华夏创业板低波蓝筹交易型开放式指数证券投资基金

2021 年年度报告

2021 年 12 月 31 日

基金管理人：华夏基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：二〇二二年三月三十日

§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。本年度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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 3 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。

本报告中的财务资料经审计，安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况 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 6
§5 托管人报告 12
§6 审计报告 12
§7 年度财务报表 15
7.1 资产负债表 15
7.2 利润表 16
7.3 所有者权益（基金净值）变动表 17
7.4 报表附注 18
§8 投资组合报告 71
8.1 期末基金资产组合情况 71
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 72
8.3 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 72
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 75
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 76
8.6 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 76
8.7 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 76
8.8 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 76
8.9 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 76
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 77
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 77
8.12 投资组合报告附注 77
§9 基金份额持有人信息 78
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 78
9.2 期末上市基金前十名持有人 78
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 79
9.4 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情况 79
§10 开放式基金份额变动 79
§11 重大事件揭示 79
§12 影响投资者决策的其他重要信息 83
§13 备查文件目录 83

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华夏创业板低波蓝筹交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	华夏创蓝筹 ETF
场内简称	创蓝筹 ETF
基金主代码	159966
交易代码	159966
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2019 年 6 月 14 日
基金管理人	华夏基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,179,899,521.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2019 年 7 月 15 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。
投资策略	主要投资策略包括组合复制策略、替代性策略、存托凭证投资策略、衍生品投资策略、债券投资策略等。
业绩比较基准	创业板低波蓝筹指数收益率。
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。

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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李彬	秦一楠
	联系电话	400-818-6666	010-66060069
	电子邮箱	service@ChinaAMC.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-818-6666	95599
传真		010-63136700	010-68121816
注册地址		北京市顺义区安庆大街甲3号院	北京市东城区建国门内大街69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28号凯晨世贸中心东座F9
邮政编码		100033	100031
法定代表人		杨明辉	谷澍

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》
登载基金年度报告正文的管理人互联	www.ChinaAMC.com

网网址	
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 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、基金净值表现及利润分配情况

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	2021 年	2020 年	2019 年 6 月 14 日（基金合同生效日）至 2019 年 12 月 31 日
本期已实现收益	160,925,551.37	564,880,614.34	45,984,495.96
本期利润	28,645,573.92	699,649,327.01	59,692,054.08
加权平均基金份额本期利润	0.0194	0.5357	0.2210
本期加权平均净值利润率	2.98%	43.30%	20.11%
本期基金份额净值增长率	0.17%	62.68%	22.34%
3.1.2 期末数据和指标	2021 年末	2020 年末	2019 年末
期末可供分配利润	381,031,384.02	700,290,995.08	77,328,939.16
期末可供分配基金份额利润	0.3229	0.2522	0.1780
期末基金资产净值	764,553,749.42	1,796,577,763.38	531,622,340.29
期末基金份额净值	0.6480	0.6469	1.2234
3.1.3 累计期末指标	2021 年末	2020 年末	2019 年末
基金份额累计净值增长率	99.36%	99.02%	22.34%

注：①所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

②本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

③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	①－③	②－④

		②		准差④		
过去三个月	2.91%	0.94%	2.85%	0.95%	0.06%	-0.01%
过去六个月	-11.16%	1.40%	-11.73%	1.42%	0.57%	-0.02%
过去一年	0.17%	1.53%	-0.91%	1.54%	1.08%	-0.01%
自基金合同生效起至今	99.36%	1.59%	101.28%	1.62%	-1.92%	-0.03%

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

华夏创业板低波蓝筹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的历史走势对比图

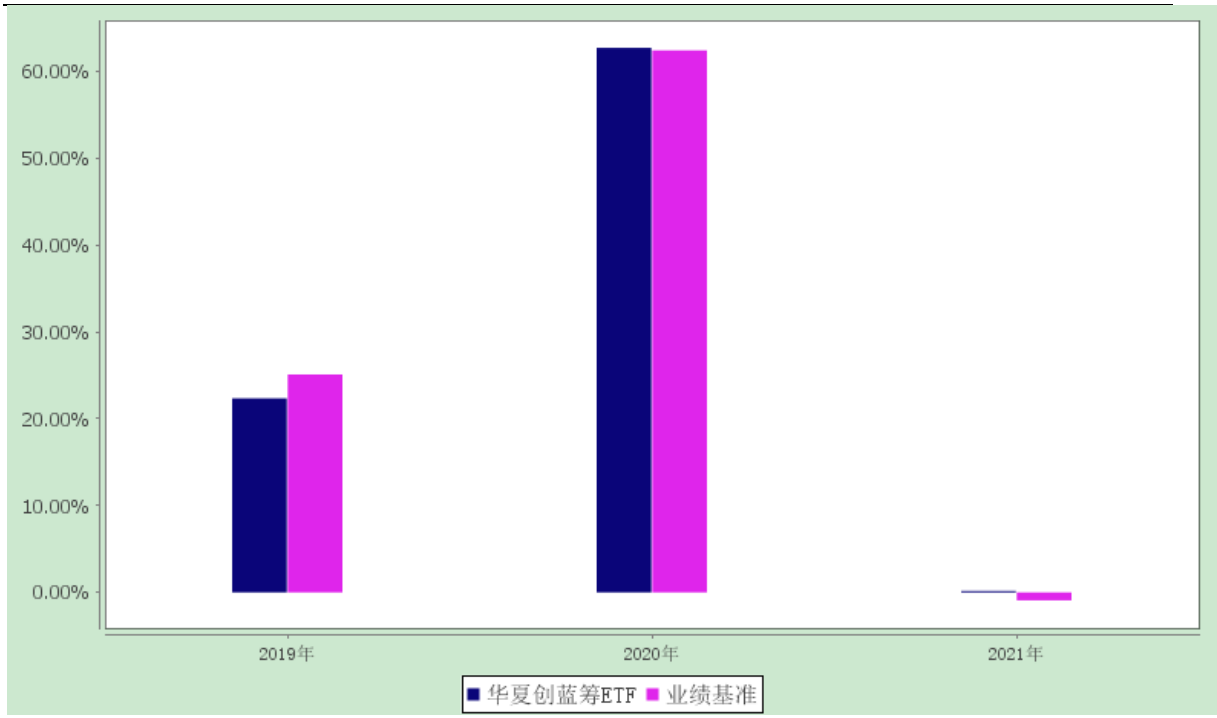
(2019 年 6 月 14 日至 2021 年 12 月 31 日)



3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华夏创业板低波蓝筹交易型开放式指数证券投资基金

自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金合同于 2019 年 6 月 14 日生效，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

§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，首批公募 MOM 基金管理人、以及特定客户资产管理人、保险资金投资管理人，国内首家承诺“碳中和”具体目标和路径的公募基金公司，香港子公司是首批 RQFII 基金管理人。华夏基金是业务领域最广泛的基金管理公司之一。

华夏基金是境内 ETF 基金资产管理规模最大的基金管理公司之一，在 ETF 基金管理方面积累了丰富的经验，形成了覆盖大盘蓝筹、宽基指数、中小创指数、主题指数、行业指数、Smart Beta 策略、海外市场指数、信用债指数、商品指数等较为完整的产品线。

华夏基金以深入的投资研究为基础，尽力捕捉市场机会，为投资人谋求良好的回报。根据银河证券基金研究中心《中国基金业绩评价报告》，截至 2021 年 12 月 31 日，华夏基金旗下多只产品近 1 年同类排名领先（基金排名不作为产品未来表现的保证），其中：

