20 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、其他资产-应收利息、应收清算款和应收股利，金额分别为 1,561,494.70 元、1,566,054.17 元、17,635.77 元、0.00 元、80,149.63 元和 3,295.20 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 46,175,983.86 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 46,175,983.86 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付证券清算款、应付管理人报酬、应付托管费、应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 4.20 元、21,983.22 元、4,396.66 元、4,437.33 元和 2,019,464.63 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付清算款、应付管理人报酬、应付托管费、其他负债-应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 4.20 元、21,983.22 元、4,396.66 元、4,437.33 元和 2,019,464.63 元。

#### 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 7%、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 2022 年 6 月 30 日
活期存款	1,455,460.55
等于：本金	1,455,302.40
加：应计利息	158.15
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
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	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
合计	1,455,460.55

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	35,278,527.08	-	33,652,119.57	-1,626,407.51
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	35,278,527.08	-	33,652,119.57	-1,626,407.51

注：股票投资的估值增值和股票投资的公允价值均包含可退替代款的估值增值。

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

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 其他资产

无。

#### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	13,133.92
其中：交易所市场	13,133.92
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	44,630.98
合计	57,764.90

#### 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	51,131,846.00	51,131,846.00
本期申购	65,000,000.00	65,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-75,000,000.00	-75,000,000.00
本期末	41,131,846.00	41,131,846.00

#### 6.4.7.8 未分配利润

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
本期期初	473,632.37	-4,251,154.11	-3,777,521.74
本期利润	-3,658,554.62	1,981,878.71	-1,676,675.91
本期基金份额交易产生的变动数	376,465.03	-919,004.59	-542,539.56
其中：基金申购款	-2,158,018.66	-12,449,800.30	-14,607,818.96
基金赎回款	2,534,483.69	11,530,795.71	14,065,279.40
本期已分配利润	-	-	-

本期末	-2,808,457.22	-3,188,279.99	-5,996,737.21
-----	---------------	---------------	---------------

## 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	4,453.36
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	1,108.03
其他	135.29
合计	5,696.68

## 6.4.7.10 股票投资收益

## 6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-3,342,831.82
股票投资收益——赎回差价收入	-702,236.01
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-4,045,067.83

## 6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	26,397,170.89
减：卖出股票成本总额	29,678,008.29
减：交易费用	61,994.42
买卖股票差价收入	-3,342,831.82

## 6.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	60,934,720.60
减：现金支付赎回款总额	39,873,881.60
减：赎回股票成本总额	21,763,075.01
减：交易费用	-
赎回差价收入	-702,236.01

6.4.7.10.4 股票投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.10.5 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2022年1月1日至2022年6月30日
债券投资收益——利息收入	0.16
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	301.34
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	301.50

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年1月1日至2022年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,301.50
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,000.00
减：应计利息总额	0.16
买卖债券差价收入	301.34

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.13 衍生工具收益

6.4.7.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年1月1日至2022年6月30日
卖出权证成交总额	762.50
减：卖出权证成本总额	-



减：交易费用	6.58
减：买卖权证差价收入应缴纳增值税额	22.21
买卖权证差价收入	733.71

注：本项包含权证行权产生的差价收入。

#### 6.4.7.13.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

#### 6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资产生的股利收益	325,876.80
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	325,876.80

#### 6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
1.交易性金融资产	1,981,878.71
——股票投资	1,981,878.71
——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	1,981,878.71

#### 6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
基金赎回费收入	-
基金申购费收入	-
替代损益	201,504.62
合计	201,504.62

6.4.7.17 信用减值损失

无。

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
审计费用	19,835.79
信息披露费	24,795.19
证券出借违约金	-
银行费用	2,963.39
证券组合费	510.82
其他	400.00
合计	48,505.19

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

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 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年4月7日（基金合同生效日）至 2021年6月30日	
	成交金额	占当期股	成交金额	占当期股票

		票成交总 额的比例		成交总额的 比例
中信证券	-	-	372,975,754.48	78.08%

#### 6.4.10.1.2 权证交易

无。

#### 6.4.10.1.3 债券交易

无。

#### 6.4.10.1.4 债券回购交易

无。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022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	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2021年4月7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	172,209.61	78.03%	172,209.61	78.03%

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 2022年1月1日至2022年6月 30日	上年度可比期间 2021年4月7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	82,576.84	130,512.19

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 0.50%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×0.50%/当年天数。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月 30日	上年度可比期间 2021年4月7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	16,515.40	26,102.43

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 0.10%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×0.10%/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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2022 年 6 月 30 日		上年度末 2021 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
中信证券	4,693,346.00	11.41%	12,458,846.00	24.37%

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的相关费用符合基金招募说明书、交易所、登记结算机构的有关规定。

#### 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	上年度可比期间
-------	----	---------

	2022年1月1日至2022年6月30日		2021年4月7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	期末余额	当期利息收入
中国银行活期存款	1,455,460.55	4,453.36	1,769,650.44	35,960.51

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 2022年1月1日至2022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	600938	中国海油	新股发行	3,000	32,400.00
中信证券	603191	望变电气	新股发行	689	8,171.54
中信证券	603209	兴通股份	新股发行	361	7,768.72
中信证券	603215	比依股份	新股发行	347	4,337.50
中信证券	603051	鹿山新材	新股发行	163	4,203.77
中信证券	603132	金徽股份	新股发行	340	3,672.00
上年度可比期间 2021年4月7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	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	688690	纳微科技	网上申购	500	4,035.00
中信证券	688425	铁建重工	网上申购	500	1,435.00

注：本期“网上申购”和“网下申购”两种发行方式合并披露为“新股发行”。

#### 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

于 2022 年 6 月 30 日，本基金（因指数成份股包括中信证券而被动）持有的中信证券股票估值总额为人民币 230,923.88 元，占基金资产净值的比例为 0.66%（2021 年 12 月 31 日，本基金（因指数成份股包括中信证券而被动）持有的中信证券股票估值总额为人民币 321,541.40 元，占基金资产净值的比例为 0.68%）。

