

**华夏 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数
证券投资基金
2024 年中期报告
2024 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：二〇二四年八月三十日

§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 2024 年 8 月 28 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 2024 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.....	10
§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.....	12
6.3 净资产变动表.....	13
6.4 报表附注.....	14
§7 投资组合报告.....	39
7.1 期末基金资产组合情况.....	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	39
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.....	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	52
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	53
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.....	53
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.....	53
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.....	53
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.....	54
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	54
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	54
7.12 投资组合报告附注.....	54
§8 基金份额持有人信息.....	55
§9 开放式基金份额变动.....	56
§10 重大事件揭示.....	56
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	59
§12 备查文件目录.....	59

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华夏 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	华夏 MSCI 中国 A 股国际通 ETF
场内简称	MSCIA 股（扩位证券简称：MSCIA 股 ETF）
基金主代码	512990
交易代码	512990
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2018 年 9 月 17 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	239,015,418.00 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	2015 年 3 月 25 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，以期获得与标的指数收益相似的回报。
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、股指期货投资策略、国债期货投资策略等。
业绩比较基准	MSCI 中国 A 股国际通指数收益率。
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，在股票基金中属于较高风险、较高收益的产品。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华夏基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李彬	许俊
	联系电话	400-818-6666	010-66596688
	电子邮箱	service@ChinaAMC.com	fxjd_hq@bank-of-china.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		张佑君	葛海蛟

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	华夏基金管理有限公司	北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 8 层
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（2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	-10,801,783.79
本期利润	4,442,309.70
加权平均基金份额本期利润	0.0182
本期加权平均净值利润率	1.30%
本期基金份额净值增长率	1.20%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024年6月30日)
期末可供分配利润	94,562,583.39
期末可供分配基金份额利润	0.3956
期末基金资产净值	333,578,001.39
期末基金份额净值	1.3956
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年6月30日)
基金份额累计净值增长率	46.77%

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	-3.04%	0.51%	-3.88%	0.51%	0.84%	0.00%
过去三个月	-1.43%	0.79%	-2.61%	0.79%	1.18%	0.00%
过去六个月	1.20%	0.98%	0.00%	0.98%	1.20%	0.00%
过去一年	-7.61%	0.90%	-10.40%	0.91%	2.79%	-0.01%
过去三年	-25.97%	1.03%	-33.59%	1.04%	7.62%	-0.01%
自基金转型起至今	46.77%	1.20%	15.05%	1.20%	31.72%	0.00%

3.2.2 自基金转型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 MSCI 中国 A 股国际通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
 (2018 年 9 月 17 日至 2024 年 6 月 30 日)



注：本基金自 2018 年 9 月 17 日起由“MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金”转型而来。

§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、青岛、武汉及沈阳设有分公司，在香港、深圳、上海、北京设有子公司。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、首批个人养老金基金管理人、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、公募 REITs 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、SmartBeta 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 2024 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：在北交所主题偏股型基金(A 类)中华夏北交所创新中小企业精选两年定开混合发起式排名第 1/10；在对冲策略绝对收益目标基金(A 类)华夏安泰对冲策略 3 个月定开混合排名第 1/22；在 QDII 混合基金(A 类)中华夏全球科技先锋混合(QDII)排名第 2/48；在汽车主题行业偏股型基金(A 类)中华夏新能源车龙头混合发起式(A 类)排名第 3/17；在消费行业偏股型基金(A 类)中华夏网购精选混合(A 类)排名第 3/78、华夏消费臻选混合发起式(A 类)排名第 7/78。

固收与固收+产品：在 QDII 债券型基金(A 类)中华夏收益债券 (QDII) (A 类)排名第 1/24、华夏大中华信用债券 (QDII) (A 类)排名第 2/24；在信用债指数债券型基金(A 类)中华夏亚债中国指数(A 类)排名第 2/18；在定开纯债债券型基金(A 类)中华夏鼎华一年定开债券排名第 5/616、华夏鼎成一年定开债券排名第 14/616；在普通债券型基金(可投转债)(A 类)中华夏稳定双利债券(A 类)排名第 12/241；在长期纯债债券型基金(A 类)中华夏鼎航债券(A 类)排名第 7/793、华夏鼎茂债券(A 类)排名第 19/793、华夏鼎英债券(A 类)排名第 25/793、华夏鼎隆债券(A 类)排名第 26/793、华夏鼎信债券(A 类)排名第

52/793；在普通债券型基金(二级)(A 类)中华夏稳享增利 6 个月债券(A 类)排名第 13/416、华夏鼎源债券(A 类)排名第 27/416、华夏希望债券(A 类)排名第 29/416。

在《中国证券报》第二十届中国基金业金牛奖评选中，华夏基金荣获“金牛奖 20 周年特别贡献公司”，连续 8 年荣获“被动投资金牛基金公司”，产品层面华夏创新前沿股票荣获“五年期开放式股票型持续优胜金牛基金”，华夏中证 5G 通信主题 ETF 荣获“开放式指数型金牛基金”。在证券时报主办的第十八届中国基金业明星基金奖评选活动中，华夏基金将两大奖项收入囊中：公司层面，华夏基金荣获“三年期海外投资明星基金公司”；产品层面，华夏沪深 300ETF 荣获“三年持续回报指数型明星基金奖”。在《上海证券报》主办的第二十届“金基金”奖评选活动中，华夏基金将三大金基金奖项收入囊中：公司层面，华夏基金荣获“金基金·被动投资基金管理公司奖”；产品层面，华夏创新前沿股票荣获“金基金·股票型基金五年期奖”，华夏行业景气混合荣获“金基金·偏股混合型基金五年期奖”。

在客户服务方面，2024 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）华夏基金直销渠道继续优化页面显示，升级搜索及查询等功能，给客户更方便直观的使用体验；（2）华夏基金管家客户端上线亲子账户，通过亲子账户客户可以为子女创建专属理财账户，管理和储备孩子的零花钱、教育资金，从客户投资需求出发，进一步提升操作体验；（3）与常熟农商银行等代销机构合作，拓展更加丰富的客户理财渠道；（4）开展“送你长期主义的花朵”、“领定制户口本”、“打工人又爱又怕的一天要来了”、“希望高考也这么简单”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		
司帆	本基金的 基金经理	2021-10-21	-	13 年	硕士。2011 年 7 月加入华夏基金管理有限公司。历任数量投资部研究员等。

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《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值(元)	任职时间
司帆	公募基金	20	3,103,806,516.74	2021-07-06
	私募资产管理计划	2	9,587,467,297.29	2019-07-25
	其他组合	-	-	-

	合计	22	12,691,273,814.03	
--	----	----	-------------------	--

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 119 次，均为指数量化投资组合因投资策略需要发生的反向交易。

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为 MSCI 中国 A 股国际通指数，MSCI 中国 A 股国际通指数(MSCI China A Inclusion RMB Index) 由 MSCI 公司于 2017 年 10 月 23 日发布，其成份股为 A 股纳入 MSCI 新兴市场指数 (MSCI Emerging Markets Index) 的部分，该指数能够完整反映 A 股逐步纳入 MSCI 新兴市场指数的进程。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。

宏观经济上，美国经济在上半年整体处于边际放缓的节奏上，各部门略有分化。制造业短暂回暖，受到去年底流动性环境宽松和库存回补的带动，上半年美国制造业 PMI 短暂突破荣枯线之上，但随后回落。通胀持续下行，去通胀进程在二季度有所加快，CPI 整体读数持续回落。失业率边际抬升，失业率向上突破 4.0%，劳动力市场供求关系由紧转松。

国内方面，上半年宏观经济呈现出内需主导的经济周期有待复苏、出口增速高的特点。地产销售延续了去年两年多的回落趋势，全国新建商品房累计销售同比下降近 20%，但受“517 新政”推动，

6 月商品房成交面积环比回升幅度较大，未来房地产需求端放松应是大势所趋，政策支持下的地产销售有望延续企稳态势。消费方面，上半年社会消费品零售总额累计同比增长 3.9%，与历史中枢相比增速有所回落。从出口数据来看，海外需求显著修复，在海外库存回补的带动下，出口表现持续好于预期。

上半年海外股票和外需定价商品走强、国内债券利率大幅下行、国内股票和内需定价商品走弱。海外方面，市场围绕 AI 科技创新和全球库存周期回补两条主线展开，在英伟达等龙头公司带动下，纳斯达克指数涨幅靠前；商品市场上，原油、铜等外需定价大宗商品上涨超 10%。

国内金融市场则是债券利率大幅下行，10 年期国债收益率由年初的 2.55% 大幅回落至 2.20% 左右。权益市场情绪偏弱，小盘风格大幅回撤，高股息风格延续了去年的强势，另外由于外需触底改善，出口链相关标的涨幅靠前。在地产和基建双弱的背景下，螺纹钢等内需定价大宗商品价格回落。