主动权益产品：在 QDII 混合基金（A 类）中华夏全球聚享（QDII）(A 类)排序第 1/35；在偏股型基金（股票上限 95%）（A 类）中华夏兴和混合排序第 1/176、华夏兴华混合(A 类)排序第 32/176；在定期开放式偏股型基金（A 类）中华夏磐利一年定开混合(A 类)排序第 1/63、华夏成长精选 6 个月定开混合(A 类)排序第 17/63；在偏股型基金(股票上下限 60%-95%)(A 类)中华夏行业景气混合排序第 2/692、华夏盛世混合排序第 14/692；在其他行业股票型基金（A 类）中华夏能源革新股票(A 类)排序第 6/33；在偏股型基金（股票上限 80%）（A 类）中华夏经典混合排序第 10/132；在标准股票型基金(A 类)中华夏智胜价值成长股票(A 类)排序第 41/259；在灵活配置型基金（股票上下限 0-95%+基准股票比例 30%-60%）（A 类）中华夏高端制造混合排序第 79/499。

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

固收&“固收+”产品：在 QDII 债券型基金（A 类）中华夏大中华信用债券（QDII）(A 类)排序第 1/25、华夏收益债券（QDII）(A 类)排序第 4/25；在偏债型基金（A 类）中华夏永康添福混合排序第 4/231、华夏磐泰混合（LOF）(A 类)排序第 20/231、华夏睿磐泰茂混合(A 类)排序第 26/231、华夏睿磐泰利混合(A 类)排序第 29/231、华夏睿磐泰兴混合排序第 34/231；在长期纯债债券型基金（A 类）中华夏鼎航债券(A 类)排序第 29/615、华夏鼎茂债券(A 类)排序第 85/615；在短期纯债债券型基金（A 类）中华夏短债债券(A 类)排序第 8/54；在普通债券型基金(可投转债)(A 类)中华夏聚利债券排序第 14/203、华夏双债债券(A 类)排序第 32/203；在普通债券型基金（二级）（A 类）中华夏鼎泓债券(A

类)排序第 31/258；在定期开放式纯债债券型基金（A 类）中华夏鼎瑞三个月定期开放债券(A 类)排序第 80/427。

养老&FOF 产品：在混合型 FOF（权益资产 0-30%）（A 类）中华夏聚丰混合（FOF）(A 类)排序第 1/16、华夏聚惠 FOF(A 类)排序第 3/16；在养老目标日期 FOF（2040）（A 类）中华夏养老 2040 三年持有混合（FOF）排序第 2/11。

在客户服务方面，2021 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）华夏基金直销上线邮储银行卡直连、交通银行卡快捷等支付方式，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上线人脸识别，盖章账单自动生成，非货基收益提醒及预约赎回等功能，提升了投资者业务办理的方便快捷性，在震荡的市场行情下方便投资者及时掌握基金收益情况，增加客户操作便利性；（3）与民商基金销售、众惠基金、泰信财富、排排网基金销售等代销机构合作，拓展更加丰富的客户理财渠道；（4）开展“震荡市需要口服镇心丸”、“发个暗号，看多少人在嗑这对 CP？”、“牙掉了之后”、“准备好了吗？来跟我们一起碳中和！”、“华夏亲子财商营”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		
荣膺	本基金的基金经理、投委会成员	2019-06-14	-	11 年	硕士。2010 年 7 月加入华夏基金管理有限公司。曾任研究发展部高级产品经理，数量投资部研究员、投资经理、基金经理助理、MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2016 年 10 月 20 日至 2018 年 9 月 16 日期间)、MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（2016 年 10 月 20 日至 2018 年 9 月 16 日期间)、上证主要消费交易型开放式指数发起式证券投资基金基金经理（2015 年 11 月 6 日至 2020 年 3 月 18 日期间)、华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金基金经理（2018 年 3 月 6 日至 2020 年 3 月 18 日期间)等。
华龙	本基金的基金经理助理	2021-02-03	-	5 年	硕士。2016 年 7 月加入华夏基金管理有限公司。曾任数量投资部研究员。

注：①上述“任职日期”和“离任日期”为根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。首任基金经理的，其“任职日期”为基金合同生效日。

②证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.3 基金经理薪酬机制

本基金管理人旗下基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的，不存在基金经理薪酬激励与其在管私募资产管理计划浮动管理费或产品业绩表现挂钩的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规制定了《华夏基金管理有限公司公平交易制度》。公司通过科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时，通过监察稽核、事后分析和信息披露来保证公平交易过程和结果的监督。

4.3.2 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。

4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

本基金管理人一贯严格执行公平交易原则，对兼任基金经理的交易情况进行持续监测。本年度所有相关组合的交易行为均符合法规、制度和流程要求，未发现违反公平交易原则的情况。本年度同一基金经理管理的不同组合在邻近交易日的同向和反向交易，交易时机和交易价差均可合理解释，未发现异常。

本基金管理人根据《基金经理兼任私募资产管理计划投资经理工作指引（试行）》要求，针对同经理管理多个组合间的收益率差异进行归因分析，本年度各组合间收益率差异均属正常情况，主要原因为业绩基准不同、投资策略不同，收益率差异可以合理解释。

4.3.3 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 73 次，其中 52 次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，其余 21 次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。

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创业板低波蓝筹指数，创业板低波蓝筹指数反映创业板中盈利能力良好、财务质量稳健、波动率较低的上市公司整体运行情况。截至 2021 年 12 月 31 日，创业板低波蓝筹指数成份股 50 只。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。

2021 年权益市场整体呈现震荡上行走势。疫情方面，上半年各国开始接种新冠疫苗，疫情对经济边际影响逐步减弱，世界经济趋于好转，下半年随着新冠病毒不断变异，新型变种病毒 Omicron 席卷全球，疫情形势依然复杂严峻。为应对疫情带来的不利影响，各国政府实施积极的财政政策和宽松的货币政策，以期刺激经济恢复增长，由此也大幅提高了通胀水平。国内方面，经济运行延续稳定恢复态势，外需强劲，拉动国内生产和就业；创新驱动战略实施成效继续显现，高技术产业发展向好。政策方面，年内开展的中央经济工作会议强调以稳为主，房地产政策强调满足购房者合理需求，出现边际转松迹象。

市场层面，权益市场整体呈现震荡上行走势。行业维度，受益于碳中和政策的新兴行业与传统行业花开两朵。新兴行业如新能源车、光伏、车用芯片走强，传统行业走强的则是受益于供给收缩预期而涨价的煤炭、钢铁、化工等，受益于绿电政策的绿电及电网系统等。风格维度，主要表现为大小盘股定价体系的收敛，众多碳中和产业链的中小公司迎来估值和盈利的双升，成长和价值风格均有表现。

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中信证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、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 2021 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 0.6480 元，本报告期份额净值增长率为 0.17%，同期业绩比较基准增长率-0.91%。本基金本报告期跟踪偏离度为+1.08%，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 2022 年，中国处于经济复苏阶段早期，未来经济有望磨底，基本面会越来越好，美国在经济下行的早期，未来经济难免不出现持续下滑，基本面会越来越差。当前中国经济周期相位暂不占优，因此美国敢于采取紧缩的货币政策，由此产生的边际影响，对中国可能造成压力。未来中国经济周期位置逐渐占优。随着美国持续施行紧缩的货币政策，势必对美国自身经济产生反作用力，中国相对宽松的财政和货币政策逐渐见效后，中美优劣位置将逆转。

珍惜基金份额持有人的每一分投资和每一份信任，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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人持续加强合规管理、风险控制和监察稽核工作。在合规管理方面，公司着力加强合规制度建设，在投资、销售、员工行为合规管理等方面出台多项管理制度。同时，继续强化业务部门专兼职合规管理人员的职责，规范任免流程，提高工作质量，完善合规管理组织机制。公司通过合规审核、合规检查、合规咨询、合规宣传与合规培训等对合规风险进行管理，确保公司合规体系高效运行，合规风险有效控制。公司开展多种形式的法律法规和廉洁从业培训，提升员工的合规意识，促进廉洁从业。公司严格落实信息披露法规要求，依法合规开展信息披露工作。在风险控制方面，公司秉承数字化管理理念，持续完善内部风险管理系统建设，稳步夯实投资风险管理基础。在严格管控基金日常投资运作风险的同时，持续完善风险管理制度建设，提升基金流动性风险、市场风险、合规风险、操作风险等关键风险的管控水平，努力保障各项风险管理措施落实到位。在监察稽核方面，公司定期和不定期开展内部稽核及离任审计工作，排查业务风险隐患，促进公司整体业务合规运作、稳健经营。