于 2022 年 6 月 30 日，本基金（因指数成份股包括中国银行而被动）持有的中国银行股票估值总额为人民币 267,002.60 元，占基金资产净值的比例为 0.76%（2021 年 12 月 31 日，本基金（因指数成份股包括中国银行而被动）持有的中国银行股票估值总额为人民币 311,953.06 元，占基金资产

净值的比例为 0.66%)。

#### 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（2022 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

无。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
01918	融创中国	2022-04-01	重大事项	3.92	-	-	3,000	62,036.99	11,750.31	-
06666	恒大物业	2022-03-21	重大事项	1.97	-	-	4,000	21,806.38	7,867.75	-
00813	世茂集团	2022-04-01	重大事项	3.78	-	-	1,500	24,377.60	5,669.91	-
03333	中国恒大	2022-03-21	重大事项	1.41	-	-	2,000	17,634.66	2,822.13	-
03380	龙光集团	2022-05-12	重大事项	1.86	2022-08-24	0.82	1,000	8,600.48	1,864.31	-

##### 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內。

#### 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。

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，本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股，如需对组合进行调整时，由于投资标的流动性较好，市场冲击成本较小，基金投资组合收益偏离投资目标收益的风险较小。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，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。

本基金为指数型基金，采用完全复制策略。本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。因此，利率风险不是本基金的主要风险。

#### 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 2022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	-	12,890,434.30	-	12,890,434.30
衍生金融资产	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-
应收股利	2,290.22	30,350.00	-	32,640.22
应收申购款	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产合计	2,290.22	12,920,784.30	-	12,923,074.52
项目	上年度末 2021年12月31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	-	17,711,997.92	-	17,711,997.92



资产				
衍生金融资产	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-
应收股利	-	3,295.20	-	3,295.20
应收申购款	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产合计	-	17,715,293.12	-	17,715,293.12
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 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
	港币相对人民币升值 5%	648,961.72	885,764.66
	港币相对人民币贬值 5%	-648,961.72	-885,764.66

## 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。

本基金为指数型基金，采用完全复制策略。本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。本基金管理人通常用敏感性指标来衡量市场价格风险。

## 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 2022 年 6 月 30 日		上年度末 2021 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净 值比例 (%)

交易性金融资产—股票投资	33,652,119.57	95.78	46,175,983.86	97.51
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	33,652,119.57	95.78	46,175,983.86	97.51

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	除中证沪港深 500 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 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
	-5%	-1,801,567.93	-2,281,446.14
	+5%	1,801,567.93	2,281,446.14

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 6 月 30 日
第一层次	33,622,145.16
第二层次	29,974.41
第三层次	-
合计	33,652,119.57

###### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券等投资，若出现交易不活跃（包括重大事项停牌、境内证券涨跌停等导致的交易不活跃）和非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值

所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。本基金政策以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

截至 2022 年 6 月 30 日止，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，其账面价值与公允价值差异很小。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## §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	33,652,119.57	95.58
	其中：股票	33,652,119.57	95.58
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	1,455,460.64	4.13
8	其他各项资产	101,393.61	0.29
9	合计	35,208,973.82	100.00

注：①股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值。

②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 12,890,434.30 元，占基金资产净值比例为 36.69%。

## 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	233,816.40	0.67
B	采矿业	524,640.00	1.49
C	制造业	12,598,909.15	35.86
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	485,485.00	1.38
E	建筑业	360,773.00	1.03
F	批发和零售业	88,376.00	0.25
G	交通运输、仓储和邮政业	519,887.00	1.48
H	住宿和餐饮业	31,450.00	0.09
I	信息传输、软件和信息技术服务业	635,603.56	1.81
J	金融业	4,073,548.85	11.59
K	房地产业	361,939.00	1.03
L	租赁和商务服务业	272,226.00	0.77
M	科学研究和技术服务业	348,889.80	0.99
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	9,843.00	0.03
Q	卫生和社会工作	169,921.51	0.48
R	文化、体育和娱乐业	46,377.00	0.13
S	综合	-	-
	合计	20,761,685.27	59.09

## 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（%）
金融	4,177,577.49	11.89
通讯服务	2,345,615.13	6.68
非必需消费品	2,178,218.10	6.20
房地产	979,487.77	2.79
保健	624,620.52	1.78
必需消费品	574,585.07	1.64
信息技术	569,719.04	1.62
工业	497,901.03	1.42
公用事业	452,835.94	1.29
能源	335,901.53	0.96
材料	153,972.68	0.44
合计	12,890,434.30	36.69

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

## 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	00700	腾讯控股	6,100	1,848,783.95	5.26
2	600519	贵州茅台	600	1,227,000.00	3.49
3	00005	汇丰控股	18,800	830,406.59	2.36
4	01299	友邦保险	11,000	800,073.00	2.28
5	601318	中国平安	10,000	466,900.00	1.33
5	02318	中国平安	7,000	319,370.71	0.91
6	03690	美团-W	4,500	747,350.54	2.13
7	300750	宁德时代	1,300	694,200.00	1.98
8	600036	招商银行	11,300	476,860.00	1.36
8	03968	招商银行	4,000	179,589.90	0.51
9	01211	比亚迪股份	1,000	268,529.66	0.76
9	002594	比亚迪	800	266,792.00	0.76
10	00939	建设银行	110,000	495,753.64	1.41
10	601939	建设银行	6,200	37,572.00	0.11
11	01398	工商银行	79,000	314,829.65	0.90
11	601398	工商银行	32,200	153,594.00	0.44
12	00388	香港交易所	1,200	396,124.01	1.13
13	601012	隆基绿能	5,528	368,330.64	1.05
14	000858	五粮液	1,800	363,474.00	1.03
15	000333	美的集团	4,500	271,755.00	0.77
16	03988	中国银行	76,000	203,432.60	0.58
16	601988	中国银行	19,500	63,570.00	0.18
17	601166	兴业银行	13,300	264,670.00	0.75
18	00941	中国移动	5,500	230,473.71	0.66
18	600941	中国移动	500	30,250.00	0.09
19	02269	药明生物	4,000	245,610.57	0.70
20	300059	东方财富	9,664	245,465.60	0.70
21	600900	长江电力	10,400	240,448.00	0.68
22	603259	药明康德	1,920	199,660.80	0.57
22	02359	药明康德	400	35,746.94	0.10
23	600030	中信证券	8,930	193,423.80	0.55
23	06030	中信证券	2,500	37,500.08	0.11
24	601888	中国中免	900	209,637.00	0.60
25	601328	交通银行	25,200	125,496.00	0.36
25	03328	交通银行	16,000	74,162.08	0.21
26	01810	小米集团-W	16,000	186,636.67	0.53
27	600887	伊利股份	4,700	183,065.00	0.52
28	601899	紫金矿业	13,300	124,089.00	0.35