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广发证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、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 2024 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.3956 元，本报告期份额净值增长率为 1.20%，同期业绩比较基准增长率 0.00%。本基金本报告期跟踪偏离度为+1.20%，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 2024 下半年，当前 A 股整体估值已处于历史较低水平，这一估值水平反映了市场参与者过于悲观的非理性情绪。从历史经验来看，指数估值越低，后续的预期收益率往往越高。从宏观经济维度看，国内经济复苏仍是影响股市表现的主要因素之一，随着宏观政策效力持续显现，一些经济指标已呈现边际改善迹象，下半年经济基本面会有所改善，为市场信心修复提供有力支撑。另外，随着下半年美联储可能开始降息，权益资产的估值也有望得到提升。

我们将继续有效控制基金的跟踪偏离度和跟踪误差，以实现投资者获取指数投资收益及其他模式盈利的投资目标。同时，我们也将积极争取推动产品的进一步创新，充分发挥指数基金的功能，为各类投资者提供更多、更好的投资机会。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在华夏 MSCI 中国 A 股国际通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 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	9,621,276.08	3,554,435.59
结算备付金		3,414,494.10	1,454,716.15
存出保证金		1,590,152.94	1,645,366.35
交易性金融资产	6.4.7.2	320,142,129.00	326,509,232.86
其中：股票投资		320,142,129.00	326,459,311.24
基金投资		-	-
债券投资		-	49,921.62
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	-	-1,150.82
应收清算款		-	8,908,239.88
应收股利		4,971.80	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	640.92	2,462.95
资产总计		334,773,664.84	342,073,302.96
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		847,488.10	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		139,490.97	143,094.12
应付托管费		27,898.21	28,618.83

应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		109.74	425.01
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	180,676.43	1,235,432.31
负债合计		1,195,663.45	1,407,570.27
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	239,015,418.00	247,015,418.00
未分配利润	6.4.7.8	94,562,583.39	93,650,314.69
净资产合计		333,578,001.39	340,665,732.69
负债和净资产总计		334,773,664.84	342,073,302.96

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.3956 元，基金份额总额 239,015,418.00 份。

6.2 利润表

会计主体：华夏 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
一、营业总收入		5,653,539.69	-1,077,940.07
1.利息收入		90,932.70	57,081.88
其中：存款利息收入	6.4.7.9	49,207.97	54,485.92
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		1,150.82	-
其他利息收入		40,573.91	2,595.96
2.投资收益（损失以“-”填列）		-9,689,100.43	2,361,068.56
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-12,761,524.28	-1,881,636.43
基金投资收益	6.4.7.11	-	-
债券投资收益	6.4.7.12	21,529.06	19,655.91
资产支持证券投资收益	6.4.7.13	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-946,636.41	-10,550.17
股利收益	6.4.7.16	3,997,531.20	4,233,599.25
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	15,244,093.49	-3,505,837.76
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	7,613.93	9,747.25
减：二、营业总支出		1,211,229.99	1,342,307.89
1.管理人报酬		848,840.84	989,327.74

2.托管费		169,768.18	197,865.57
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	6.4.7.20	-	-
7.税金及附加		146.31	9.48
8.其他费用	6.4.7.21	192,474.66	155,105.10
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		4,442,309.70	-2,420,247.96
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		4,442,309.70	-2,420,247.96
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		4,442,309.70	-2,420,247.96

6.3 净资产变动表

会计主体：华夏 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	247,015,418.00	93,650,314.69	340,665,732.69
二、本期期初净资产	247,015,418.00	93,650,314.69	340,665,732.69
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-8,000,000.00	912,268.70	-7,087,731.30
（一）、综合收益总额	-	4,442,309.70	4,442,309.70
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-8,000,000.00	-3,530,041.00	-11,530,041.00
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-8,000,000.00	-3,530,041.00	-11,530,041.00

（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	239,015,418.00	94,562,583.39	333,578,001.39
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	259,015,418.00	135,668,573.93	394,683,991.93
二、本期期初净资产	259,015,418.00	135,668,573.93	394,683,991.93
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-12,000,000.00	-9,570,615.84	-21,570,615.84
（一）、综合收益总额	-	-2,420,247.96	-2,420,247.96
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-12,000,000.00	-7,150,367.88	-19,150,367.88
其中：1.基金申购款	6,000,000.00	3,290,197.38	9,290,197.38
2.基金赎回款	-18,000,000.00	-10,440,565.26	-28,440,565.26
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	247,015,418.00	126,097,958.09	373,113,376.09

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：张佑君，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

原 MSCI 中国 A 股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[2014]870号《关于准予MSCI中国A股交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金注册的批复》，由华夏基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《MSCI中国A股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。本基金自2015年1月19日至2015年2月6日期间共募集4,136,470,618.00元（不含认购资金利息），业经德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）德师报（验）字（15）第0145号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《MSCI中国A股交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于2015年2月12日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为4,136,570,680份基金份额，其中认购资金利息折合100,062份基金份额。

根据原MSCI中国A股交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会审议通过的《关于MSCI中国A股交易型开放式指数证券投资基金变更标的指数并修订基金合同有关事项的议案》以及相关法律法规的规定，并向中国证券监督管理委员会备案，MSCI中国A股交易型开放式指数证券投资基金自2018年9月17日正式变更为华夏MSCI中国A股国际通交易型开放式指数证券投资基金；MSCI中国A股交易型开放式指数证券投资基金联接基金自2018年9月17日正式变更为华夏MSCI中国A股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金，并继续以变更后的华夏MSCI中国A股国际通交易型开放式指数证券投资基金作为目标ETF。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《华夏MSCI中国A股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金合同》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、替代性股票。为更好地实现投资目标，基金还可投资于非成份股、债券（含中小企业私募债券）、股指期货、权证、货币市场工具、国债期货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（但须符合中国证监会相关规定）。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（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

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、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

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

根据财税[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]103 号《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81 号《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]125 号《财政部、国家税务总局、证监会关于内地与香港基金互认有关税收政策的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《财政部、国家税务总局关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《财政部、国家税务总局关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2023]39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》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。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(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 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	9,621,276.08
等于：本金	9,620,359.80
加：应计利息	916.28

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	9,621,276.08

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	369,797,297.97	-	320,142,129.00	-49,655,168.97
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	369,797,297.97	-	320,142,129.00	-49,655,168.97

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

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	13,526,760.00	-	-	-
其中：股指期货	13,526,760.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-

合计	13,526,760.00	-	-	-
----	---------------	---	---	---

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IF2409	沪深 300 期货 IF2409 合约	10	10,270,800.00	-134,760.00
IC2409	中证 500 期货 IC2409 合约	3	2,925,120.00	-196,080.00
合计	-	-	-	-330,840.00
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	-330,840.00
净额	-	-	-	-

注：衍生金融资产项下的利率/权益/其他衍生工具为国债/股指/商品期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指/商品/国债期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指/商品/国债期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 0。

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

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
应收利息	-
其他应收款	640.92
待摊费用	-
合计	640.92

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 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	36,722.22
其中：交易所市场	36,722.22
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	84,535.36
应付指数使用费	59,418.85
合计	180,676.43

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	247,015,418.00	247,015,418.00
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-8,000,000.00	-8,000,000.00
本期末	239,015,418.00	239,015,418.00

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
上年度末	300,716,630.02	-207,066,315.33	93,650,314.69
本期期初	300,716,630.02	-207,066,315.33	93,650,314.69
本期利润	-10,801,783.79	15,244,093.49	4,442,309.70
本期基金份额交易产生的变动数	-9,519,282.70	5,989,241.70	-3,530,041.00
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-9,519,282.70	5,989,241.70	-3,530,041.00
本期已分配利润	-	-	-
本期末	280,395,563.53	-185,832,980.14	94,562,583.39

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
	活期存款利息收入
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	31,715.70
其他	47.58
合计	49,207.97

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-12,270,380.28
股票投资收益——赎回差价收入	-491,144.00
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	-12,761,524.28

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	22,643,218.44
减：卖出股票成本总额	34,880,314.63
减：交易费用	33,284.09
买卖股票差价收入	-12,270,380.28

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	11,530,041.00
减：现金支付赎回款总额	3,931,011.50
减：赎回股票成本总额	8,090,173.50
减：交易费用	-
赎回差价收入	-491,144.00

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 基金投资收益

无。

6.4.7.12 债券投资收益

6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
债券投资收益——利息收入	57.55
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	21,471.51
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	21,529.06

6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	64,623.84
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	43,100.00
减：应计利息总额	49.79
减：交易费用	2.54
买卖债券差价收入	21,471.51