报告期内，本基金管理人所管理的基金整体运作合法合规。本基金管理人将继续以风险控制为核心，坚持基金份额持有人利益优先的原则，提高监察稽核工作的科学性和有效性，切实保障基金合规稳健运作。

4.7 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。

4.8 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。

4.9 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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—华夏基金管理有限公司 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，华夏基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，华夏基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§6 审计报告

安永华明（2022）审字第 60739337_A68 号

华夏创业板低波蓝筹交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人：

6.1 审计意见

我们审计了华夏创业板低波蓝筹交易型开放式指数证券投资基金的财务报表，包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表，2021 年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。

我们认为，后附的华夏创业板低波蓝筹交易型开放式指数证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了华夏创业板低波蓝筹交易型开放式指数证券投资基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和净值变动情况。

6.2 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于华夏创业板低波蓝筹交易型开放式指数证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

6.3 其他信息

华夏创业板低波蓝筹交易型开放式指数证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。

我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。

结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。

基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。

6.4 管理层和治理层对财务报表的责任

管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时，管理层负责评估华夏创业板低波蓝筹交易型开放式指数证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。

治理层负责监督华夏创业板低波蓝筹交易型开放式指数证券投资基金的财务报告过程。

6.5 注册会计师对财务报表审计的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

（2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

（3）评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

（4）对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对华夏创业板低波蓝筹交易型开放式指数证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致华夏创业板低波蓝筹交易型开放式指数证券投资基金不能持续经营。

（5）评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）　　中国注册会计师

师宇轩　马剑英

北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层

2022 年 3 月 28 日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：华夏创业板低波蓝筹交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	7.4.7.1	5,673,891.37	4,274,222.55
结算备付金		2,589,533.00	6,995,554.90
存出保证金		1,127,571.37	2,087,285.92
交易性金融资产	7.4.7.2	755,978,062.58	1,784,762,463.02
其中：股票投资		755,978,062.58	1,784,762,463.02
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		22,345.71	443,876.60
应收利息	7.4.7.5	14,864.92	52,279.22
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		765,406,268.95	1,798,615,682.21
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		4,943.00	72,412.98
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		302,215.74	783,218.15
应付托管费		60,443.17	156,643.64
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	94,067.55	180,449.88
应交税费		2,955.71	3,092.73

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	387,894.36	842,101.45
负债合计		852,519.53	2,037,918.83
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	383,522,365.40	902,686,845.04
未分配利润	7.4.7.10	381,031,384.02	893,890,918.34
所有者权益合计		764,553,749.42	1,796,577,763.38
负债和所有者权益总计		765,406,268.95	1,798,615,682.21

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.6480 元，基金份额总额 1,179,899,521.00 份。

7.2 利润表

会计主体：华夏创业板低波蓝筹交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
一、收入		36,478,495.56	712,425,149.48
1.利息收入		1,133,746.28	1,001,558.97
其中：存款利息收入	7.4.7.11	139,854.69	141,935.86
债券利息收入		196.49	1,023.67
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	206.58
证券出借利息收入		993,695.10	858,392.86
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		167,520,755.14	573,723,950.48
其中：股票投资收益	7.4.7.12	161,756,374.97	562,173,830.23
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	239,668.71	1,596,942.05
资产支持证券投资收益	7.4.7.14	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	2,174,906.41	1,913,878.06
股利收益	7.4.7.16	3,349,805.05	8,039,300.14
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-132,279,977.45	134,768,712.67
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	103,971.59	2,930,927.36
减：二、费用		7,832,921.64	12,775,822.47

1．管理人报酬		4,863,216.95	8,071,919.37
2．托管费		972,643.44	1,614,383.92
3．销售服务费		-	-
4．交易费用	7.4.7.19	1,486,233.00	2,366,840.59
5．利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6．税金及附加		12,692.70	8,558.57
7．其他费用	7.4.7.20	498,135.55	714,120.02
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		28,645,573.92	699,649,327.01
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		28,645,573.92	699,649,327.01

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华夏创业板低波蓝筹交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	902,686,845.04	893,890,918.34	1,796,577,763.38
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	28,645,573.92	28,645,573.92
三、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）	-519,164,479.64	-541,505,108.24	-1,060,669,587.88
其中：1.基金申购款	579,233,097.73	568,810,651.78	1,148,043,749.51
2.基金赎回款	-1,098,397,577.37	-1,110,315,760.02	-2,208,713,337.39
四、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）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	383,522,365.40	381,031,384.02	764,553,749.42
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	434,550,619.00	97,071,721.29	531,622,340.29

二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	699,649,327.01	699,649,327.01
三、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）	468,136,226.04	97,169,870.04	565,306,096.08
其中：1.基金申购款	5,445,557,013.21	3,151,078,588.07	8,596,635,601.28
2.基金赎回款	-4,977,420,787.17	-3,053,908,718.03	-8,031,329,505.20
四、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）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	902,686,845.04	893,890,918.34	1,796,577,763.38

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4，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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

华夏创业板低波蓝筹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[2019]563 号《关于准予华夏创业板低波蓝筹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》、《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》、《华夏创业板低波蓝筹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 2019 年 5 月 6 日至 2019 年 6 月 6 日共募集 354,531,248.00 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（2019）验字第 60739337_A49 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华夏创业板低波蓝筹交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2019 年 6 月 14 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 354,550,619.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 19,371.00 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，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《华夏基金管理有限公司关于华夏创业板低波蓝筹交易型开放式指数证券投资基金基金份额拆分结果的公告》，基金管理人以 2020 年 11 月 5 日为权益登记日对本基金基金份额进行了拆分，拆分比例为 3.076488732。拆分前基金份额总额为 1,033,550,619 份，拆分后基金份额总额为

3,179,699,521 份。

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、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)、股指期货、股票期权、国债期货、货币市场工具（含同业存单）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。本基金投资范围中的股票包含存托凭证。

7.4.2 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 7.4.4 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。

7.4.3 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基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

1、金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金目前暂无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

2、金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债包括交易性金融负债及衍生金融负债等。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利、债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及金融负债按照公允价值进行后续计量，应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

1、存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

2、当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持

的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

3、如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。对于曾经实施份额拆分或折算的基金，由于基金份额拆分或折算引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日或基金份额折算日根据拆分前或折算前的基金份额数及确定的拆分或折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。对于已开放转换业务的基金，上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

境内基金投资在持有期间应取得的现金红利于除息日确认为投资收益；境外基金投资在持有期间应取得的基金分红收益扣除基金交易所在地适用的预缴所得税后的净额确认投资收益。境内股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益；境外股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除股票交易所在地适用的预缴所得税后的净额确认为投资收益。境内债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。境外债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在交易所在地适用的预缴所得税及由基金管理人缴

纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；处置时其公允价值与初始确认金额之间的差额扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

转融通证券出借业务中，基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认出借证券，仍按原金融资产类别进行后续计量，并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入，将出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为投资收益。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的按直线法近似计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

针对基金合同约定费率和计算方法的费用，本基金在费用涵盖期间按合同约定进行确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的按直线法近似计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配。期末可供分配利润指期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。基金收益评价日核定的基金累计报酬率超过标的指数同期累计报酬率达到 1%以上，方可进行收益分配。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

1、对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收

益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

2、对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6 号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》进行估值。

3、对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场交易的固定收益品种，按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 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。

7.4.6 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 5%、3%、2%缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
活期存款	5,673,891.37	4,274,222.55
定期存款	-	-
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	-	-
合计	5,673,891.37	4,274,222.55

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2021 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		740,150,329.24	755,978,062.58	15,827,733.34
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		740,150,329.24	755,978,062.58	15,827,733.34
项目		上年度末 2020 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		1,636,397,352.23	1,784,762,463.02	148,365,110.79
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	1,636,397,352.23	1,784,762,463.02	148,365,110.79

