

# 中小企业 100 交易型开放式指数基金

## 2022 年第 3 季度报告

### 2022 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：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二二年十月二十五日

## §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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 10 月 21 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 2022 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

## §2 基金产品概况

基金简称	华夏中小企业 100ETF
场内简称	中小 100ETF
基金主代码	159902
交易代码	159902
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2006 年 6 月 8 日
报告期末基金份额总额	189,090,991.00 份
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	本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性不足等）导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代。为有效管理投资组合，基金可投资于经中国证监会允许的各种金融衍生产品，如期权、期货、权证以及其他与标的指数或标的指数成份股相关的衍生工具。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为“中小企业 100 指数”。
风险收益特征	本基金属股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，采用完全复制策略，跟踪反映原中小企业板市场的标的指数，是股票基金中风险较高的产品。
基金管理人	华夏基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

## §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
--------	-----

	(2022 年 7 月 1 日-2022 年 9 月 30 日)
1.本期已实现收益	2,115,301.61
2.本期利润	-139,978,710.26
3.加权平均基金份额本期利润	-0.7256
4.期末基金资产净值	699,254,041.91
5.期末基金份额净值	3.698

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。

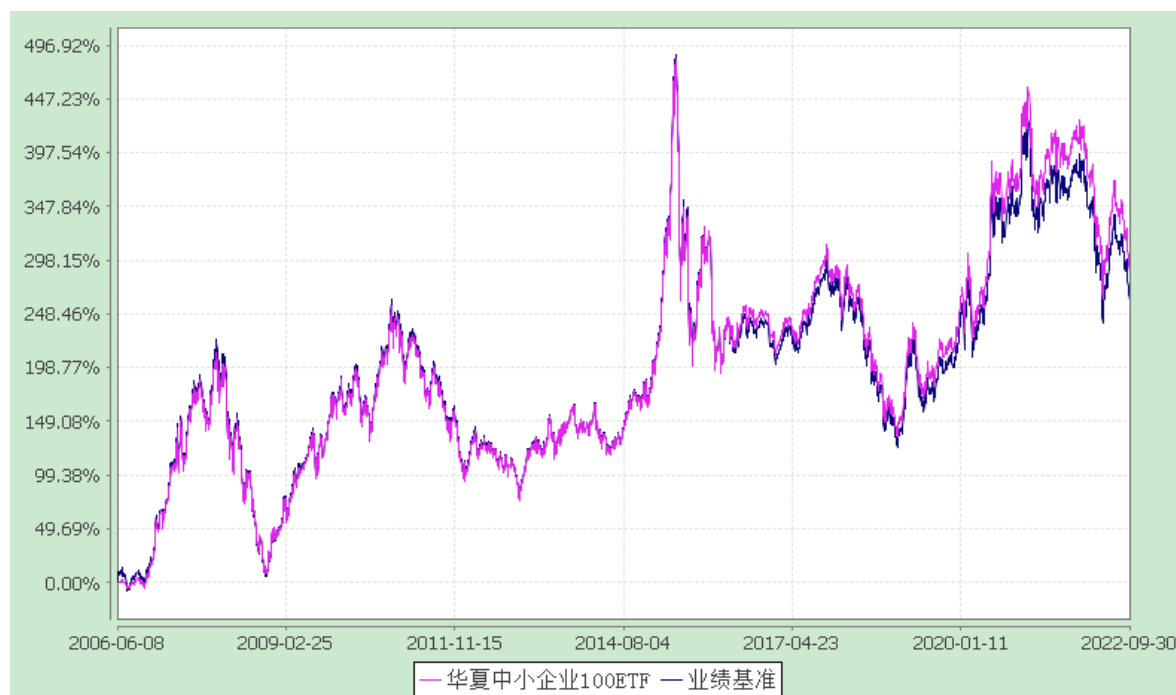
### 3.2 基金净值表现

#### 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

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	-16.45%	1.12%	-16.73%	1.13%	0.28%	-0.01%
过去六个月	-8.69%	1.51%	-9.48%	1.52%	0.79%	-0.01%
过去一年	-21.07%	1.42%	-21.78%	1.43%	0.71%	-0.01%
过去三年	25.48%	1.52%	22.62%	1.53%	2.86%	-0.01%
过去五年	1.32%	1.54%	-2.74%	1.54%	4.06%	0.00%
自基金合同生效起至今	287.55%	1.79%	260.84%	1.82%	26.71%	-0.03%

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

中小企业 100 交易型开放式指数基金  
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  
(2006 年 6 月 8 日至 2022 年 9 月 30 日)



## §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		
徐猛	本基金的基金经理、投委会成员	2016-12-01	-	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日期间)、华夏沪港通恒生交易型开放式指数证