28	02899	紫金矿业	6,000	49,310.26	0.14
29	000568	泸州老窖	700	172,578.00	0.49
30	01024	快手-W	2,300	171,910.29	0.49
31	600809	山西汾酒	520	168,896.00	0.48
32	00981	中芯国际	5,500	85,510.45	0.24
32	688981	中芯国际	1,763	79,634.71	0.23
33	600690	海尔智家	3,500	96,110.00	0.27
33	06690	海尔智家	2,600	64,592.50	0.18
34	601288	农业银行	29,500	89,090.00	0.25
34	01288	农业银行	28,000	70,878.15	0.20
35	002415	海康威视	4,400	159,280.00	0.45
36	000002	万科 A	6,300	129,150.00	0.37
36	02202	万科企业	1,700	28,669.39	0.08
37	601088	中国神华	3,000	99,900.00	0.28
37	01088	中国神华	3,000	57,725.33	0.16
38	300760	迈瑞医疗	500	156,600.00	0.45
39	002475	立讯精密	4,600	155,434.00	0.44
40	02331	李宁	2,500	155,430.78	0.44
41	600276	恒瑞医药	4,120	152,810.80	0.43
42	600438	通威股份	2,500	149,650.00	0.43
43	000651	格力电器	4,400	148,368.00	0.42
44	600309	万华化学	1,500	145,485.00	0.41
45	02015	理想汽车-W	1,100	143,834.41	0.41
46	00883	中国海洋石油	16,000	141,756.29	0.40
47	000725	京东方 A	34,500	135,930.00	0.39
48	002714	牧原股份	2,420	133,753.40	0.38
49	000001	平安银行	8,900	133,322.00	0.38
50	002142	宁波银行	3,700	132,497.00	0.38
51	02628	中国人寿	7,000	81,773.27	0.23
51	601628	中国人寿	1,500	46,620.00	0.13
52	002812	恩捷股份	500	125,225.00	0.36
53	01109	华润置地	4,000	125,199.82	0.36
54	002129	TCL 中环	2,100	123,669.00	0.35
55	09633	农夫山泉	3,200	123,284.19	0.35
56	00386	中国石油化工股份	24,000	72,451.70	0.21
56	600028	中国石化	12,200	49,776.00	0.14
57	000792	盐湖股份	4,000	119,840.00	0.34
58	00016	新鸿基地产	1,500	118,914.17	0.34
59	09868	小鹏汽车-W	1,100	118,905.62	0.34
60	603799	华友钴业	1,240	118,568.80	0.34
61	603288	海天味业	1,303	117,739.08	0.34
62	601601	中国太保	3,100	72,943.00	0.21

62	02601	中国太保	2,600	42,646.61	0.12
63	600048	保利发展	6,600	115,236.00	0.33
64	00001	长和	2,500	113,419.57	0.32
65	01658	邮储银行	11,000	58,606.17	0.17
65	601658	邮储银行	10,100	54,439.00	0.15
66	002466	天齐锂业	900	112,320.00	0.32
67	00857	中国石油股份	20,000	63,968.21	0.18
67	601857	中国石油	9,100	48,230.00	0.14
68	300124	汇川技术	1,700	111,979.00	0.32
69	00002	中电控股	2,000	111,345.74	0.32
70	300015	爱尔眼科	2,463	110,268.51	0.31
71	002304	洋河股份	600	109,890.00	0.31
72	600436	片仔癀	300	107,019.00	0.30
73	600585	海螺水泥	2,200	77,616.00	0.22
73	00914	海螺水泥	1,000	29,076.46	0.08
74	02388	中银香港	4,000	106,043.56	0.30
75	00669	创科实业	1,500	104,995.95	0.30
76	600031	三一重工	5,500	104,830.00	0.30
77	002460	赣锋锂业	700	104,090.00	0.30
78	601668	中国建筑	19,200	102,144.00	0.29
79	002352	顺丰控股	1,800	100,458.00	0.29
80	02319	蒙牛乳业	3,000	100,442.07	0.29
81	300498	温氏股份	4,700	100,063.00	0.28
82	00291	华润啤酒	2,000	100,057.23	0.28
83	02020	安踏体育	1,200	98,928.38	0.28
84	300274	阳光电源	1,000	98,250.00	0.28
85	300014	亿纬锂能	1,000	97,500.00	0.28
86	600089	特变电工	3,500	95,865.00	0.27
87	01113	长实集团	2,000	94,926.09	0.27
88	06160	百济神州	1,100	92,659.84	0.26
89	002271	东方雨虹	1,800	92,646.00	0.26
90	601816	京沪高铁	18,000	90,360.00	0.26
91	603986	兆易创新	620	88,170.20	0.25
92	603501	韦尔股份	500	86,515.00	0.25
93	600000	浦发银行	10,800	86,508.00	0.25
94	600837	海通证券	8,800	86,328.00	0.25
95	600016	民生银行	22,900	85,188.00	0.24
96	00688	中国海外发展	4,000	84,834.85	0.24
97	00011	恒生银行	700	82,910.67	0.24
98	02333	长城汽车	3,000	41,408.30	0.12
98	601633	长城汽车	1,100	40,744.00	0.12
99	600406	国电南瑞	3,024	81,648.00	0.23
100	601919	中远海控	5,810	80,759.00	0.23