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。

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 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	6,937,240.00	-	-	-
其中：股指期货	6,937,240.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	6,937,240.00	-	-	-
项目	上年度末 2020 年 12 月 31 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	8,770,160.00	-	-	-
其中：股指期货	8,770,160.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	8,770,160.00	-	-	-

注：期货投资采用当日无负债结算制度，相关价值已包含在结算备付金中，具体投资明细详见“报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细”相关表格。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	1,152.48	2,049.51
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	1,541.89	4,238.91
应收债券利息	-	-
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	12,118.74	45,573.02
其他	51.81	417.78
合计	14,864.92	52,279.22

7.4.7.6 其他资产

无。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	94,067.55	180,449.88
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	94,067.55	180,449.88

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 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	-	-
预提费用	200,000.00	220,000.00
应付指数使用费	187,894.36	305,070.96
可退替代款	-	174,446.09
应退替代款	-	142,584.40
合计	387,894.36	842,101.45

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,777,099,521.00	902,686,845.04
本期申购	1,782,000,000.00	579,233,097.73
本期赎回（以“-”号填列）	-3,379,200,000.00	-1,098,397,577.37
本期末	1,179,899,521.00	383,522,365.40

7.4.7.10 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	700,290,995.08	193,599,923.26	893,890,918.34
本期利润	160,925,551.37	-132,279,977.45	28,645,573.92
本期基金份额交易产生的变动数	-454,220,985.30	-87,284,122.94	-541,505,108.24
其中：基金申购款	543,949,128.63	24,861,523.15	568,810,651.78
基金赎回款	-998,170,113.93	-112,145,646.09	-1,110,315,760.02
本期已分配利润	-	-	-
本期末	406,995,561.15	-25,964,177.13	381,031,384.02

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	47,840.75	66,299.73
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	85,945.63	63,244.57
其他	6,068.31	12,391.56
合计	139,854.69	141,935.86

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日

股票投资收益——买卖股票差价收入	22,225,513.97	65,720,013.26
股票投资收益——赎回差价收入	139,530,861.00	496,453,816.97
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	161,756,374.97	562,173,830.23

7.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	709,498,377.98	1,078,902,456.26
减：卖出股票成本总额	687,272,864.01	1,013,182,443.00
买卖股票差价收入	22,225,513.97	65,720,013.26

7.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
赎回基金份额对价总额	2,208,713,337.39	8,031,329,505.20
减：现金支付赎回款总额	15,551,064.39	122,620,568.20
减：赎回股票成本总额	2,053,631,412.00	7,412,255,120.03
赎回差价收入	139,530,861.00	496,453,816.97

7.4.7.12.4 股票投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.12.5 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,705,471.08	7,308,529.65
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,465,600.00	5,710,500.00
减：应收利息总额	202.37	1,087.60
买卖债券差价收入	239,668.71	1,596,942.05

7.4.7.14 资产支持证券投资收益

无。

7.4.7.15 衍生工具收益

7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间收益金额 2020年1月1日至2020年12月31日
股指期货投资收益	2,174,906.41	1,913,878.06
合计	2,174,906.41	1,913,878.06

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
股票投资产生的股利收益	3,349,805.05	8,039,300.14
其中：证券出借权益补偿收入	67,008.24	309,202.31
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	3,349,805.05	8,039,300.14

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
1.交易性金融资产	-132,537,377.45	134,747,752.67
——股票投资	-132,537,377.45	134,747,752.67
——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	257,400.00	20,960.00
——权证投资	-	-
——期货投资	257,400.00	20,960.00
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	-132,279,977.45	134,768,712.67

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
基金赎回费收入	-	-
替代损益	103,971.59	2,930,927.36
合计	103,971.59	2,930,927.36

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	1,486,233.00	2,366,840.59
银行间市场交易费用	-	-
合计	1,486,233.00	2,366,840.59

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
审计费用	80,000.00	100,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行费用	6,342.53	9,804.84
指数使用费	291,793.02	484,315.18
合计	498,135.55	714,120.02

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无或有事项。

7.4.8.2 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。

7.4.9 关联方关系

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
中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”）	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
POWER CORPORATION OF CANADA	基金管理人的股东
天津海鹏科技咨询有限公司	基金管理人的股东
MACKENZIE FINANCIAL CORPORATION	基金管理人的股东
华夏创业板低波蓝筹交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(“华夏创蓝筹 ETF 联接”)	该基金是本基金的联接基金

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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31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	236,774,409.88	15.93%	4,034,200.00	0.16%

7.4.10.1.2 权证交易

无。

7.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31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	1,193,017.65	69.95%	-	-

7.4.10.1.4 债券回购交易

无。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年12月31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	102,120.96	15.93%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31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	588.63	0.06%	-	-

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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	4,863,216.95	8,071,919.37
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	972,643.44	1,614,383.92

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。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.10.4 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

7.4.10.4.1 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。

7.4.10.4.2 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 2021年1月1日至2021年12月31日										
关联方名称	合约编号	证券名称	成交时间	交易金额	交易数量（单位：股）	出借期限（单位：天 ）	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	2021010700012492	华宇软件	2021-01-07	365,750.00	15,400.00	28	3.40	967.21	-	-
中信证券	2021010700012494	顺网科技	2021-01-07	306,138.00	19,700.00	14	3.50	416.69	-	-
中信证券	2021010700012496	掌趣科技	2021-01-07	47,400.00	10,000.00	14	3.50	64.52	-	-
中信证券	2021010700012498	光线传媒	2021-01-07	356,100.00	30,000.00	28	3.30	913.99	-	-
中信证券	2021010700012500	顺网科技	2021-01-07	233,100.00	15,000.00	14	3.50	317.28	-	-
中信证券	2021011200006829	掌趣科技	2021-01-12	51,500.00	10,000.00	14	3.50	70.10	-	-
中信证券	2021011200006831	华宇软件	2021-01-12	452,199.00	19,300.00	14	3.50	615.49	-	-
中	2021011200006833	苏	2021-01-12	58,600.00	10,000.00	14	5.00	113.94	-	-

信证券		交科								
中信证券	2021011200006835	数码科技	2021-01-12	43,000.00	10,000.00	14	4.60	76.92	-	-
中信证券	2021011200006837	苏交科	2021-01-12	58,600.00	10,000.00	14	5.00	113.94	-	-
中信证券	2021011200006839	长信科技	2021-01-12	356,800.00	40,000.00	14	3.50	485.64	-	-
中信证券	2021011200006841	长信科技	2021-01-12	892,000.00	100,000.00	14	3.50	1,214.11	-	-
中信证券	2021011200006845	深信服	2021-01-12	2,839,900.00	10,000.00	14	3.40	3,754.98	-	-
中信证券	2021012100000461	掌趣科技	2021-01-21	52,800.00	10,000.00	14	3.30	67.76	-	-
中信证券	2021012100013059	掌趣科技	2021-01-21	52,800.00	10,000.00	14	3.30	67.76	-	-
中信证券	2021012100013061	顺网科技	2021-01-21	231,750.00	15,000.00	14	3.40	306.43	-	-
中信证券	2021012100013063	顺网科技	2021-01-21	304,365.00	19,700.00	14	3.40	402.44	-	-
中信证券	2021012600006576	华宇软件	2021-01-26	388,702.00	19,300.00	14	3.30	498.83	-	-
中信	2021012600006580	苏交	2021-01-26	58,100.00	10,000.00	14	3.70	83.60	-	-