6.4.7.13 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.14 贵金属投资收益

无。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
股指期货投资收益	-946,636.41

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	3,997,531.20
其中：证券出借权益补偿收入	26,959.07
基金投资产生的股利收益	-
合计	3,997,531.20

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
1.交易性金融资产	14,408,233.49
——股票投资	14,418,006.59
——债券投资	-9,773.10
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	835,860.00
——权证投资	-
——期货投资	835,860.00
4.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	15,244,093.49

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	7,613.93
合计	7,613.93

6.4.7.19 持有基金产生的费用

无。

6.4.7.20 信用减值损失

无。

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2024年1月1日至2024年6月30日
审计费用	24,863.02
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行费用	804.67
指数使用费	107,134.63
合计	192,474.66

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
华夏 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金（“华夏 MSCI 中国 A 股国际通 ETF 联接”）	该基金是本基金的联接基金
中信证券股份有限公司（“中信证券”）	基金管理人的股东
中信期货有限公司（“中信期货”）	基金管理人第一大股东的子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
中信证券	3,290,789.73	7.56%	-	-

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
中信证券	53,049.09	82.09%	-	-

6.4.10.1.4 债券回购交易

无。

6.4.10.1.5 基金交易

无。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024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	1,319.07	6.88%	1,319.07	3.59%
关联方名称	上年度可比期间 2023年1月1日至2023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	-	-	-	-

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 2024年1月1日至2024年6月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	848,840.84	989,327.74
其中：应支付销售机构的客户维护费	10,059.66	11,422.99
应支付基金管理人的净管理费	838,781.18	977,904.75

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。

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024年1月1日至2024年6月30日	2023年1月1日至2023年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	169,768.18	197,865.57

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。

6.4.10.2.3 销售服务费

无。

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

单位：人民币元

本期 2024年1月1日至2024年6月30日						
关联方名称	交易金额	费率区间 (%)	加权平均费率 (%)	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
中信证券	29,346,316.07	0.70~5.60	2.25	26,393.90	970,779.80	554.43
上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日						

关联方名称	交易金额	费率区间 (%)	加权平均费率 (%)	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
中信证券	1,192,752.00	1.10~4.10	2.96	2,754.77	667,599.00	2,222.74

注：上年度可比期间数据，按照最新 XBRL 模板要求调整披露信息。

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自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 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 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
华夏 MSCI 中国 A 股国际通 ETF 联接	58,882,700.00	24.64%	60,188,500.00	24.37%
中信证券	686,744.00	0.29%	1,347,444.00	0.55%

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 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023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	9,621,276.08	17,444.69	12,490,440.29	21,555.50

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	688584	上海合晶	新股发行	4,920	111,487.20
中信证券	601033	永兴股份	新股发行	4,571	74,050.20
中信证券	001359	平安电工	新股发行	1,833	31,875.87
上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 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	001286	陕西能源	新股发行	37,667	361,603.20
中信证券	688343	云天励飞	新股发行	5,824	255,790.08
中信证券	688539	高华科技	新股发行	5,280	201,801.60
中信证券	688146	中船特气	新股发行	4,136	149,516.40
中信证券	688522	纳睿雷达	新股发行	2,811	131,217.48
中信证券	688581	安杰思	新股发行	991	124,667.80
中信证券	301439	泓淋电力	新股发行	5,849	116,921.51
中信证券	688523	航天环宇	新股发行	4,717	103,113.62
中信证券	301293	三博脑科	新股发行	3,324	98,390.40
中信证券	601916	浙商银行	配股发行	46,140	93,202.80
中信证券	301323	新莱福	新股发行	2,277	88,939.62
中信证券	301170	锡南科技	新股发行	2,496	84,864.00
中信证券	301157	华塑科技	新股发行	1,498	84,637.00
中信证券	688631	莱斯信息	新股发行	3,228	81,603.84
中信证券	301261	恒工精密	新股发行	1,973	72,803.70
中信证券	601133	柏诚股份	新股发行	4,156	48,458.96
中信证券	603281	江瀚新材	新股发行	863	30,714.17
中信证券	001367	海森药业	新股发行	549	24,419.52
中信证券	001324	长青科技	新股发行	1,131	21,353.28
中信证券	603162	海通发展	新股发行	523	19,481.75

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 2024 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 1,989,658.66 元，占基金资产净值的比例为 0.60%（2023 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 2,208,963.54 元，占基金资产净值的比例为 0.65%）。

于 2024 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 1,446,984.00 元，占基金资产净值的比例为 0.43%（2023 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 1,241,688.00 元，占基金资产净值的比例为 0.36%）。

本基金本报告期通过中信期货买卖期货成交额为 27,363,660.00 元（上年度可比期间：31,272,840.00 元），支付给中信期货的佣金为 670.41 元（上年度可比期间：766.17 元）。

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（2024 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688717	艾罗能源	2023-12-26	6 个月	新发流通受限	55.66	47.02	4,213	234,495.58	198,095.26	-
301589	诺瓦星云	2024-02-01	6 个月	新发流通受限	126.89	188.01	745	52,532.46	140,067.45	含证券送配
688692	达梦数据	2024-06-04	6 个月	新发流通受限	86.96	174.93	126	10,956.96	22,041.18	-
603285	键邦股份	2024-06-28	1 个月内(含)	新发流通受限	18.65	18.65	1,158	21,596.70	21,596.70	-
603350	安乃达	2024-06-26	1 个月内(含)	新发流	20.56	20.56	945	19,429.20	19,429.20	-

				通受限						
301536	星宸科技	2024-03-20	6 个月	新发流通受限	16.16	32.27	481	7,772.96	15,521.87	-
301538	骏鼎达	2024-03-13	6 个月	新发流通受限	55.82	91.24	150	5,972.74	13,686.00	含 证 券 送 配
301565	中仑新材	2024-06-13	6 个月	新发流通受限	11.88	18.98	711	8,446.68	13,494.78	-
688691	灿芯股份	2024-04-02	6 个月	新发流通受限	19.86	42.51	247	4,905.42	10,499.97	-
301566	达利凯普	2023-12-22	6 个月	新发流通受限	8.90	16.97	576	5,126.40	9,774.72	-
301392	汇成真空	2024-05-28	6 个月	新发流通受限	12.20	41.66	219	2,671.80	9,123.54	-
301591	肯特股份	2024-02-20	6 个月	新发流通受	19.43	36.98	219	4,255.17	8,098.62	-

				限						
688584	上海合晶	2024-02-01	6 个月	新发流通受限	22.66	15.89	492	11,148.72	7,817.88	-
603341	龙旗科技	2024-02-23	6 个月	新发流通受限	26.00	37.49	207	5,382.00	7,760.43	-
301587	中瑞股份	2024-03-27	6 个月	新发流通受限	21.73	25.26	306	6,649.38	7,729.56	-
001389	广合科技	2024-03-26	6 个月	新发流通受限	17.43	34.56	222	3,869.46	7,672.32	-
601033	永兴股份	2024-01-11	6 个月	新发流通受限	16.20	15.96	458	7,419.60	7,309.68	-
301539	宏鑫科技	2024-04-03	6 个月	新发流通受限	10.64	19.82	361	3,841.04	7,155.02	-
688695	中创股份	2024-03-06	6 个月	新发流通受限	22.43	31.55	186	4,171.98	5,868.30	-
688530	欧莱	2024-04-29	6 个月	新	9.60	16.10	344	3,302.40	5,538.40	-

	新材			发 流 通 受 限						
301588	美新科技	2024-03-06	6 个月	新发 流 通 受 限	14.50	21.25	257	3,726.50	5,461.25	-
301502	华阳智能	2024-01-26	6 个月	新发 流 通 受 限	28.01	37.83	138	3,865.38	5,220.54	-
001359	平安电工	2024-03-19	6 个月	新发 流 通 受 限	17.39	20.60	184	3,199.76	3,790.40	-
603325	博隆技术	2024-01-03	6 个月	新发 流 通 受 限	72.46	68.06	55	3,985.30	3,743.30	-
603381	永臻股份	2024-06-19	6 个月	新发 流 通 受 限	23.35	25.13	146	3,409.10	3,668.98	-
603312	西典新能	2024-01-04	6 个月	新发 流 通 受 限	29.02	25.36	127	3,685.54	3,220.72	-
603082	北自科技	2024-01-23	6 个月	新发 流 通 受 限	21.28	29.49	107	2,276.96	3,155.43	-

				通受限						
001379	腾达科技	2024-01-11	6 个月	新发流通受限	16.98	13.48	213	3,616.74	2,871.24	-
603375	盛景微	2024-01-17	6 个月	新发流通受限	38.18	38.90	72	2,748.96	2,800.80	-
603285	键邦股份	2024-06-28	6 个月	新发流通受限	18.65	18.65	129	2,405.85	2,405.85	-
603350	安乃达	2024-06-26	6 个月	新发流通受限	20.56	20.56	106	2,179.36	2,179.36	-