101	002709	天赐材料	1,300	80,678.00	0.23
102	000625	长安汽车	4,654	80,607.28	0.23
103	00027	银河娱乐	2,000	80,045.78	0.23
104	300122	智飞生物	700	77,707.00	0.22
105	600919	江苏银行	10,900	77,608.00	0.22
106	02688	新奥能源	700	77,163.79	0.22
107	601688	华泰证券	5,400	76,680.00	0.22
108	000063	中兴通讯	3,000	76,590.00	0.22
109	600104	上汽集团	4,300	76,583.00	0.22
110	02382	舜宇光学科技	700	76,565.16	0.22
111	00175	吉利汽车	5,000	76,282.95	0.22
112	601225	陕西煤业	3,600	76,248.00	0.22
113	002049	紫光国微	400	75,888.00	0.22
114	002241	歌尔股份	2,200	73,920.00	0.21
115	300142	沃森生物	1,500	72,585.00	0.21
116	00003	香港中华煤气	9,800	70,818.28	0.20
117	600111	北方稀土	2,000	70,320.00	0.20
118	002230	科大讯飞	1,700	70,074.00	0.20
119	000661	长春高新	300	70,026.00	0.20
120	688599	天合光能	1,069	69,752.25	0.20
121	002459	晶澳科技	840	66,276.00	0.19
122	300450	先导智能	1,040	65,707.20	0.19
123	02313	申洲国际	800	65,028.65	0.19
124	01997	九龙仓置业	2,000	63,968.21	0.18
125	00960	龙湖集团	2,000	63,369.58	0.18
126	00006	电能实业	1,500	63,305.44	0.18
127	600660	福耀玻璃	1,500	62,715.00	0.18
128	002027	分众传媒	9,300	62,589.00	0.18
129	000338	潍柴动力	5,000	62,350.00	0.18
130	601211	国泰君安	4,100	62,320.00	0.18
131	601169	北京银行	13,600	61,744.00	0.18
132	000100	TCL 科技	12,800	61,312.00	0.17
133	06618	京东健康	1,150	60,532.49	0.17
134	601229	上海银行	9,200	60,260.00	0.17
135	300896	爱美客	100	60,001.00	0.17
136	06098	碧桂园服务	2,000	59,777.78	0.17
137	601985	中国核电	8,700	59,682.00	0.17
138	600745	闻泰科技	700	59,577.00	0.17
139	002179	中航光电	940	59,520.80	0.17
140	600050	中国联通	17,100	59,166.00	0.17
141	600893	航发动力	1,300	59,163.00	0.17
142	601766	中国中车	11,200	58,240.00	0.17
143	600522	中天科技	2,500	57,750.00	0.16



144	601390	中国中铁	9,400	57,716.00	0.16
145	300347	泰格医药	500	57,225.00	0.16
146	002371	北方华创	200	55,424.00	0.16
147	03800	协鑫科技	17,000	55,099.89	0.16
148	601669	中国电建	7,000	55,090.00	0.16
149	00267	中信股份	8,000	54,390.08	0.15
150	000776	广发证券	2,900	54,230.00	0.15
151	01093	石药集团	8,000	53,295.44	0.15
152	00066	港铁公司	1,500	52,594.19	0.15
153	603659	璞泰来	620	52,328.00	0.15
154	600019	宝钢股份	8,600	51,772.00	0.15
155	600009	上海机场	900	51,030.00	0.15
156	01821	ESR	2,800	50,764.08	0.14
157	601615	明阳智能	1,500	50,700.00	0.14
158	000596	古井贡酒	200	49,932.00	0.14
159	600905	三峡能源	7,900	49,691.00	0.14
160	600010	包钢股份	20,900	49,115.00	0.14
161	300751	迈为股份	100	49,090.00	0.14
162	002410	广联达	900	48,996.00	0.14
163	600999	招商证券	3,400	48,994.00	0.14
164	601009	南京银行	4,700	48,974.00	0.14
165	600570	恒生电子	1,120	48,764.80	0.14
166	01548	金斯瑞生物科技	2,000	48,660.31	0.14
167	600958	东方证券	4,752	48,517.92	0.14
168	600196	复星医药	1,100	48,499.00	0.14
169	00868	信义玻璃	3,000	48,284.03	0.14
170	002311	海大集团	800	48,008.00	0.14
171	00881	中升控股	1,000	47,334.77	0.13
172	00268	金蝶国际	3,000	47,206.49	0.13
173	000895	双汇发展	1,600	46,880.00	0.13
174	688012	中微公司	400	46,700.00	0.13
175	00322	康师傅控股	4,000	45,975.01	0.13
176	601818	光大银行	15,200	45,752.00	0.13
177	01928	金沙中国有限公司	2,800	44,825.64	0.13
178	01801	信达生物	1,500	44,769.20	0.13
179	002920	德赛西威	300	44,400.00	0.13
180	002050	三花智控	1,600	43,968.00	0.13
181	002493	荣盛石化	2,850	43,861.50	0.12
182	300759	康龙化成	450	42,849.00	0.12
183	01177	中国生物制药	10,000	42,502.94	0.12
184	600346	恒力石化	1,900	42,256.00	0.12
185	600926	杭州银行	2,800	41,944.00	0.12