证券		科								
中信证券	2021012600006582	数码视讯	2021-01-26	40,900.00	10,000.00	14	3.60	57.26	-	-
中信证券	2021012600006584	长信科技	2021-01-26	324,000.00	40,000.00	14	3.40	428.40	-	-
中信证券	2021012600006586	长信科技	2021-01-26	810,000.00	100,000.00	14	3.40	1,071.00	-	-
中信证券	2021012600006588	掌趣科技	2021-01-26	51,100.00	10,000.00	14	3.30	65.58	-	-
中信证券	2021012600006590	苏交科	2021-01-26	58,100.00	10,000.00	14	3.70	83.60	-	-
中信证券	2021020400013561	掌趣科技	2021-02-04	56,800.00	10,000.00	14	3.40	75.10	-	-
中信证券	2021020400013563	光线传媒	2021-02-04	397,500.00	30,000.00	28	3.40	1,051.17	-	-
中信证券	2021020400013565	华宇软件	2021-02-04	273,196.00	15,400.00	28	3.40	722.45	-	-
中信证券	2021020400013567	掌趣科技	2021-02-04	56,800.00	10,000.00	14	3.40	75.10	-	-
中信证券	2021020400013569	顺网科技	2021-02-04	293,727.00	19,700.00	14	3.60	411.22	-	-
中信证	2021020400013571	顺网科	2021-02-04	223,650.00	15,000.00	14	3.60	313.11	-	-

券		技								
中信证券	2021020900000487	顺网科技	2021-02-09	144,500.00	10,000.00	14	3.50	196.68	-	-
中信证券	2021020900000491	健帆生物	2021-02-09	2,038,960.00	22,000.00	14	3.50	2,775.25	-	-
中信证券	2021020900006141	苏交科	2021-02-09	52,700.00	10,000.00	14	4.30	88.13	-	-
中信证券	2021020900006145	掌趣科技	2021-02-09	52,400.00	10,000.00	14	3.50	71.32	-	-
中信证券	2021020900006315	数码视讯	2021-02-09	37,300.00	10,000.00	14	3.50	50.77	-	-
中信证券	2021020900006317	长信科技	2021-02-09	774,000.00	100,000.00	14	3.50	1,053.50	-	-
中信证券	2021020900006319	长信科技	2021-02-09	309,600.00	40,000.00	14	3.50	421.40	-	-
中信证券	2021020900006329	华宇软件	2021-02-09	339,487.00	19,300.00	14	3.50	462.08	-	-
中信证券	2021020900006331	苏交科	2021-02-09	52,700.00	10,000.00	14	4.30	88.13	-	-
中信证券	2021021800001069	掌趣科技	2021-02-18	160,800.00	30,000.00	14	3.50	218.87	-	-
中信证券	2021021800043076	顺网科技	2021-02-18	222,750.00	15,000.00	14	3.50	303.19	-	-

中信证券	2021021800043078	掌趣科技	2021-02-18	53,600.00	10,000.00	14	3.50	72.96	-	-
中信证券	2021021800043080	掌趣科技	2021-02-18	53,600.00	10,000.00	14	3.50	72.96	-	-
中信证券	2021021800043082	顺网科技	2021-02-18	292,545.00	19,700.00	14	3.50	398.19	-	-
中信证券	2021022300006982	数码视讯	2021-02-23	40,100.00	10,000.00	14	3.60	56.14	-	-
中信证券	2021022300006984	长信科技	2021-02-23	824,000.00	100,000.00	14	3.70	1,185.64	-	-
中信证券	2021022300006986	长信科技	2021-02-23	329,600.00	40,000.00	14	3.70	474.26	-	-
中信证券	2021022300006988	健帆生物	2021-02-23	1,884,520.00	22,000.00	14	3.50	2,565.04	-	-
中信证券	2021022300006990	掌趣科技	2021-02-23	56,100.00	10,000.00	14	3.50	76.36	-	-
中信证券	2021022300006992	华宇软件	2021-02-23	358,401.00	19,300.00	14	3.70	515.70	-	-
中信证券	2021022300006994	顺网科技	2021-02-23	149,800.00	10,000.00	14	3.50	203.89	-	-
中信证券	2021022300006996	苏交科	2021-02-23	58,400.00	10,000.00	14	4.50	102.20	-	-
中	2021022300006998	苏	2021-02-23	58,400.00	10,000.00	14	4.50	102.20	-	-

信证券		交科								
中信证券	2021031100000487	汤臣倍健	2021-03-11	554,288.00	19,600.00	14	3.50	754.45	-	-
中信证券	2021031600000718	掌趣科技	2021-03-16	52,700.00	10,000.00	14	3.60	73.78	-	-
中信证券	2021031800000439	掌趣科技	2021-03-18	52,100.00	10,000.00	14	3.60	72.94	-	-
中信证券	2021032500000528	我武生物	2021-03-25	1,107,800.00	20,000.00	28	3.40	2,929.52	-	-
中信证券	2021032500000530	利亚德	2021-03-25	69,600.00	10,000.00	28	3.40	184.05	-	-
中信证券	2021032500000542	长亮科技	2021-03-25	182,500.00	10,000.00	14	3.60	255.50	-	-
中信证券	2021033000000657	安科生物	2021-03-30	233,464.00	15,400.00	14	3.60	326.85	-	-
中信证券	2021033000000661	长信科技	2021-03-30	124,824.00	16,800.00	14	3.60	174.75	-	-
中信证券	2021033000000663	掌趣科技	2021-03-30	50,200.00	10,000.00	14	3.50	68.33	-	-
中信证券	2021033000008637	掌趣科技	2021-03-30	50,200.00	10,000.00	14	3.50	68.33	-	-
中信	2021040100030465	掌趣	2021-04-01	50,300.00	10,000.00	14	3.50	68.46	-	-

证券		科技								
中信证券	2021040800000552	乐普医疗	2021-04-08	1,555,695.00	54,300.00	14	3.40	2,056.97	-	-
中信证券	2021040800004745	长亮科技	2021-04-08	174,500.00	10,000.00	14	3.60	244.30	-	-
中信证券	2021041300008381	掌趣科技	2021-04-13	50,300.00	10,000.00	14	3.50	68.46	-	-
中信证券	2021041300008383	长信科技	2021-04-13	125,160.00	16,800.00	14	3.50	170.36	-	-
中信证券	2021041300008387	安科生物	2021-04-13	273,196.00	15,400.00	14	3.50	371.85	-	-
中信证券	2021041300008395	掌趣科技	2021-04-13	50,300.00	10,000.00	14	3.50	68.46	-	-
中信证券	2021041500032506	掌趣科技	2021-04-15	50,100.00	10,000.00	14	3.50	68.19	-	-
中信证券	2021042200007338	长亮科技	2021-04-22	202,400.00	10,000.00	14	3.50	275.49	-	-
中信证券	2021042200007340	利亚德	2021-04-22	78,300.00	10,000.00	28	3.40	207.06	-	-
中信证券	2021042200007342	我武生物	2021-04-22	1,333,200.00	20,000.00	28	3.30	3,421.88	-	-
中信证	2021042700000805	温氏股	2021-04-27	142,100.00	10,000.00	14	3.30	182.36	-	-

券		份								
中信证券	2021042700011820	掌趣科技	2021-04-27	47,200.00	10,000.00	14	3.50	64.24	-	-
中信证券	2021042700011822	掌趣科技	2021-04-27	47,200.00	10,000.00	14	3.50	64.24	-	-
中信证券	2021042700011826	安科生物	2021-04-27	284,900.00	15,400.00	14	3.60	398.86	-	-
中信证券	2021042900000587	芒果超媒	2021-04-29	683,300.00	10,000.00	14	3.30	876.90	-	-
中信证券	2021042900000591	华测检测	2021-04-29	396,759.00	12,100.00	14	3.60	555.46	-	-
中信证券	2021042900023949	掌趣科技	2021-04-29	44,600.00	10,000.00	14	3.50	60.71	-	-
中信证券	2021050600029366	长亮科技	2021-05-06	179,000.00	10,000.00	14	3.50	243.64	-	-
中信证券	2021051100000938	华测检测	2021-05-11	386,474.00	12,100.00	14	3.50	526.03	-	-
中信证券	2021051100010729	掌趣科技	2021-05-11	43,100.00	10,000.00	14	3.50	58.66	-	-
中信证券	2021051100010733	掌趣科技	2021-05-11	43,100.00	10,000.00	14	3.50	58.66	-	-
中信证券	2021051300027646	华测检测	2021-05-13	393,613.00	12,100.00	14	3.60	551.06	-	-