注：①根据中国证监会《上市公司证券发行注册管理办法》，基金参与上市公司向特定对象发行股票所获得的股票，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。

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

③根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

④基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的设定限售期的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	出借到期日	期末估值 单价	数量（股）	期末估值总额
1	600522	中天科技	2024年7月1日 -2024年7月9日	15.85	4,500.00	71,325.00
2	600487	亨通光电	2024年7月1日 -2024年7月1日	15.77	4,300.00	67,811.00
3	603260	合盛硅业	2024年7月9日 -2024年7月9日	46.71	1,400.00	65,394.00
4	600096	云天化	2024年7月1日 -2024年7月1日	19.42	3,200.00	62,144.00
5	600060	海信视像	2024年7月1日 -2024年7月1日	24.74	2,300.00	56,902.00
6	301236	软通动力	2024年7月9日 -2024年7月9日	35.21	1,600.00	56,336.00
7	600733	北汽蓝谷	2024年7月2日 -2024年7月2日	8.08	6,800.00	54,944.00
8	600895	张江高科	2024年7月9日 -2024年7月9日	18.48	2,700.00	49,896.00
9	600021	上海电力	2024年7月1日 -2024年7月1日	9.89	5,000.00	49,450.00
10	000408	藏格矿业	2024年7月9日 -2024年7月9日	24.07	2,000.00	48,140.00
11	601991	大唐发电	2024年7月2日 -2024年7月2日	3.01	15,600.00	46,956.00
12	000738	航发控制	2024年7月1日 -2024年7月1日	20.07	2,300.00	46,161.00
13	000703	恒逸石化	2024年7月9日 -2024年7月9日	7.09	6,500.00	46,085.00
14	000683	远兴能源	2024年7月1日 -2024年7月1日	6.91	6,400.00	44,224.00
15	603529	爱玛科技	2024年7月2日 -2024年7月2日	27.33	1,500.00	40,995.00
16	600511	国药股份	2024年7月1日	30.79	1,300.00	40,027.00

			-2024 年 7 月 1 日			
17	600378	昊华科技	2024 年 7 月 1 日 -2024 年 7 月 1 日	28.90	1,300.00	37,570.00
18	600839	四川长虹	2024 年 7 月 1 日 -2024 年 7 月 9 日	4.49	8,200.00	36,818.00
19	600348	华阳股份	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	9.96	3,300.00	32,868.00
20	600166	福田汽车	2024 年 7 月 1 日 -2024 年 7 月 1 日	2.25	14,200.00	31,950.00
21	600256	广汇能源	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	6.70	4,200.00	28,140.00
22	601633	长城汽车	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	25.30	1,000.00	25,300.00
23	600521	华海药业	2024 年 7 月 1 日 -2024 年 7 月 1 日	17.05	1,400.00	23,870.00
24	600546	山煤国际	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	14.62	1,500.00	21,930.00
25	601168	西部矿业	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	17.95	1,000.00	17,950.00
26	600153	建发股份	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	8.93	2,000.00	17,860.00
27	601117	中国化学	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	8.24	2,000.00	16,480.00
28	600026	中远海能	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	15.61	1,000.00	15,610.00
29	600977	中国电影	2024 年 7 月 1 日 -2024 年 7 月 1 日	10.76	1,200.00	12,912.00
30	600221	海航控股	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	1.02	8,200.00	8,364.00
31	600027	华电国际	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	6.94	1,000.00	6,940.00
32	601880	辽港股份	2024 年 7 月 1 日 -2024 年 7 月 1 日	1.23	3,400.00	4,182.00
合计	-	-	-	-	122,300.00	1,185,534.00

注：出借证券中如有其他流通受限的情况详见本报告“本基金持有的流通受限证券”部分内容。

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。本基金持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

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 2024年6月30日		上年度末 2023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	320,142,129.00	95.97	326,459,311.24	95.83
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	49,921.62	0.01
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	320,142,129.00	95.97	326,509,232.86	95.84

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 MSCI 中国 A 股国际通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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
	-5%	-15,237,273.16	-16,198,246.52
	+5%	15,237,273.16	16,198,246.52

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 2024 年 6 月 30 日
第一层次	319,575,104.97
第二层次	45,611.11
第三层次	521,412.92
合计	320,142,129.00

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。本基金政策以导致各层次之间转换的事项发生日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 2024 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	320,142,129.00	95.63
	其中：股票	320,142,129.00	95.63
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	13,035,770.18	3.89
8	其他各项资产	1,595,765.66	0.48
9	合计	334,773,664.84	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报告期末,本基金参与转融通证券出借业务借出股票的公允价值为 1,185,534.00 元, 占本基金期末资产净值的 0.36%。

7.2 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	3,498,128.32	1.05
B	采矿业	21,100,202.37	6.33
C	制造业	171,327,827.77	51.36
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	16,853,152.32	5.05
E	建筑业	6,725,536.17	2.02
F	批发和零售业	2,127,777.80	0.64
G	交通运输、仓储和邮政业	13,467,108.19	4.04
H	住宿和餐饮业	186,138.00	0.06
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,446,621.86	3.43
J	金融业	64,070,806.65	19.21
K	房地产业	3,015,076.76	0.90
L	租赁和商务服务业	2,471,321.59	0.74

M	科学研究和技术服务业	1,300,169.82	0.39
N	水利、环境和公共设施管理业	320,475.54	0.10
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	972,533.04	0.29
R	文化、体育和娱乐业	1,069,876.80	0.32
S	综合	189,376.00	0.06
	合计	320,142,129.00	95.97

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	600519	贵州茅台	11,174	16,396,615.86	4.92
2	300750	宁德时代	39,200	7,057,176.00	2.12
3	600900	长江电力	218,146	6,308,782.32	1.89
4	600036	招商银行	183,852	6,285,899.88	1.88
5	000858	五粮液	34,629	4,433,897.16	1.33
6	002594	比亚迪	16,190	4,051,547.50	1.21
7	601318	中国平安	95,940	3,968,078.40	1.19
8	601288	农业银行	758,900	3,308,804.00	0.99
9	601166	兴业银行	185,216	3,263,505.92	0.98
10	601138	工业富联	118,100	3,235,940.00	0.97
11	601899	紫金矿业	183,500	3,224,095.00	0.97
12	601398	工商银行	560,800	3,196,560.00	0.96
13	300760	迈瑞医疗	10,800	3,141,828.00	0.94
14	601328	交通银行	349,900	2,613,753.00	0.78
15	601088	中国神华	58,852	2,611,263.24	0.78
16	002475	立讯精密	63,983	2,515,171.73	0.75
17	601816	京沪高铁	437,800	2,350,986.00	0.70
18	600809	山西汾酒	10,874	2,293,109.12	0.69
19	600309	万华化学	28,000	2,264,080.00	0.68
20	601225	陕西煤业	86,469	2,228,306.13	0.67
21	600276	恒瑞医药	56,895	2,188,181.70	0.66
22	600000	浦发银行	261,648	2,153,363.04	0.65
23	002714	牧原股份	48,760	2,125,936.00	0.64
24	000333	美的集团	31,100	2,005,950.00	0.60
25	600030	中信证券	109,142	1,989,658.66	0.60
26	601857	中国石油	192,500	1,986,600.00	0.60
27	601668	中国建筑	371,027	1,970,153.37	0.59
28	000568	泸州老窖	13,129	1,883,880.21	0.56
29	600028	中国石化	289,300	1,828,376.00	0.55
30	601985	中国核电	168,300	1,794,078.00	0.54