186	02328	中国财险	6,000	41,870.10	0.12
187	600460	士兰微	800	41,600.00	0.12
188	00288	万洲国际	8,000	41,459.61	0.12
188	00968	信义光能	4,000	41,459.61	0.12
190	06969	思摩尔国际	2,000	41,391.20	0.12
191	600760	中航沈飞	680	41,106.00	0.12
192	002074	国轩高科	900	41,040.00	0.12
193	300661	圣邦股份	225	40,954.50	0.12
194	000733	振华科技	300	40,791.00	0.12
195	300316	晶盛机电	600	40,554.00	0.12
196	002340	格林美	4,400	40,040.00	0.11
197	000538	云南白药	660	39,857.40	0.11
198	00083	信和置业	4,000	39,612.40	0.11
199	688111	金山办公	200	39,424.00	0.11
200	000768	中航西飞	1,300	39,377.00	0.11
201	300496	中科创达	300	39,144.00	0.11
202	002001	新和成	1,712	39,050.72	0.11
203	001979	招商蛇口	2,900	38,947.00	0.11
204	600176	中国巨石	2,229	38,806.89	0.11
205	603290	斯达半导	100	38,590.00	0.11
206	601989	中国重工	10,400	38,584.00	0.11
207	600426	华鲁恒升	1,320	38,544.00	0.11
208	688396	华润微	639	37,745.73	0.11
209	00992	联想集团	6,000	37,611.26	0.11
210	603993	洛阳钼业	6,500	37,245.00	0.11
211	000799	酒鬼酒	200	37,162.00	0.11
212	600085	同仁堂	700	37,016.00	0.11
213	002202	金风科技	2,500	37,000.00	0.11
214	603806	福斯特	564	36,953.28	0.11
215	601138	工业富联	3,700	36,408.00	0.10
216	00788	中国铁塔	42,000	36,277.16	0.10
217	601006	大秦铁路	5,500	36,245.00	0.10
218	000963	华东医药	800	36,128.00	0.10
219	000166	申万宏源	8,400	36,036.00	0.10
220	601377	兴业证券	5,100	35,955.00	0.10
221	601877	正泰电器	1,000	35,780.00	0.10
222	002180	纳思达	700	35,434.00	0.10
223	01929	周大福	2,800	35,343.29	0.10
224	600885	宏发股份	840	35,154.00	0.10
225	601600	中国铝业	7,400	35,150.00	0.10
226	600584	长电科技	1,300	35,100.00	0.10
227	600763	通策医疗	200	34,888.00	0.10
228	300012	华测检测	1,500	34,815.00	0.10

229	300207	欣旺达	1,100	34,760.00	0.10
230	600588	用友网络	1,600	34,736.00	0.10
231	601066	中信建投	1,200	34,692.00	0.10
232	600741	华域汽车	1,500	34,500.00	0.10
233	600029	南方航空	4,700	34,357.00	0.10
234	601689	拓普集团	500	34,215.00	0.10
235	600383	金地集团	2,500	33,600.00	0.10
236	02007	碧桂园	8,000	33,249.79	0.09
237	601186	中国铁建	4,200	33,180.00	0.09
238	601838	成都银行	2,000	33,160.00	0.09
239	300408	三环集团	1,100	33,110.00	0.09
240	300999	金龙鱼	600	32,412.00	0.09
241	01876	百威亚太	1,600	32,155.14	0.09
242	000876	新希望	2,100	32,130.00	0.09
243	601238	广汽集团	2,100	32,004.00	0.09
244	601117	中国化学	3,400	31,994.00	0.09
245	603019	中科曙光	1,100	31,922.00	0.09
246	600188	兖矿能源	800	31,584.00	0.09
247	600547	山东黄金	1,700	31,552.00	0.09
248	603392	万泰生物	203	31,525.90	0.09
249	600754	锦江酒店	500	31,450.00	0.09
250	601111	中国国航	2,700	31,347.00	0.09
251	06862	海底捞	2,000	31,299.95	0.09
252	600600	青岛啤酒	300	31,176.00	0.09
253	000786	北新建材	900	31,158.00	0.09
254	601100	恒立液压	500	30,860.00	0.09
255	06186	中国飞鹤	4,000	30,855.26	0.09
256	003816	中国广核	11,000	30,800.00	0.09
257	600989	宝丰能源	2,100	30,765.00	0.09
258	300601	康泰生物	680	30,722.40	0.09
259	603369	今世缘	600	30,600.00	0.09
260	600150	中国船舶	1,600	30,368.00	0.09
261	300782	卓胜微	224	30,240.00	0.09
262	603833	欧派家居	200	30,136.00	0.09
263	00998	中信银行	10,000	30,017.17	0.09
264	002384	东山精密	1,300	29,809.00	0.08
265	600884	杉杉股份	1,000	29,720.00	0.08
266	601800	中国交建	3,200	29,696.00	0.08
267	603816	顾家家居	520	29,447.60	0.08
268	600886	国投电力	2,800	29,400.00	0.08
269	600132	重庆啤酒	200	29,320.00	0.08
270	000723	美锦能源	2,400	29,280.00	0.08
271	600015	华夏银行	5,600	29,176.00	0.08

272	00151	中国旺旺	5,000	29,161.98	0.08
273	002821	凯莱英	100	28,900.00	0.08
274	03323	中国建材	4,000	28,665.97	0.08
275	300595	欧普康视	500	28,595.00	0.08
276	601788	光大证券	1,800	28,368.00	0.08
277	000157	中联重科	4,600	28,336.00	0.08
278	601868	中国能建	11,900	28,203.00	0.08
279	600011	华能国际	4,000	28,160.00	0.08
280	688005	容百科技	216	27,959.04	0.08
281	002648	卫星化学	1,079	27,892.15	0.08
282	00836	华润电力	2,000	27,708.16	0.08
283	002555	三七互娱	1,300	27,599.00	0.08
284	600115	中国东航	5,000	27,450.00	0.08
285	03692	翰森制药	2,000	27,092.42	0.08
286	000301	东方盛虹	1,600	27,056.00	0.08
287	605358	立昂微	400	26,952.00	0.08
288	000425	徐工机械	5,000	26,950.00	0.08
289	600845	宝信软件	490	26,754.00	0.08
290	601995	中金公司	600	26,694.00	0.08
291	01378	中国宏桥	3,500	26,549.37	0.08
292	600233	圆通速递	1,300	26,507.00	0.08
293	002008	大族激光	800	26,504.00	0.08
294	02618	京东物流	1,800	26,353.54	0.08
295	002236	大华股份	1,600	26,272.00	0.07
296	03888	金山软件	1,000	26,168.81	0.07
297	002601	龙佰集团	1,300	26,065.00	0.07
298	09992	泡泡玛特	800	25,929.36	0.07
299	601555	东吴证券	3,730	25,848.90	0.07
300	601336	新华保险	800	25,752.00	0.07
301	601901	方正证券	3,800	25,498.00	0.07
302	00101	恒隆地产	2,000	25,450.45	0.07
303	300529	健帆生物	500	25,445.00	0.07
304	601233	桐昆股份	1,600	25,408.00	0.07
305	000938	紫光股份	1,300	25,220.00	0.07
306	00012	恒基地产	1,000	25,142.59	0.07
307	01193	华润燃气	800	25,005.76	0.07
308	002736	国信证券	2,600	24,882.00	0.07
309	300919	中伟股份	200	24,780.00	0.07
310	603882	金城医学	300	24,765.00	0.07
311	000069	华侨城 A	3,800	24,662.00	0.07
312	688126	沪硅产业	1,072	24,634.56	0.07
313	00004	九龙仓集团	1,000	24,458.43	0.07
314	603486	科沃斯	200	24,378.00	0.07