中信证券	2021051300027650	掌趣科技	2021-05-13	44,000.00	10,000.00	14	3.50	59.89	-	-
中信证券	2021052000000517	华测检测	2021-05-20	559,254.00	16,600.00	14	3.40	739.46	-	-
中信证券	2021052000017877	长亮科技	2021-05-20	179,800.00	10,000.00	14	3.60	251.72	-	-
中信证券	2021052000019492	华测检测	2021-05-20	581.00	-	14	3.40	-	-	-
中信证券	2021052000019527	华测检测	2021-05-13	423.50	-	14	3.60	-	-	-
中信证券	2021052000019604	华测检测	2021-05-11	423.50	-	14	3.50	-	-	-
中信证券	2021052500010232	掌趣科技	2021-05-25	43,800.00	10,000.00	14	3.50	59.62	-	-
中信证券	2021052500010238	华测检测	2021-05-25	420,717.00	12,100.00	14	3.40	556.28	-	-
中信证券	2021052500010240	掌趣科技	2021-05-25	43,800.00	10,000.00	14	3.50	59.62	-	-
中信证券	2021052700018809	华测检测	2021-05-27	407,528.00	12,100.00	14	3.40	538.84	-	-
中信证券	2021052700018815	掌趣科技	2021-05-27	45,200.00	10,000.00	14	3.50	61.52	-	-
中	2021061000007868	华	2021-06-10	388,410.00	12,100.00	14	3.40	513.56	-	-

信证券		测检测								
中信证券	2021061000007872	掌趣科技	2021-06-10	46,200.00	10,000.00	14	3.50	62.88	-	-
中信证券	2021062200001696	汤臣倍健	2021-06-22	3,615,000.00	100,000.00	14	3.50	4,920.42	-	-
中信证券	2021062400009377	掌趣科技	2021-06-24	43,900.00	10,000.00	14	3.50	59.75	-	-
中信证券	2021062400009379	华测检测	2021-06-24	425,920.00	12,100.00	14	3.40	563.16	-	-
中信证券	2021070100000890	掌趣科技	2021-07-01	47,712.00	11,200.00	14	3.50	64.94	-	-
中信证券	2021070200001295	卫宁健康	2021-07-02	668,000.00	40,000.00	7	3.60	467.60	-	-
中信证券	2021070200001331	迈瑞医疗	2021-07-02	6,766,200.00	30,000.00	7	3.50	9,209.55	-	-
中信证券	2021070600011550	汤臣倍健	2021-07-06	2,930,000.00	100,000.00	14	3.50	3,988.06	-	-
中信证券	2021070800007773	华测检测	2021-07-08	347,391.00	12,100.00	14	3.40	459.33	-	-
中信证券	2021070800007775	掌趣科技	2021-07-08	41,200.00	10,000.00	14	3.50	56.08	-	-
中信	2021070900006265	迈瑞	2021-07-09	6,666,150.00	15,000.00	7	3.20	4,147.83	-	-

证券		医疗								
中信证券	2021070900006283	卫宁健康	2021-07-09	648,000.00	40,000.00	7	2.60	327.60	-	-
中信证券	2021071500017564	掌趣科技	2021-07-15	48,048.00	11,200.00	14	3.70	69.14	-	-
中信证券	2021072000013639	汤臣倍健	2021-07-20	3,052,000.00	100,000.00	14	3.70	4,391.49	-	-
中信证券	2021072200007192	掌趣科技	2021-07-22	41,900.00	10,000.00	28	3.30	107.54	-	-
中信证券	2021072300000754	华大基因	2021-07-23	480,720.00	4,800.00	14	1.80	336.50	-	-
中信证券	2021072300000792	乐普医疗	2021-07-23	833,490.00	29,400.00	14	1.80	583.44	-	-
中信证券	2021072900014293	掌趣科技	2021-07-29	43,904.00	11,200.00	28	3.40	116.10	-	-
中信证券	2021080300012614	汤臣倍健	2021-08-03	2,894,000.00	100,000.00	14	3.40	3,826.51	-	-
中信证券	2021080600009174	乐普医疗	2021-08-06	765,870.00	29,400.00	14	1.80	191.47	-	-
中信证券	2021080600009176	华大基因	2021-08-06	523,200.00	4,800.00	14	1.80	130.80	-	-
中信证	2021081000003002	乐普医	2021-08-06	790,566.00	29,400.00	5	1.80	191.47	-	-

券		疗								
中信证券	2021081000003014	华大基因	2021-08-06	521,280.00	4,800.00	5	1.80	130.80	-	-
中信证券	2021081700012474	汤臣倍健	2021-08-17	2,986,000.00	100,000.00	14	3.50	4,064.28	-	-
中信证券	2021081900010963	掌趣科技	2021-08-19	35,500.00	10,000.00	28	3.30	91.12	-	-
中信证券	2021082600016547	掌趣科技	2021-08-26	40,880.00	11,200.00	28	3.20	101.75	-	-
中信证券	2021083100012053	汤臣倍健	2021-08-31	2,515,000.00	100,000.00	14	3.60	3,521.00	-	-
中信证券	2021090800000871	英科医疗	2021-09-08	178,002.00	1,800.00	28	3.10	459.84	-	-
中信证券	2021091400015744	汤臣倍健	2021-09-14	2,704,000.00	100,000.00	14	3.10	465.69	-	-
中信证券	2021091500002949	汤臣倍健	2021-09-14	2,630,000.00	100,000.00	2	3.10	465.69	-	-
中信证券	2021092300001128	健帆生物	2021-09-23	159,600.00	3,000.00	14	3.20	212.80	-	-
中信证券	2021092300016225	掌趣科技	2021-09-23	45,024.00	11,200.00	28	3.50	122.57	-	-
中信证券	2021092900019532	英科医疗	2021-09-08	-	900.00	28	3.10	-	-	-

中信证券	2021100800064675	健帆生物	2021-10-08	175,800.00	3,000.00	14	3.20	218.77	-	-
中信证券	2021100800070837	英科医疗	2021-10-08	103,176.00	1,800.00	28	3.30	264.82	-	-
中信证券	2021102100004514	掌趣科技	2021-10-21	41,888.00	11,200.00	28	3.40	110.77	-	-
中信证券	2021102200050304	健帆生物	2021-10-22	163,800.00	3,000.00	14	3.50	222.95	-	-
中信证券	2021110400000737	国瓷材料	2021-11-04	1,706,012.00	38,200.00	14	3.20	2,123.04	-	-
中信证券	2021110400000743	长亮科技	2021-11-04	383,538.00	29,100.00	14	3.50	522.04	-	-
中信证券	2021110500064901	健帆生物	2021-11-05	152,820.00	3,000.00	14	2.60	154.52	-	-
中信证券	2021110500064905	英科医疗	2021-11-05	100,080.00	1,800.00	28	3.10	241.30	-	-
中信证券	2021111600001165	网宿科技	2021-11-16	295,630.00	47,000.00	14	3.60	413.88	-	-
中信证券	2021111800005289	掌趣科技	2021-11-18	48,384.00	11,200.00	28	3.40	127.95	-	-
中信证券	2021111800006267	长亮科技	2021-11-18	390,813.00	29,100.00	14	3.40	516.74	-	-
中	2021113000004733	网	2021-11-30	288,110.00	47,000.00	14	3.90	436.97	-	-