31	600406	国电南瑞	71,633	1,787,959.68	0.54
32	601919	中远海控	113,750	1,761,987.50	0.53
33	000001	平安银行	172,988	1,755,828.20	0.53
34	601601	中国太保	61,042	1,700,630.12	0.51
35	601766	中国中车	216,900	1,628,919.00	0.49
36	600150	中国船舶	39,900	1,624,329.00	0.49
37	600690	海尔智家	56,268	1,596,885.84	0.48
38	002352	顺丰控股	43,600	1,556,084.00	0.47
39	002371	北方华创	4,700	1,503,483.00	0.45
40	300059	东方财富	140,757	1,486,393.92	0.45
41	600887	伊利股份	56,716	1,465,541.44	0.44
42	688041	海光信息	20,805	1,463,007.60	0.44
43	601988	中国银行	313,200	1,446,984.00	0.43
44	603288	海天味业	41,304	1,423,748.88	0.43
45	300308	中际旭创	10,046	1,385,142.48	0.42
46	000725	京东方 A	329,450	1,347,450.50	0.40
47	603993	洛阳钼业	157,500	1,338,750.00	0.40
48	600050	中国联通	283,500	1,332,450.00	0.40
49	601658	邮储银行	259,200	1,314,144.00	0.39
50	601818	光大银行	413,700	1,311,429.00	0.39
51	600019	宝钢股份	197,206	1,311,419.90	0.39
52	002142	宁波银行	58,899	1,299,311.94	0.39
53	600031	三一重工	75,659	1,248,373.50	0.37
54	601127	赛力斯	13,500	1,230,120.00	0.37
55	600919	江苏银行	163,571	1,215,332.53	0.36
56	600886	国投电力	66,500	1,212,960.00	0.36
57	600016	民生银行	316,124	1,198,109.96	0.36
58	601390	中国中铁	183,170	1,194,268.40	0.36
59	300498	温氏股份	59,276	1,174,850.32	0.35
60	300274	阳光电源	18,540	1,150,036.20	0.34
61	600989	宝丰能源	65,400	1,133,382.00	0.34
62	601006	大秦铁路	156,600	1,121,256.00	0.34
63	600436	片仔癀	5,391	1,116,853.47	0.33
64	600905	三峡能源	255,100	1,112,236.00	0.33
65	601169	北京银行	188,462	1,100,618.08	0.33
66	601888	中国中免	17,436	1,089,575.64	0.33
67	002304	洋河股份	13,433	1,084,580.42	0.33
68	603501	韦尔股份	10,805	1,073,692.85	0.32
69	000063	中兴通讯	35,900	1,004,123.00	0.30
70	000625	长安汽车	73,821	991,416.03	0.30
71	000651	格力电器	25,100	984,422.00	0.30
72	000338	潍柴动力	60,500	982,520.00	0.29
73	601009	南京银行	92,250	958,477.50	0.29

74	600104	上汽集团	68,762	953,041.32	0.29
75	688111	金山办公	4,189	952,997.50	0.29
76	600795	国电电力	159,000	952,410.00	0.29
77	601012	隆基绿能	67,534	946,826.68	0.28
78	600048	保利发展	106,760	935,217.60	0.28
79	600999	招商证券	66,197	920,800.27	0.28
80	601229	上海银行	126,661	919,558.86	0.28
81	601211	国泰君安	67,000	907,850.00	0.27
82	601600	中国铝业	117,800	898,814.00	0.27
83	603259	药明康德	22,728	890,710.32	0.27
84	002230	科大讯飞	20,611	885,242.45	0.27
85	600547	山东黄金	32,263	883,360.94	0.26
86	600346	恒力石化	62,740	875,223.00	0.26
87	002493	荣盛石化	90,225	871,573.50	0.26
88	600893	航发动力	23,772	868,866.60	0.26
89	000166	申万宏源	200,941	866,055.71	0.26
90	601669	中国电建	153,600	858,624.00	0.26
91	300015	爱尔眼科	83,172	858,335.04	0.26
92	600660	福耀玻璃	17,900	857,410.00	0.26
93	000792	盐湖股份	48,400	844,580.00	0.25
94	600585	海螺水泥	35,670	841,455.30	0.25
95	002938	鹏鼎控股	20,700	823,032.00	0.25
96	000538	云南白药	16,028	819,832.20	0.25
97	600674	川投能源	43,464	814,950.00	0.24
98	300433	蓝思科技	44,400	810,300.00	0.24
99	601688	华泰证券	65,200	807,828.00	0.24
100	688271	联影医疗	7,254	795,763.80	0.24
101	688012	中微公司	5,604	791,621.04	0.24
102	600011	华能国际	81,700	785,954.00	0.24
103	002027	分众传媒	128,740	780,164.40	0.23
104	688036	传音控股	10,139	776,039.06	0.23
105	600188	兖矿能源	34,100	775,093.00	0.23
106	601628	中国人寿	24,760	768,798.00	0.23
107	600438	通威股份	40,100	766,311.00	0.23
108	601111	中国国航	103,800	766,044.00	0.23
109	000596	古井贡酒	3,600	759,852.00	0.23
110	600015	华夏银行	118,248	756,787.20	0.23
111	000425	徐工机械	105,300	752,895.00	0.23
112	601066	中信建投	38,600	742,664.00	0.22
113	600837	海通证券	86,036	736,468.16	0.22
114	000895	双汇发展	30,850	733,304.50	0.22
115	300014	亿纬锂能	18,273	729,458.16	0.22
116	000100	TCL 科技	167,410	723,211.20	0.22

117	688256	寒武纪	3,624	719,980.08	0.22
118	001979	招商蛇口	80,761	709,889.19	0.21
119	600023	浙能电力	99,600	708,156.00	0.21
120	601881	中国银河	64,600	701,556.00	0.21
121	002311	海大集团	14,800	696,340.00	0.21
122	600926	杭州银行	52,820	689,301.00	0.21
123	300502	新易盛	6,300	664,965.00	0.20
124	003816	中国广核	140,300	649,589.00	0.19
125	605499	东鹏饮料	3,000	647,250.00	0.19
126	601995	中金公司	21,751	644,047.11	0.19
127	000776	广发证券	52,800	642,576.00	0.19
128	600489	中金黄金	43,200	639,360.00	0.19
129	601939	建设银行	85,547	633,047.80	0.19
130	600089	特变电工	45,063	625,023.81	0.19
131	603392	万泰生物	9,444	622,170.72	0.19
132	002463	沪电股份	17,002	620,573.00	0.19
133	600845	宝信软件	19,243	614,428.99	0.18
134	601872	招商轮船	72,600	613,470.00	0.18
135	601868	中国能建	289,100	612,892.00	0.18
136	600115	中国东航	152,576	611,829.76	0.18
137	300124	汇川技术	11,900	610,470.00	0.18
138	000002	万科 A	86,689	600,754.77	0.18
139	300122	智飞生物	21,350	598,440.50	0.18
140	002241	歌尔股份	30,420	593,494.20	0.18
141	600029	南方航空	100,100	589,589.00	0.18
142	688008	澜起科技	10,221	584,232.36	0.18
143	600160	巨化股份	24,100	581,533.00	0.17
144	601825	沪农商行	86,000	577,920.00	0.17
145	000938	紫光股份	25,495	569,813.25	0.17
146	601901	方正证券	73,400	567,382.00	0.17
147	600010	包钢股份	404,806	566,728.40	0.17
148	603986	兆易创新	5,900	564,158.00	0.17
149	601633	长城汽车	22,200	561,660.00	0.17
150	601336	新华保险	18,600	558,558.00	0.17
151	601689	拓普集团	10,400	557,544.00	0.17
152	601100	恒立液压	11,920	555,233.60	0.17
153	600111	北方稀土	32,227	554,304.40	0.17
154	002648	卫星化学	30,036	540,047.28	0.16
155	601916	浙商银行	192,040	530,030.40	0.16
156	002001	新和成	27,552	528,998.40	0.16
157	688223	晶科能源	74,327	527,721.70	0.16
158	600027	华电国际	75,900	526,746.00	0.16
159	600703	三安光电	44,500	521,540.00	0.16

160	000983	山西焦煤	50,568	521,356.08	0.16
161	603369	今世缘	11,200	517,440.00	0.16
162	601838	成都银行	34,000	516,460.00	0.15
163	600039	四川路桥	64,780	511,114.20	0.15
164	601788	光大证券	34,800	508,776.00	0.15
165	600066	宇通客车	19,700	508,260.00	0.15
166	600958	东方证券	66,556	505,825.60	0.15
167	600426	华鲁恒升	18,964	505,200.96	0.15
168	600584	长电科技	15,900	504,189.00	0.15
169	300408	三环集团	17,120	499,732.80	0.15
170	300033	同花顺	4,800	497,760.00	0.15
171	002736	国信证券	57,095	496,155.55	0.15
172	601618	中国中冶	159,142	493,340.20	0.15
173	601021	春秋航空	8,700	490,071.00	0.15
174	601360	三六零	63,680	489,062.40	0.15
175	000157	中联重科	63,300	486,144.00	0.15
176	000999	华润三九	11,410	485,837.80	0.15
177	002916	深南电路	4,580	484,426.60	0.15
178	600026	中远海能	31,000	483,910.00	0.15
179	601699	潞安环能	26,660	483,345.80	0.14
180	600522	中天科技	30,400	481,840.00	0.14
181	001965	招商公路	40,578	481,255.08	0.14
182	600233	圆通速递	30,700	480,455.00	0.14
183	600803	新奥股份	23,000	478,400.00	0.14
184	000977	浪潮信息	13,140	477,901.80	0.14
185	601607	上海医药	24,866	475,189.26	0.14
186	300832	新产业	7,000	472,080.00	0.14
187	000301	东方盛虹	58,900	469,433.00	0.14
188	688169	石头科技	1,191	467,586.60	0.14
189	600085	同仁堂	12,200	466,162.00	0.14
190	002252	上海莱士	59,200	462,944.00	0.14
191	002028	思源电气	6,900	461,610.00	0.14
192	600741	华域汽车	28,083	459,999.54	0.14
193	300896	爱美客	2,660	457,786.00	0.14
194	600875	东方电气	24,800	457,560.00	0.14
195	600600	青岛啤酒	6,286	457,432.22	0.14
196	002236	大华股份	29,350	453,751.00	0.14
197	601117	中国化学	54,500	449,080.00	0.13
198	000786	北新建材	15,100	447,866.00	0.13
199	002600	领益智造	62,500	445,000.00	0.13
200	603195	公牛集团	5,755	443,825.60	0.13
201	688396	华润微	11,819	442,503.36	0.13
202	600183	生益科技	21,000	442,260.00	0.13