315	600298	安琪酵母	500	24,375.00	0.07
316	600219	南山铝业	6,600	24,354.00	0.07
317	002385	大北农	3,100	24,211.00	0.07
318	00017	新世界发展	1,000	24,073.60	0.07
319	002120	韵达股份	1,400	23,884.00	0.07
320	000977	浪潮信息	900	23,832.00	0.07
321	688008	澜起科技	392	23,747.36	0.07
322	603260	合盛硅业	200	23,592.00	0.07
323	601108	财通证券	2,990	23,531.30	0.07
324	300363	博腾股份	300	23,397.00	0.07
325	300413	芒果超媒	700	23,352.00	0.07
326	603517	绝味食品	400	23,128.00	0.07
327	300144	宋城演艺	1,500	23,025.00	0.07
328	300628	亿联网络	300	22,845.00	0.07
329	00144	招商局港口	2,000	22,816.47	0.06
330	002007	华兰生物	1,000	22,800.00	0.06
331	601618	中国中冶	6,500	22,750.00	0.06
332	002841	视源股份	300	22,596.00	0.06
333	603899	晨光股份	400	22,432.00	0.06
334	300003	乐普医疗	1,200	22,284.00	0.06
335	002013	中航机电	1,800	22,230.00	0.06
336	601360	三六零	2,600	22,152.00	0.06
337	600332	白云山	700	22,113.00	0.06
338	000703	恒逸石化	2,100	22,071.00	0.06
339	00135	昆仑能源	4,000	21,995.49	0.06
340	002252	上海莱士	3,700	21,941.00	0.06
341	00586	海螺创业	1,500	21,935.62	0.06
342	603185	上机数控	140	21,838.60	0.06
343	300957	贝泰妮	100	21,753.00	0.06
344	000783	长江证券	3,600	21,348.00	0.06
345	300763	锦浪科技	100	21,300.00	0.06
346	300223	北京君正	200	21,250.00	0.06
347	00285	比亚迪电子	1,000	21,165.95	0.06
348	002938	鹏鼎控股	700	21,147.00	0.06
349	601077	渝农商行	5,700	21,090.00	0.06
350	300454	深信服	200	20,756.00	0.06
351	00384	中国燃气	2,000	20,729.81	0.06
352	01038	长江基建集团	500	20,567.32	0.06
353	601878	浙商证券	1,800	20,484.00	0.06
354	601155	新城控股	800	20,344.00	0.06
355	688099	晶晨股份	200	20,200.00	0.06
356	00019	太古股份公司 A	500	19,990.07	0.06
357	01209	华润万象生活	600	19,960.13	0.06

358	601696	中银证券	1,500	19,950.00	0.06
359	300433	蓝思科技	1,800	19,926.00	0.06
360	600918	中泰证券	2,600	19,890.00	0.06
361	002602	世纪华通	4,100	19,762.00	0.06
362	002185	华天科技	2,100	19,698.00	0.06
363	300146	汤臣倍健	900	19,485.00	0.06
364	000066	中国长城	1,800	19,476.00	0.06
365	688180	君实生物	257	19,362.38	0.06
366	601727	上海电气	4,700	19,317.00	0.05
367	300033	同花顺	200	19,230.00	0.05
368	601636	旗滨集团	1,500	19,125.00	0.05
369	600674	川投能源	1,600	19,072.00	0.05
370	601865	福莱特	500	19,050.00	0.05
371	00762	中国联通	6,000	19,036.53	0.05
372	603939	益丰药房	360	19,018.80	0.05
373	01308	海丰国际	1,000	18,985.22	0.05
374	600109	国金证券	2,100	18,900.00	0.05
375	002916	深南电路	200	18,742.00	0.05
376	01066	威高股份	2,400	18,718.40	0.05
377	600183	生益科技	1,100	18,689.00	0.05
378	601728	中国电信	5,000	18,650.00	0.05
379	600779	水井坊	200	18,508.00	0.05
380	00241	阿里健康	4,000	18,472.10	0.05
381	603893	瑞芯微	200	18,188.00	0.05
382	000708	中信特钢	900	18,135.00	0.05
383	601607	上海医药	1,000	18,080.00	0.05
384	002568	百润股份	600	18,024.00	0.05
385	002508	老板电器	500	18,015.00	0.05
386	600362	江西铜业	1,000	17,830.00	0.05
387	601898	中煤能源	1,700	17,646.00	0.05
388	603589	口子窖	300	17,583.00	0.05
389	600018	上港集团	3,000	17,490.00	0.05
390	002624	完美世界	1,200	17,244.00	0.05
391	601799	星宇股份	100	17,100.00	0.05
392	600161	天坛生物	700	16,996.00	0.05
393	600705	中航产融	4,900	16,954.00	0.05
394	603345	安井食品	100	16,787.00	0.05
395	601990	南京证券	2,000	16,680.00	0.05
396	01972	太古地产	1,000	16,659.10	0.05
397	002080	中材科技	600	16,500.00	0.05
398	000408	藏格矿业	500	16,470.00	0.05
399	002673	西部证券	2,500	16,350.00	0.05
400	688036	传音控股	182	16,239.86	0.05