信证券		宿科技								
中信证券	2021120200004251	长亮科技	2021-12-02	411,183.00	29,100.00	14	3.50	559.67	-	-
中信证券	2021120300020663	英科医疗	2021-12-03	109,530.00	1,800.00	28	3.20	272.61	-	-
中信证券	2021121400001113	英科医疗	2021-12-14	180,180.00	3,000.00	14	1.80	126.13	-	-
中信证券	2021121400011138	网宿科技	2021-12-14	313,490.00	47,000.00	14	3.30	402.31	-	-
中信证券	2021121600008345	长亮科技	2021-12-16	416,712.00	29,100.00	14	3.70	599.60	-	-
中信证券	2021122300001009	绿盟科技	2021-12-23	329,640.00	20,500.00	14	3.20	234.41	325,130.00	234.41
中信证券	2021122700001113	绿盟科技	2021-12-27	564,060.00	35,700.00	14	3.40	213.09	566,202.00	213.09
中信证券	2021122700001120	长亮科技	2021-12-27	551,705.00	38,500.00	14	3.60	220.68	603,295.00	220.68
中信证券	2021122700001122	长信科技	2021-12-27	664,362.00	48,600.00	14	3.60	265.75	645,408.00	265.75
中信证券	2021122800013188	网宿科技	2021-12-28	310,200.00	47,000.00	14	3.50	90.48	314,430.00	90.48
中信	2021122800013200	英科	2021-12-28	170,190.00	3,000.00	14	1.80	25.53	173,520.00	25.53

证券		医疗								
中信证券	2021122900001004	长信科技	2021-12-29	1,414,940.00	107,600.00	14	3.60	282.99	1,428,928.00	282.99
中信证券	2021123000001536	长信科技	2021-12-30	293,930.00	22,100.00	14	3.60	29.39	293,488.00	29.39
中信证券	2021123000009520	长亮科技	2021-12-30	441,738.00	29,100.00	14	3.50	42.95	455,997.00	42.95
中信证券	2021123100001163	安科生物	2021-12-31	977,823.00	74,700.00	14	3.50	-	977,823.00	-
中信证券	2021123100001172	长信科技	2021-12-31	669,312.00	50,400.00	14	3.60	-	669,312.00	-
中信证券	2021123100024372	英科医疗	2021-12-31	104,112.00	1,800.00	28	3.20	-	104,112.00	-
上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日										
关联方名称	合约编号	证券名称	成交时间	交易金额	交易数量（单位：股）	出借期限（单位：天 ）	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	2020021300000376	红日药业	2020-02-13	2,700,936.00	559,200.00	28	1.80	3,781.31	-	-
中信证券	2020021300000395	芒果超媒	2020-02-13	511,000.00	10,000.00	14	1.70	337.83	-	-
中信证券	2020022700000243	顺网科技	2020-02-27	296,100.00	10,000.00	28	1.80	414.54	-	-

中信证券	2020030300000439	迈瑞医疗	2020-03-03	7,859,700.00	30,000.00	14	1.70	5,196.14	-	-
中信证券	2020032600000834	掌趣科技	2020-03-26	1,088,000.00	200,000.00	28	1.80	1,523.20	-	-
中信证券	2020032600000856	中科创达	2020-03-26	1,640,925.00	29,700.00	14	1.70	1,084.83	-	-
中信证券	2020032600003079	顺网科技	2020-03-26	233,600.00	10,000.00	28	1.80	327.04	-	-
中信证券	2020040700004221	中科创达	2020-04-07	3,861.00	-	14	1.70	-	-	-
中信证券	2020040900000523	利亚德	2020-04-09	651,000.00	100,000.00	28	1.80	911.40	-	-
中信证券	2020040900002065	中科创达	2020-04-09	1,676,565.00	29,700.00	14	1.70	1,108.40	-	-
中信证券	2020042300000333	亿联网络	2020-04-23	1,697,800.00	20,000.00	28	1.80	2,376.92	-	-
中信证券	2020042300001877	顺网科技	2020-04-23	194,500.00	10,000.00	28	1.80	272.30	-	-
中信证券	2020051900000573	安科生物	2020-05-19	402,400.00	20,000.00	14	1.70	266.03	-	-
中信证券	2020051900000637	利亚德	2020-05-19	424,034.00	69,400.00	14	1.70	280.33	-	-
中	2020052100003805	安	2020-05-21	3,000.00	-	14	1.70	-	-	-

信证券		科生物								
中信证券	2020052100003937	安科生物	2020-05-21	-	6,000.00	14	1.70	-	-	-
中信证券	2020052800000375	安科生物	2020-05-28	442,500.00	30,000.00	14	1.70	292.54	-	-
中信证券	2020061100000276	汤臣倍健	2020-06-11	2,343,150.00	127,000.00	14	1.70	1,991.68	-	-
中信证券	2020061100000284	利亚德	2020-06-11	882,000.00	150,000.00	28	1.80	1,234.80	-	-
中信证券	2020061100000291	绿盟科技	2020-06-11	281,029.00	13,300.00	14	1.70	238.87	-	-
中信证券	2020061100000293	绿盟科技	2020-06-11	293,707.00	13,900.00	28	1.80	411.19	-	-
中信证券	2020061100000305	深信服	2020-06-11	1,749,900.00	10,000.00	28	1.80	2,449.86	-	-
中信证券	2020061100000326	宁德时代	2020-06-11	1,639,800.00	10,000.00	28	1.80	2,295.72	-	-
中信证券	2020061600003470	光威复材	2020-06-16	578,600.00	10,000.00	28	1.80	810.04	-	-
中信证券	2020070200000566	利亚德	2020-07-02	394,902.00	61,800.00	14	1.70	261.07	-	-
中信	2020070700000767	同花	2020-07-07	1,645,500.00	10,000.00	28	1.80	2,303.70	-	-

证券		顺								
中信证券	2020070700001073	上海钢联	2020-07-07	766,700.00	10,000.00	14	1.70	506.87	-	-
中信证券	2020071600001674	利亚德	2020-07-16	431,364.00	61,800.00	14	1.70	285.18	-	-
中信证券	2020072100003227	上海钢联	2020-07-21	824,500.00	10,000.00	14	1.70	545.09	-	-
中信证券	2020073000003772	利亚德	2020-07-30	437,544.00	61,800.00	14	1.70	289.27	-	-
中信证券	2020080400002333	同花顺	2020-08-04	1,468,600.00	10,000.00	28	1.80	2,056.04	-	-
中信证券	2020080400003697	上海钢联	2020-08-04	785,900.00	10,000.00	14	1.70	519.57	-	-
中信证券	2020080600000591	华测检测	2020-08-06	5,166,000.00	200,000.00	28	1.80	7,232.40	-	-
中信证券	2020081300002979	利亚德	2020-08-13	425,184.00	61,800.00	14	1.70	281.09	-	-
中信证券	2020081800003595	上海钢联	2020-08-18	826,000.00	10,000.00	14	1.70	546.08	-	-
中信证券	2020082500000470	安科生物	2020-08-25	335,969.00	19,100.00	14	3.20	418.09	-	-
中信证	2020082500000472	昆仑万	2020-08-25	355,260.00	12,400.00	14	3.20	442.10	-	-

券		维								
中信证券	2020082700002887	利亚德	2020-08-27	426,420.00	61,800.00	14	1.70	281.91	-	-
中信证券	2020090100004443	上海钢联	2020-09-01	784,900.00	10,000.00	14	3.20	976.76	-	-
中信证券	2020090800000381	光线传媒	2020-09-08	392,400.00	24,000.00	14	3.40	518.84	-	-
中信证券	2020090800000443	数码科技	2020-09-08	404,400.00	60,000.00	14	5.20	817.79	-	-
中信证券	2020091000000530	利亚德	2020-09-10	156,800.00	20,000.00	14	3.50	213.42	-	-
中信证券	2020091000000536	中颖电子	2020-09-10	751,680.00	24,000.00	28	3.40	2,058.77	-	-
中信证券	2020091000004467	利亚德	2020-09-10	484,512.00	61,800.00	14	3.50	659.47	-	-
中信证券	2020091700000479	昆仑万维	2020-09-17	1,137,200.00	40,000.00	14	4.70	3,266.29	-	-
中信证券	2020091700000481	华宇软件	2020-09-17	380,072.00	15,400.00	28	3.30	975.52	-	-
中信证券	2020092400000298	健帆生物	2020-09-24	2,448,628.00	36,400.00	14	3.30	3,366.87	-	-
中信证券	2020092400004104	利亚德	2020-09-24	483,894.00	61,800.00	14	3.70	746.00	-	-