203	601567	三星医疗	12,600	441,000.00	0.13
204	600362	江西铜业	18,464	437,227.52	0.13
205	000963	华东医药	15,689	436,311.09	0.13
206	601319	中国人保	84,400	434,660.00	0.13
207	300394	天孚通信	4,900	433,258.00	0.13
208	002422	科伦药业	14,244	432,020.52	0.13
209	600161	天坛生物	17,620	429,928.00	0.13
210	002920	德赛西威	4,900	426,741.00	0.13
211	002128	电投能源	20,000	422,000.00	0.13
212	600196	复星医药	18,921	418,910.94	0.13
213	000807	云铝股份	30,900	417,459.00	0.13
214	601727	上海电气	112,800	417,360.00	0.13
215	300628	亿联网络	11,310	415,868.70	0.12
216	000617	中油资本	75,100	414,552.00	0.12
217	002460	赣锋锂业	14,380	411,987.00	0.12
218	601058	赛轮轮胎	29,300	410,200.00	0.12
219	000630	铜陵有色	112,890	407,532.90	0.12
220	000708	中信特钢	30,000	407,100.00	0.12
221	000933	神火股份	20,100	406,623.00	0.12
222	000975	银泰黄金	24,720	402,688.80	0.12
223	600985	淮北矿业	24,000	401,760.00	0.12
224	600733	北汽蓝谷	49,700	401,576.00	0.12
225	002049	紫光国微	7,620	400,812.00	0.12
226	600219	南山铝业	104,400	397,764.00	0.12
227	605117	德业股份	5,348	397,570.32	0.12
228	300999	金龙鱼	14,480	396,028.00	0.12
229	601077	渝农商行	78,800	395,576.00	0.12
230	002601	龙佰集团	21,300	395,541.00	0.12
231	600398	海澜之家	42,800	395,472.00	0.12
232	002466	天齐锂业	13,200	394,812.00	0.12
233	600176	中国巨石	35,723	394,739.15	0.12
234	600221	海航控股	385,300	393,006.00	0.12
235	600256	广汇能源	58,500	391,950.00	0.12
236	601377	兴业证券	77,000	389,620.00	0.12
237	600642	申能股份	43,600	384,988.00	0.12
238	688009	中国通号	64,068	384,408.00	0.12
239	601168	西部矿业	21,200	380,540.00	0.11
240	300782	卓胜微	4,808	373,773.92	0.11
241	601878	浙商证券	34,600	370,912.00	0.11
242	000876	新希望	40,500	370,170.00	0.11
243	600332	白云山	12,537	367,710.21	0.11
244	601179	中国西电	45,700	367,428.00	0.11
245	601877	正泰电器	19,120	364,427.20	0.11

246	600415	小商品城	48,900	362,838.00	0.11
247	600018	上港集团	62,300	360,094.00	0.11
248	000423	东阿阿胶	5,734	358,948.40	0.11
249	600009	上海机场	11,049	356,330.25	0.11
250	600918	中泰证券	62,100	352,107.00	0.11
251	300418	昆仑万维	10,800	348,192.00	0.10
252	300661	圣邦股份	4,206	348,172.68	0.10
253	300413	芒果超媒	16,630	347,567.00	0.10
254	002078	太阳纸业	24,900	347,355.00	0.10
255	600487	亨通光电	22,000	346,940.00	0.10
256	601233	桐昆股份	21,500	343,140.00	0.10
257	603806	福斯特	23,273	342,113.10	0.10
258	601865	福莱特	17,000	341,700.00	0.10
259	601238	广汽集团	43,900	339,786.00	0.10
260	000408	藏格矿业	14,100	339,387.00	0.10
261	603198	迎驾贡酒	5,900	339,250.00	0.10
262	688126	沪硅产业	24,517	338,579.77	0.10
263	002532	天山铝业	41,500	336,565.00	0.10
264	603799	华友钴业	15,203	336,442.39	0.10
265	002223	鱼跃医疗	8,900	334,640.00	0.10
266	300316	晶盛机电	11,638	334,359.74	0.10
267	300866	安克创新	4,680	333,262.80	0.10
268	002625	光启技术	19,200	333,120.00	0.10
269	002180	纳思达	12,600	332,892.00	0.10
270	601991	大唐发电	110,500	332,605.00	0.10
271	688188	柏楚电子	1,796	331,451.80	0.10
272	002459	晶澳科技	29,524	330,668.80	0.10
273	000661	长春高新	3,600	330,372.00	0.10
274	688599	天合光能	19,332	327,097.44	0.10
275	603260	合盛硅业	7,000	326,970.00	0.10
276	688303	大全能源	15,932	324,853.48	0.10
277	600061	国投资本	57,300	323,745.00	0.10
278	600348	华阳股份	32,150	320,214.00	0.10
279	600515	海南机场	101,900	319,966.00	0.10
280	002353	杰瑞股份	9,100	319,228.00	0.10
281	600096	云天化	16,400	318,488.00	0.10
282	002064	华峰化学	44,200	316,914.00	0.10
283	300765	新诺威	12,560	316,888.80	0.09
284	002050	三花智控	16,600	316,728.00	0.09
285	002384	东山精密	15,200	314,640.00	0.09
286	688187	时代电气	6,359	314,007.42	0.09
287	600745	闻泰科技	11,100	313,575.00	0.09
288	603568	伟明环保	15,217	313,165.86	0.09

289	002129	TCL 中环	36,025	311,616.25	0.09
290	000027	深圳能源	42,370	309,301.00	0.09
291	600418	江淮汽车	19,500	308,880.00	0.09
292	300442	润泽科技	12,800	306,560.00	0.09
293	600588	用友网络	30,475	304,750.00	0.09
294	002074	国轩高科	15,900	304,485.00	0.09
295	002156	通富微电	13,500	302,265.00	0.09
296	688072	拓荆科技	2,504	300,755.44	0.09
297	002709	天赐材料	17,120	300,627.20	0.09
298	601958	金铂股份	28,800	299,808.00	0.09
299	301236	软通动力	8,500	299,285.00	0.09
300	600570	恒生电子	16,925	298,895.50	0.09
301	603606	东方电缆	6,100	297,741.00	0.09
302	300751	迈为股份	2,488	297,266.24	0.09
303	600177	雅戈尔	41,300	294,056.00	0.09
304	601577	长沙银行	35,900	293,662.00	0.09
305	002340	格林美	45,800	291,746.00	0.09
306	600060	海信视像	11,600	286,984.00	0.09
307	600970	中材国际	23,600	284,616.00	0.09
308	603160	汇顶科技	4,100	281,875.00	0.08
309	601799	星宇股份	2,500	280,100.00	0.08
310	603979	金诚信	5,500	277,915.00	0.08
311	601216	君正集团	75,200	277,488.00	0.08
312	002812	恩捷股份	8,700	275,355.00	0.08
313	600282	南钢股份	55,000	273,900.00	0.08
314	601108	财通证券	41,400	273,654.00	0.08
315	000932	华菱钢铁	61,600	272,888.00	0.08
316	002595	豪迈科技	7,100	271,007.00	0.08
317	603338	浙江鼎力	4,482	270,802.44	0.08
318	603659	璞泰来	19,101	269,897.13	0.08
319	000988	华工科技	9,000	269,370.00	0.08
320	688777	中控技术	7,117	268,310.90	0.08
321	000921	海信家电	8,300	267,592.00	0.08
322	600038	中直股份	6,500	267,215.00	0.08
323	603939	益丰药房	10,824	265,729.20	0.08
324	002294	信立泰	9,965	265,367.95	0.08
325	002281	光迅科技	7,100	265,327.00	0.08
326	688120	华海清科	1,399	265,222.42	0.08
327	002444	巨星科技	10,700	264,290.00	0.08
328	002409	雅克科技	4,200	264,222.00	0.08
329	601231	环旭电子	16,400	263,220.00	0.08
330	600873	梅花生物	26,200	262,524.00	0.08
331	601555	东吴证券	44,295	261,340.50	0.08