401	002414	高德红外	1,236	15,907.32	0.05
402	01044	恒安国际	500	15,756.88	0.04
403	00853	微创医疗	800	15,564.46	0.04
404	00656	复星国际	2,500	15,500.32	0.04
405	600143	金发科技	1,600	15,232.00	0.04
406	601966	玲珑轮胎	600	15,222.00	0.04
407	603233	大参林	484	15,149.20	0.04
408	601216	君正集团	3,100	15,128.00	0.04
409	000728	国元证券	2,400	14,928.00	0.04
410	600803	新奥股份	800	14,872.00	0.04
411	601319	中国人保	2,900	14,674.00	0.04
412	600079	人福医药	900	14,400.00	0.04
413	300676	华大基因	200	14,340.00	0.04
414	00270	粤海投资	2,000	14,196.15	0.04
415	00884	旭辉控股集团	4,160	14,016.91	0.04
416	600372	中航电子	700	13,573.00	0.04
417	600038	中直股份	300	13,560.00	0.04
418	300832	新产业	300	13,533.00	0.04
419	601198	东兴证券	1,500	13,350.00	0.04
420	003022	联泓新科	400	13,292.00	0.04
421	300677	英科医疗	520	13,187.20	0.04
422	01691	J S 环球生活	1,500	13,110.06	0.04
423	002600	领益智造	2,600	13,052.00	0.04
424	688187	时代电气	200	12,998.00	0.04
425	002791	坚朗五金	100	12,972.00	0.04
426	00772	阅文集团	400	12,964.68	0.04
427	603737	三棵树	100	12,943.00	0.04
428	00754	合生创展集团	1,210	12,396.66	0.04
429	600369	西南证券	3,100	12,307.00	0.04
430	06110	滔搏	2,000	12,195.01	0.03
431	300558	贝达药业	200	12,160.00	0.03
432	002064	华峰化学	1,400	11,816.00	0.03
433	01918	融创中国	3,000	11,750.31	0.03
434	601881	中国银河	1,200	11,604.00	0.03
435	01999	敏华控股	1,600	11,603.22	0.03
436	00966	中国太平	1,400	11,589.53	0.03
437	02689	玖龙纸业	2,000	11,356.92	0.03
438	02588	中银航空租赁	200	11,279.96	0.03
439	600025	华能水电	1,600	11,184.00	0.03
440	603707	健友股份	390	10,998.00	0.03
441	000050	深天马 A	1,100	10,967.00	0.03
442	00909	明源云	1,000	10,741.19	0.03
443	002153	石基信息	648	10,283.76	0.03

444	000800	一汽解放	1,100	10,274.00	0.03
445	01833	平安好医生	500	9,941.58	0.03
446	000987	越秀金控	1,411	9,919.33	0.03
447	002607	中公教育	1,700	9,843.00	0.03
448	603087	甘李药业	200	9,594.00	0.03
449	002939	长城证券	900	9,144.00	0.03
450	01313	华润水泥控股	2,000	9,013.70	0.03
451	601231	环旭电子	600	8,616.00	0.02
452	06993	蓝月亮集团	1,500	8,594.66	0.02
453	601808	中海油服	600	8,370.00	0.02
454	06666	恒大物业	4,000	7,867.75	0.02
455	02018	瑞声科技	500	7,722.37	0.02
456	000877	天山股份	600	7,380.00	0.02
457	00293	国泰航空	1,000	7,346.08	0.02
458	300979	华利集团	100	7,308.00	0.02
459	01128	永利澳门	1,600	7,293.06	0.02
460	300888	稳健医疗	100	6,650.00	0.02
461	300866	安克创新	100	6,632.00	0.02
462	00813	世茂集团	1,500	5,669.91	0.02
463	601825	沪农商行	900	5,643.00	0.02
464	002032	苏泊尔	100	5,634.00	0.02
465	06808	高鑫零售	2,500	5,451.84	0.02
466	01516	融创服务	1,000	4,079.26	0.01
467	03333	中国恒大	2,000	2,822.13	0.01
468	001289	龙源电力	100	2,176.00	0.01
469	03380	龙光集团	1,000	1,864.31	0.01

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初基金资产净值 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	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300750	宁德时代	1,178,062.00	2.49
2	00700	腾讯控股	666,772.69	1.41
3	002594	比亚迪	352,867.00	0.75
3	01211	比亚迪股份	127,211.92	0.27
5	300760	迈瑞医疗	448,958.73	0.95
6	000858	五粮液	428,255.00	0.90
7	000333	美的集团	397,739.00	0.84
8	300059	东方财富	332,563.00	0.70
9	002812	恩捷股份	317,182.00	0.67



10	002049	紫光国微	280,224.00	0.59
11	00005	汇丰控股	268,290.22	0.57
12	002415	海康威视	266,204.00	0.56
13	002475	立讯精密	258,702.00	0.55
14	000568	泸州老窖	258,206.00	0.55
15	03690	美团-W	254,743.71	0.54
16	01299	友邦保险	251,144.64	0.53
17	000651	格力电器	223,047.00	0.47
18	000725	京东方 A	215,601.00	0.46
19	002304	洋河股份	209,581.00	0.44
20	000792	盐湖股份	203,005.00	0.43
21	002714	牧原股份	201,971.00	0.43

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初基金资产净值 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	占期初基金资产净值比例（%）
1	300750	宁德时代	1,457,418.00	3.08
2	00700	腾讯控股	1,359,020.88	2.87
3	03690	美团-W	724,199.33	1.53
4	000858	五粮液	560,606.00	1.18
5	000333	美的集团	529,186.00	1.12
6	002594	比亚迪	423,705.00	0.89
6	01211	比亚迪股份	97,165.45	0.21
8	00005	汇丰控股	513,055.06	1.08
9	01299	友邦保险	485,563.09	1.03
10	300760	迈瑞医疗	458,068.00	0.97
11	300059	东方财富	421,881.64	0.89
12	002812	恩捷股份	346,309.00	0.73
13	002415	海康威视	345,297.54	0.73
14	00939	建设银行	333,351.18	0.70
14	601939	建设银行	6,568.00	0.01
16	002475	立讯精密	329,301.00	0.70
17	000568	泸州老窖	309,863.00	0.65
18	002049	紫光国微	304,919.00	0.64
19	000651	格力电器	282,570.00	0.60
20	02318	中国平安	206,120.17	0.44
20	601318	中国平安	65,883.00	0.14
22	000001	平安银行	256,041.00	0.54
23	002714	牧原股份	253,755.00	0.54