					<p>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</p>
--	--	--	--	--	--

					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。
--	--	--	--	--	---

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 25 次，均为指数量化投

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中小企业 100 指数，中小企业 100 指数遴选了原中小板市场中市值大、流动性好的 100 只 A 股作为样本，自 2006 年 1 月 24 日起正式发布，以综合反映原中小板市场整体表现，其作为原中小板市场的核心指数，兼具价值尺度与投资标的功能。本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。

3 季度，全球疫情持续蔓延，产业链、供应链循环不畅，国际能源、粮食供给较为紧张，大宗商品价格高位运行，高通胀已成为全球经济发展的最主要挑战，为应对通胀压力，欧美等国进一步加快加码收紧货币政策，全球经济下行压力加大，增长动能转弱，不稳定不确定因素显著增多。国内方面，国际环境复杂多变、疫情散发多发、高温干旱少雨极端天气等超预期因素影响冲击较大，部分地区生产、投资、消费受到一定影响，经济发展形势依然复杂严峻，但在稳经济一揽子政策措施和接续政策措施的刺激下，国民经济延续恢复发展态势，展示出强大韧性。

市场方面，3 季度以来，A 股市场表现较为低迷，调整压力主要来自于外部风险，美联储多次大幅加息以应对通胀，美债利率及美元指数较快上行加剧了全球风险资产价格波动，人民币汇率贬值压力加大，市场情绪因此亦受到一定扰动。虽然当前中国经济受到外部不利因素的阶段性扰动，市场风险偏好暂时较低，但 A 股市场向好的内在基本面并未发生实质性改变。

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、赎回等工作。

为促进本基金的市场流动性和平稳运行，经深圳证券交易所同意，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方正证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、广发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 9 月 30 日，本基金份额净值为 3.698 元，本报告期份额净值增长率为-16.45%，同期业绩比较基准增长率-16.73%。本基金本报告期跟踪偏离度为+0.28%，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	694,150,513.33	99.16
	其中:股票	694,150,513.33	99.16
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	451,723.76	0.06
	其中:债券	451,723.76	0.06
	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	5,383,797.68	0.77
8	其他资产	70,309.32	0.01
9	合计	700,056,344.09	100.00

注:股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值。

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	31,972,394.20	4.57
B	采矿业	2,176,155.00	0.31
C	制造业	519,964,856.91	74.36
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,688,872.00	0.53

E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	26,518,955.25	3.79
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	45,634,982.80	6.53
J	金融业	43,118,282.39	6.17
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	11,835,696.96	1.69
M	科学研究和技术服务业	1,294,815.35	0.19
N	水利、环境和公共设施管理业	1,592,361.24	0.23
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	1,331,559.00	0.19
Q	卫生和社会工作	2,534,027.23	0.36
R	文化、体育和娱乐业	2,487,555.00	0.36
S	综合	-	-
	合计	694,150,513.33	99.27

## 5.3 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	002594	比亚迪	178,786	45,055,859.86	6.44
2	002714	牧原股份	517,210	28,198,289.20	4.03
3	002475	立讯精密	956,253	28,113,838.20	4.02
4	002415	海康威视	818,094	24,886,419.48	3.56
5	002142	宁波银行	751,283	23,702,978.65	3.39
6	002129	TCL 中环	499,656	22,364,602.56	3.20
7	002352	顺丰控股	472,800	22,325,616.00	3.19
8	002466	天齐锂业	217,637	21,850,754.80	3.12
9	002304	洋河股份	127,807	20,212,677.05	2.89
10	002812	恩捷股份	106,500	18,543,780.00	2.65

## 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-

3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	451,723.76	0.06
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	451,723.76	0.06

## 5.5 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

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	127073	天赐转债	4,517	451,723.76	0.06
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

## 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。

## 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

## 5.9.1 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。

## 5.9.2 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。

## 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

## 5.10.1 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。

## 5.10.2 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。

## 5.10.3 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。

## 5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

5.11.2 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。

## 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	4,919.20
2	应收证券清算款	65,390.12
3	应收股利	-
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	70,309.32

## 5.11.4 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。

## 5.11.5 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。

## 5.11.6 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

本报告期期初基金份额总额	194,337,944.70
报告期期间基金总申购份额	7,500,000.00
减：报告期期间基金总赎回份额	12,746,953.70
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	189,090,991.00

## §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

2022 年 7 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。

2022 年 8 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。

2022 年 8 月 12 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。

2022 年 8 月 13 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。

2022 年 9 月 1 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、首批纳入互联互通 ETF 基金管理人、首批北交所主题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。

## §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、《中小企业 100 交易型开放式指数基金基金合同》；
- 3、《中小企业 100 交易型开放式指数基金托管协议》；
- 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

二〇二二年十月二十五日