332	600132	重庆啤酒	4,300	261,010.00	0.08
333	600566	济川药业	8,200	260,022.00	0.08
334	603899	晨光股份	8,300	259,624.00	0.08
335	600460	士兰微	14,800	259,148.00	0.08
336	600546	山煤国际	17,700	258,774.00	0.08
337	002555	三七互娱	19,800	258,390.00	0.08
338	300919	中伟股份	8,320	257,836.80	0.08
339	002007	华兰生物	16,290	257,219.10	0.08
340	600895	张江高科	13,800	255,024.00	0.08
341	600582	天地科技	36,900	254,241.00	0.08
342	601990	南京证券	32,900	252,672.00	0.08
343	000066	中国长城	28,800	252,000.00	0.08
344	300207	欣旺达	16,600	251,822.00	0.08
345	600079	人福医药	14,600	250,682.00	0.08
346	002085	万丰奥威	18,900	250,236.00	0.08
347	600109	国金证券	33,100	249,905.00	0.07
348	300003	乐普医疗	16,800	249,312.00	0.07
349	600352	浙江龙盛	29,000	249,110.00	0.07
350	600968	海油发展	60,400	248,848.00	0.07
351	601928	凤凰传媒	22,700	248,792.00	0.07
352	600021	上海电力	25,100	248,239.00	0.07
353	601666	平煤股份	22,100	247,520.00	0.07
354	688363	华熙生物	4,369	247,154.33	0.07
355	300759	康龙化成	13,275	246,649.50	0.07
356	002673	西部证券	39,832	246,560.08	0.07
357	301269	华大九天	3,200	246,560.00	0.07
358	002966	苏州银行	32,700	245,250.00	0.07
359	603833	欧派家居	4,560	244,233.60	0.07
360	600497	驰宏锌锗	45,400	242,436.00	0.07
361	600988	赤峰黄金	14,800	241,832.00	0.07
362	002939	长城证券	36,000	241,200.00	0.07
363	601966	玲珑轮胎	13,115	240,922.55	0.07
364	000831	中国稀土	9,500	240,825.00	0.07
365	603486	科沃斯	5,100	240,618.00	0.07
366	002032	苏泊尔	4,800	240,480.00	0.07
367	603156	养元饮品	11,300	240,351.00	0.07
368	603658	安图生物	5,200	239,564.00	0.07
369	600153	建发股份	26,735	238,743.55	0.07
370	300223	北京君正	4,300	238,392.00	0.07
371	000783	长江证券	49,334	238,283.22	0.07
372	603816	顾家家居	7,350	237,331.50	0.07
373	000728	国元证券	38,860	235,491.60	0.07
374	000738	航发控制	11,700	234,819.00	0.07

375	002739	万达电影	19,400	234,546.00	0.07
376	600157	永泰能源	198,100	233,758.00	0.07
377	002185	华天科技	28,600	233,090.00	0.07
378	688065	凯赛生物	5,134	233,032.26	0.07
379	600583	海油工程	39,418	232,960.38	0.07
380	688728	格科微	19,225	232,814.75	0.07
381	000703	恒逸石化	32,650	231,488.50	0.07
382	002152	广电运通	22,100	231,166.00	0.07
383	600536	中国软件	7,700	230,384.00	0.07
384	000683	远兴能源	33,300	230,103.00	0.07
385	002465	海格通信	22,148	229,453.28	0.07
386	601198	东兴证券	28,800	229,248.00	0.07
387	002603	以岭药业	14,940	229,030.20	0.07
388	002602	世纪华通	66,480	228,026.40	0.07
389	601866	中远海发	88,300	227,814.00	0.07
390	000960	锡业股份	14,700	227,703.00	0.07
391	002456	欧菲光	29,000	226,490.00	0.07
392	600521	华海药业	13,260	226,083.00	0.07
393	601696	中银证券	24,800	225,184.00	0.07
394	002414	高德红外	38,085	224,320.65	0.07
395	000729	燕京啤酒	25,100	221,633.00	0.07
396	300251	光线传媒	26,200	220,342.00	0.07
397	688099	晶晨股份	3,714	220,314.48	0.07
398	600998	九州通	44,915	219,185.20	0.07
399	002372	伟星新材	14,200	218,964.00	0.07
400	603893	瑞芯微	3,700	218,929.00	0.07
401	688122	西部超导	5,700	218,424.00	0.07
402	600549	厦门钨业	12,600	217,350.00	0.07
403	603885	吉祥航空	19,700	216,503.00	0.06
404	000800	一汽解放	27,600	216,108.00	0.06
405	688082	盛美上海	2,557	216,092.07	0.06
406	600298	安琪酵母	7,700	215,061.00	0.06
407	002262	恩华药业	9,000	213,660.00	0.06
408	002831	裕同科技	8,300	212,397.00	0.06
409	600369	西南证券	59,200	211,936.00	0.06
410	000937	冀中能源	31,500	211,050.00	0.06
411	603596	伯特利	5,420	210,838.00	0.06
412	603529	爱玛科技	7,700	210,441.00	0.06
413	603589	口子窖	5,300	207,707.00	0.06
414	000629	钒钛股份	82,900	207,250.00	0.06
415	002202	金风科技	30,784	206,868.48	0.06
416	601880	辽港股份	167,800	206,394.00	0.06
417	600511	国药股份	6,700	206,293.00	0.06

418	300146	汤臣倍健	15,200	205,960.00	0.06
419	600486	扬农化工	3,640	205,478.00	0.06
420	601456	国联证券	21,300	205,332.00	0.06
421	000513	丽珠集团	5,500	204,655.00	0.06
422	688538	和辉光电	102,941	203,823.18	0.06
423	000733	振华科技	4,900	203,497.00	0.06
424	002821	凯莱英	3,080	202,664.00	0.06
425	600704	物产中大	46,300	200,942.00	0.06
426	600004	白云机场	21,100	200,028.00	0.06
427	002120	韵达股份	25,840	200,001.60	0.06
428	688717	艾罗能源	4,213	198,095.26	0.06
429	603000	人民网	9,900	197,901.00	0.06
430	000009	中国宝安	23,000	197,800.00	0.06
431	600598	北大荒	15,800	197,342.00	0.06
432	600378	昊华科技	6,800	196,520.00	0.06
433	002430	杭氧股份	8,800	195,800.00	0.06
434	600848	上海临港	21,320	194,225.20	0.06
435	603345	安井食品	2,600	193,206.00	0.06
436	002080	中材科技	14,930	192,597.00	0.06
437	300037	新宙邦	6,700	191,352.00	0.06
438	002797	第一创业	37,500	190,875.00	0.06
439	300487	蓝晓科技	4,550	190,008.00	0.06
440	600673	东阳光	26,900	189,376.00	0.06
441	002508	老板电器	8,498	187,805.80	0.06
442	300144	宋城演艺	23,360	187,580.80	0.06
443	300454	深信服	3,700	186,961.00	0.06
444	300496	中科创达	4,097	186,782.23	0.06
445	600699	均胜电子	12,579	186,420.78	0.06
446	600754	锦江酒店	8,100	186,138.00	0.06
447	002841	视源股份	6,300	186,039.00	0.06
448	600380	健康元	16,600	185,422.00	0.06
449	000987	越秀资本	37,312	185,067.52	0.06
450	600839	四川长虹	41,200	184,988.00	0.06
451	300699	光威复材	7,400	183,742.00	0.06
452	000723	美锦能源	38,600	183,736.00	0.06
453	300957	贝泰妮	3,800	183,616.00	0.06
454	002517	恺英网络	19,200	183,360.00	0.05
455	002850	科达利	2,400	183,312.00	0.05
456	600637	东方明珠	30,000	182,400.00	0.05
457	600072	中船科技	13,400	181,168.00	0.05
458	603290	斯达半导	2,100	180,831.00	0.05
459	002056	横店东磁	14,500	180,815.00	0.05
460	600655	豫园股份	34,729	178,854.35	0.05