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

买入股票成本（成交）总额	19,236,103.90
卖出股票收入（成交）总额	26,397,170.89

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 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 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 本基金投资的前十名证券的发行主体中，招商银行股份有限公司、中国建设银行股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责、处罚的情况。本基金为指数型基金，采取完全复制策略，建设银行、招商银行系标的指数成份股，上述股票的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

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	12,593.51
2	应收清算款	-
3	应收股利	88,800.10
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	101,393.61

#### 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

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
811	50,717.44	17,129,246.00	41.64%	24,002,600.00	58.36%

#### 8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	中信建投证券股份有限公司	7,911,800.00	19.24%
2	中信证券股份有限公司	4,693,346.00	11.41%

3	华泰证券股份有限公司	2,101,100.00	5.11%
4	罗朝军	1,001,000.00	2.43%
5	王玉良	1,000,000.00	2.43%
6	海通证券股份有限公司	874,100.00	2.13%
7	华夏基金—中信证券股份 有限公司—华夏基金—中 信证券消费增强单一资产 管理计划	800,000.00	1.94%
8	中泰证券股份有限公司	748,900.00	1.82%
9	高庆云	600,000.00	1.46%
10	江激	500,000.00	1.22%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	-	-

### 8.4 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	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2021 年 4 月 7 日）基金份额总额	301,131,846.00
本报告期期初基金份额总额	51,131,846.00
本报告期基金总申购份额	65,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	75,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	41,131,846.00

## §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

本报告期内，桂勇先生担任华夏基金管理有限公司首席信息官，李一梅女士不再兼任。华夏基金管理有限公司已根据法律法规的规定完成财务负责人孙立强先生的有关备案工作。

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	
广发证券	2	13,447,756.97	29.56%	5,800.26	28.21%	-
中金公司	4	10,593,117.64	23.29%	4,568.85	22.22%	-
申万宏源证券	4	6,998,144.54	15.38%	3,438.08	16.72%	-
长江证券	2	4,863,755.85	10.69%	2,389.75	11.62%	-
招商证券	4	4,182,159.76	9.19%	2,035.17	9.90%	-
方正证券	4	3,425,640.87	7.53%	1,477.33	7.18%	-
国盛证券	2	993,445.00	2.18%	428.51	2.08%	-
中银国际证券	3	978,232.00	2.15%	421.98	2.05%	-
海通证券	5	10,697.88	0.02%	4.61	0.02%	-
国信证券	3	-	-	-	-	-

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。

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 有较强的全方位金融服务能力和水平：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；能积极为公司投资

业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

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 本基金管理人根据上述标准进行评估并确定选用的券商。

ii 本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议/证券经纪服务协议。

③除本表列示外，本基金还选择了东北证券、东方财富证券、东方证券、东海证券、东吴证券、东兴证券、高华证券、国金证券、国泰君安证券、华安证券、华泰证券、华西证券、金通证券、南京证券、平安证券、瑞银证券、太平洋证券、万和证券、五矿证券、西部证券、西南证券、信达证券、兴业证券、野村东方国际、野村东方国际证券、银河证券、中国银河证券、中信建投证券、中信建投证券、中信证券、中信证券(浙江)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。

④在上述租用的券商交易单元中，华泰证券的部分交易单元、粤开证券的交易单元为本基金本期剔除的交易单元，本期没有新增的券商交易单元。

#### 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		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	52.38	6.87%	-	-
方正证券	1,301.50	100.00%	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中银	-	-	-	-	-	-	-	-

国际 证券									
海通 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
国信 证券	-	-	-	-	710.12	93.13%	-	-	-

### 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	华夏中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金暂停申购、赎回业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-01-24
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	2022-02-12
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	2022-02-17
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	2022-03-19
5	华夏中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金暂停申购、赎回业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-03-28
6	华夏中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金暂停申购、赎回业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-04-12
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	2022-04-19
8	华夏中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金暂停申购、赎回业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-04-25
9	华夏中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金暂停申购、赎回业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-04-29
10	华夏基金管理有限公司关于旗下管理的上海证券交易所上市 ETF 实施申赎业务多码合一的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-06-16
11	华夏基金管理有限公司公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-06-24
12	华夏基金管理有限公司公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-06-25
13	华夏中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金暂停申购、赎回业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-06-28

## §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

投资者	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况	
	序	持有基金份额比例达	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额

类别	号	到或者超过 20%的时间区间					比
机构	1	2022-01-01 至 2022-01-03	12,458,846.00	14,401,800.00	22,167,300.00	4,693,346.00	11.41%
	2	2022-03-09 至 2022-03-10,2022-03-16 至 2022-04-05,2022-06-20 至 2022-06-27	7,974,800.00	10,337,500.00	10,400,500.00	7,911,800.00	19.24%
	3	2022-06-14	-	15,000,000.00	15,000,000.00	-	-
产品特有风险							
<p>本基金在报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额20%的情形,在市场流动性不足的情况下,如遇投资者巨额赎回或集中赎回,基金管理人可能无法以合理的价格及时变现基金资产,有可能对基金净值产生一定的影响,甚至可能引发基金的流动性风险。</p> <p>在特定情况下,若持有基金份额占比较高的投资者大量赎回本基金,可能导致在其赎回后本基金资产规模持续低于正常运作水平,面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。</p>							

## §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、《华夏中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《华夏中证沪港深 500 交易型开放式指数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

二〇二二年八月三十日