461	000709	河钢股份	92,123	178,718.62	0.05
462	600977	中国电影	16,600	178,616.00	0.05
463	688114	华大智造	3,712	175,985.92	0.05
464	600705	中航产融	78,636	174,571.92	0.05
465	002738	中矿资源	6,460	173,128.00	0.05
466	000825	太钢不锈	51,000	172,380.00	0.05
467	002756	永兴材料	4,800	171,744.00	0.05
468	600170	上海建工	79,200	170,280.00	0.05
469	600702	舍得酒业	3,000	170,010.00	0.05
470	601162	天风证券	77,300	168,514.00	0.05
471	600779	水井坊	4,400	165,572.00	0.05
472	600884	杉杉股份	20,100	163,212.00	0.05
473	300142	沃森生物	14,317	162,927.46	0.05
474	300347	泰格医药	3,350	162,810.00	0.05
475	600166	福田汽车	71,400	160,650.00	0.05
476	600872	中炬高新	7,000	158,830.00	0.05
477	300601	康泰生物	9,940	155,163.40	0.05
478	600563	法拉电子	2,000	152,360.00	0.05
479	300763	锦浪科技	3,600	149,904.00	0.04
480	603728	鸣志电器	3,700	148,851.00	0.04
481	600732	爱旭股份	16,300	147,515.00	0.04
482	603233	大参林	10,159	145,273.70	0.04
483	603688	石英股份	4,800	142,128.00	0.04
484	301589	诺瓦星云	745	140,067.45	0.04
485	002271	东方雨虹	11,200	138,208.00	0.04
486	603077	和邦生物	78,700	129,855.00	0.04
487	603882	金域医学	4,200	114,198.00	0.03
488	603285	键邦股份	1,287	24,002.55	0.01
489	688692	达梦数据	126	22,041.18	0.01
490	603350	安乃达	1,051	21,608.56	0.01
491	301536	星宸科技	481	15,521.87	0.00
492	301538	骏鼎达	150	13,686.00	0.00
493	301565	中仑新材	711	13,494.78	0.00
494	688691	灿芯股份	247	10,499.97	0.00
495	301566	达利凯普	576	9,774.72	0.00
496	301392	汇成真空	219	9,123.54	0.00
497	301591	肯特股份	219	8,098.62	0.00
498	688584	上海合晶	492	7,817.88	0.00
499	603341	龙旗科技	207	7,760.43	0.00
500	301587	中瑞股份	306	7,729.56	0.00
501	001389	广合科技	222	7,672.32	0.00
502	601033	永兴股份	458	7,309.68	0.00
503	301539	宏鑫科技	361	7,155.02	0.00

504	688695	中创股份	186	5,868.30	0.00
505	688530	欧莱新材	344	5,538.40	0.00
506	301588	美新科技	257	5,461.25	0.00
507	301502	华阳智能	138	5,220.54	0.00
508	001359	平安电工	184	3,790.40	0.00
509	603325	博隆技术	55	3,743.30	0.00
510	603381	永臻股份	146	3,668.98	0.00
511	603312	西典新能	127	3,220.72	0.00
512	603082	北自科技	107	3,155.43	0.00
513	001379	腾达科技	213	2,871.24	0.00
514	603375	盛景微	72	2,800.80	0.00

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	000333	美的集团	2,066,556.00	0.61
2	600519	贵州茅台	648,935.00	0.19
3	001965	招商公路	457,387.02	0.13
4	000708	中信特钢	447,629.00	0.13
5	601567	三星医疗	358,669.00	0.11
6	000921	海信家电	333,153.00	0.10
7	300750	宁德时代	320,010.00	0.09
8	601881	中国银河	310,549.00	0.09
9	688041	海光信息	309,923.84	0.09
10	603979	金诚信	302,068.00	0.09
11	002085	万丰奥威	286,466.00	0.08
12	600282	南钢股份	286,349.00	0.08
13	601666	平煤股份	284,920.00	0.08
14	600582	天地科技	262,268.00	0.08
15	688114	华大智造	260,180.90	0.08
16	600968	海油发展	254,285.00	0.07
17	600036	招商银行	248,479.00	0.07
18	600900	长江电力	242,622.00	0.07
19	000858	五粮液	195,418.00	0.06
20	601006	大秦铁路	180,565.00	0.05

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	297,147.00	0.09
2	688692	达梦数据	269,883.55	0.08
3	002244	滨江集团	230,457.00	0.07
4	601933	永辉超市	220,866.00	0.06
5	301565	中仑新材	210,665.24	0.06
6	600141	兴发集团	208,839.00	0.06
7	601155	新城控股	207,313.80	0.06
8	601615	明阳智能	200,754.00	0.06
9	301536	星辰科技	200,679.00	0.06
10	002568	百润股份	197,953.80	0.06
11	300724	捷佳伟创	197,631.00	0.06
12	603737	三棵树	197,569.72	0.06
13	002138	顺络电子	195,804.00	0.06
14	002926	华西证券	193,100.00	0.06
15	688180	君实生物	190,869.27	0.06
16	000069	华侨城 A	186,462.00	0.05
17	002558	巨人网络	186,343.00	0.05
18	000021	深科技	186,126.00	0.05
19	600606	绿地控股	184,448.00	0.05
20	002299	圣农发展	184,362.00	0.05

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	22,235,299.30
卖出股票收入（成交）总额	22,643,218.44

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

本基金为指数型基金，主要投资标的为指数成份股和备选成份股。基金留存的现金头寸根据基金合同规定，投资于以标的指数或与标的指数相关性较高的其他指数为基础资产的股指期货，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。

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、中国农业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，农业银行、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	1,590,152.94
2	应收清算款	-
3	应收股利	4,971.80
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	640.92
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,595,765.66

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		华夏 MSCI 中国 A 股国际通 ETF 联接	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
2,492	95,913.09	104,790,418.00	43.84%	75,342,300.00	31.52%	58,882,700.00	24.64%

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	中国平安人寿保险股份有限公司—分红—一个险分红	65,402,200.00	27.36%
2	竞技世界 (北京) 网络技术有限公司	16,711,700.00	6.99%
3	上海浦东发展银行股份有限公司—兴证全球积极配置三年封闭运作混合型基金中基金 (FOF)	7,739,300.00	3.24%
4	兴业银行股份有限公司—兴全安泰积极养老目标五年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF)	4,866,800.00	2.04%
5	国泰君安证券股份有限公司	3,284,635.00	1.37%
6	张星	1,847,000.00	0.77%
7	广发证券股份有限公司	1,734,702.00	0.73%
8	招商银行股份有限公司—兴证全球安悦稳健养老目标一年持有期混合型基金	1,675,800.00	0.70%

中基金（FOF）			
9	张兆玮	1,250,000.00	0.52%
10	郑朝慧	1,000,000.00	0.42%
11	中国银行股份有限公司— 华夏 MSCI 中国 A 股国际 通交易型开放式指数证券 投资基金联接基金	58,882,700.00	24.64%

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、基金投资和研究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（2018年9月17日）基金份额总额	602,503,247.00
本报告期期初基金份额总额	247,015,418.00
本报告期基金总申购份额	-
减：本报告期基金总赎回份额	8,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	239,015,418.00

§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，本基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，经中国银行股份有限公司研究决定，郭德秋先生不再担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期末发生影响基金管理人经营或基金运营业务的诉讼。

本报告期无涉及基金财产、基金托管业务的诉讼。

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

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人及其高级管理人员在本报告期内无受稽查或处罚等情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员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	
方正证券	4	12,469,885.59	28.65%	5,560.47	29.00%	-
海通证券	5	11,152,155.22	25.63%	4,973.94	25.94%	-
国金证券	1	10,716,098.73	24.62%	4,692.88	24.48%	-
长江证券	4	4,906,550.00	11.27%	2,187.82	11.41%	-
中信证券	25	3,290,789.73	7.56%	1,319.07	6.88%	-
中金公司	4	982,336.20	2.26%	438.01	2.28%	-

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，本基金还选择了北京高华证券、财达证券、财通证券、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、广发证券、国盛证券、国泰君安证券、国信证券、华安证券、华泰证券、华西证券、华源证券、华鑫证券、金通证券、南京证券、平安证券、瑞银证券、申万宏源证券、太平洋证券、天风证券、万和证券、五矿证券、西部证券、西南证券、信达证券、兴业证券、野村东方国际证券、招商证券、浙商证券、中国银河证券、中信建投证券、中信证券(浙江)、中银国际证券的交易单元作为本基金交易单元，本报告期无股票交易及应付佣金。

④在上述租用的券商交易单元中，财达证券、华鑫证券的交易单元为本基金本期新增的交易单元。本期没有剔除的券商交易单元。

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
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	11,574.75	17.91%	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	53,049.09	82.09%	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

本基金本报告期内无需要披露的主要事项。

§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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2024-01-01 至 2024-06-30	65,402,200.00	-	-	65,402,200.00	27.36%
华夏 MSCI 中国 A 股国际通 ETF 联接	1	2024-01-01 至 2024-06-30	60,188,500.00	1,925,100.00	3,230,900.00	58,882,700.00	24.64%

产品特有风险

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。

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。

§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转型的文件；
- 2、《华夏 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《华夏 MSCI 中国 A 股国际通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

二〇二四年八月三十日