中信证券	2020092400004106	利亚德	2020-09-24	156,600.00	20,000.00	14	3.70	241.43	-	-
中信证券	2020100900033111	昆仑万维	2020-10-09	1,074,400.00	40,000.00	14	3.90	1,629.51	-	-
中信证券	2020100900033113	中颖电子	2020-10-09	850,320.00	24,000.00	28	3.40	2,248.62	-	-
中信证券	2020100900034109	利亚德	2020-10-09	158,000.00	20,000.00	14	3.70	227.34	-	-
中信证券	2020100900034111	利亚德	2020-10-09	488,220.00	61,800.00	14	3.70	702.49	-	-
中信证券	2020100900034113	健帆生物	2020-10-09	2,660,476.00	36,400.00	14	3.30	3,414.28	-	-
中信证券	2020101300000774	长信科技	2020-10-13	324,000.00	30,000.00	28	3.40	856.80	-	-
中信证券	2020101300000781	利亚德	2020-10-13	162,200.00	20,000.00	14	3.90	246.00	-	-
中信证券	2020101300000785	顺网科技	2020-10-13	281,100.00	15,000.00	14	3.50	382.61	-	-
中信证券	2020101300000789	汤臣倍健	2020-10-13	2,229,000.00	100,000.00	14	3.50	3,033.92	-	-
中信证券	2020101500000628	掌趣科技	2020-10-15	69,300.00	10,000.00	14	3.50	94.33	-	-
中	2020101500000650	长	2020-10-15	157,200.00	15,000.00	14	3.50	213.97	-	-

信证券		信科技								
中信证券	2020101500000654	顺网科技	2020-10-15	267,450.00	15,000.00	14	3.50	364.03	-	-
中信证券	2020101500000656	光线传媒	2020-10-15	386,400.00	30,000.00	28	3.30	991.76	-	-
中信证券	2020101500002920	华宇软件	2020-10-15	374,528.00	15,400.00	28	3.30	961.29	-	-
中信证券	2020102000000455	汤臣倍健	2020-10-20	619,570.00	26,500.00	28	3.50	1,686.61	-	-
中信证券	2020102200000397	安科生物	2020-10-22	327,015.00	19,500.00	14	3.60	457.82	-	-
中信证券	2020102200000403	汤臣倍健	2020-10-22	620,630.00	26,500.00	28	3.50	1,689.49	-	-
中信证券	2020102300026750	利亚德	2020-10-23	152,600.00	20,000.00	14	3.90	231.44	-	-
中信证券	2020102300026752	利亚德	2020-10-23	471,534.00	61,800.00	14	3.90	715.16	-	-
中信证券	2020102300026756	昆仑万维	2020-10-23	1,005,600.00	40,000.00	14	3.50	1,368.73	-	-
中信证券	2020102700000667	宋城演艺	2020-10-27	2,508,000.00	150,000.00	28	3.20	6,242.13	-	-
中信	2020102700000673	温氏	2020-10-27	10,462,500.00	558,000.00	28	3.20	26,040.00	-	-

证券		股份								
中信证券	2020102700009132	顺网科技	2020-10-27	268,350.00	15,000.00	14	3.50	365.25	-	-
中信证券	2020102700009134	汤臣倍健	2020-10-27	2,401,000.00	100,000.00	14	3.60	3,361.40	-	-
中信证券	2020102700009138	利亚德	2020-10-27	155,600.00	20,000.00	14	4.80	290.45	-	-
中信证券	2020102900002340	掌趣科技	2020-10-29	68,400.00	10,000.00	14	3.70	98.42	-	-
中信证券	2020102900002342	顺网科技	2020-10-29	266,850.00	15,000.00	14	3.50	363.21	-	-
中信证券	2020102900002344	长信科技	2020-10-29	155,100.00	15,000.00	14	3.50	211.11	-	-
中信证券	2020110300000318	华测检测	2020-11-03	327,360.00	12,000.00	14	3.70	471.03	-	-
中信证券	2020110400003333	温氏股份	2020-10-27	167,400.00	-	28	3.20	-	-	-
中信证券	2020110500003418	安科生物	2020-11-05	333,840.00	19,500.00	14	3.60	467.38	-	-
中信证券	2020110600028325	昆仑万维	2020-11-06	916,000.00	40,000.00	14	3.60	1,282.40	-	-
中信证	2020110600030259	利亚德	2020-11-06	441,870.00	61,800.00	14	3.90	670.17	-	-

券										
中信证券	2020110600030265	利亚德	2020-11-06	143,000.00	20,000.00	14	3.90	216.88	-	-
中信证券	2020110600030277	中颖电子	2020-11-06	859,920.00	24,000.00	28	3.50	2,340.89	-	-
中信证券	2020111000000613	掌趣科技	2020-11-10	157,176.00	23,600.00	28	3.30	403.42	-	-
中信证券	2020111000008417	长信科技	2020-11-10	309,300.00	30,000.00	28	3.30	793.87	-	-
中信证券	2020111000008421	利亚德	2020-11-10	152,000.00	20,000.00	14	3.50	206.89	-	-
中信证券	2020111000008423	顺网科技	2020-11-10	256,200.00	15,000.00	14	3.60	358.68	-	-
中信证券	2020111000008425	汤臣倍健	2020-11-10	2,686,000.00	100,000.00	14	3.60	3,760.40	-	-
中信证券	2020111200000704	华测检测	2020-11-12	324,360.00	12,000.00	14	3.30	416.26	-	-
中信证券	2020111200000730	掌趣科技	2020-11-12	62,600.00	10,000.00	14	3.40	82.77	-	-
中信证券	2020111200004305	华宇软件	2020-11-12	374,682.00	15,400.00	28	3.60	1,049.11	-	-
中信证券	2020111200004307	光线传媒	2020-11-12	363,000.00	30,000.00	28	3.40	959.93	-	-

中信证券	2020111200004309	长信科技	2020-11-12	150,300.00	15,000.00	14	3.40	198.73	-	-
中信证券	2020111200004311	顺网科技	2020-11-12	248,850.00	15,000.00	14	3.60	348.39	-	-
中信证券	2020111700000447	汇川技术	2020-11-17	907,500.00	11,000.00	14	3.50	1,235.21	-	-
中信证券	2020111700000449	苏交科	2020-11-17	662,400.00	90,000.00	14	3.50	901.60	-	-
中信证券	2020111900000401	宋城演艺	2020-11-19	1,906,000.00	100,000.00	14	5.60	4,150.84	-	-
中信证券	2020111900004426	安科生物	2020-11-19	320,775.00	19,500.00	14	4.20	523.93	-	-
中信证券	2020112000021451	昆仑万维	2020-11-20	895,600.00	40,000.00	14	3.70	1,288.67	-	-
中信证券	2020112000021471	利亚德	2020-11-20	478,332.00	61,800.00	14	3.20	595.26	-	-
中信证券	2020112000021473	利亚德	2020-11-20	154,800.00	20,000.00	14	3.20	192.64	-	-
中信证券	2020112400000504	数码科技	2020-11-24	53,600.00	10,000.00	14	3.70	77.12	-	-
中信证券	2020112600002684	掌趣科技	2020-11-26	62,000.00	10,000.00	14	3.80	91.62	-	-
中	2020112600002686	顺	2020-11-26	266,850.00	15,000.00	14	3.70	383.97	-	-

信证券		网科技								
中信证券	2020112600002690	长信科技	2020-11-26	146,700.00	15,000.00	14	3.60	205.38	-	-
中信证券	2020121000003950	华宇软件	2020-12-10	398,860.00	15,400.00	28	3.30	767.81	367,598.00	767.81
中信证券	2020121000003952	光线传媒	2020-12-10	375,300.00	30,000.00	28	3.40	744.35	362,100.00	744.35
中信证券	2020121000003954	顺网科技	2020-12-10	251,850.00	15,000.00	14	3.40	333.00	-	-
中信证券	2020121000003956	长信科技	2020-12-10	148,050.00	15,000.00	14	3.60	207.27	-	-
中信证券	2020121000003958	掌趣科技	2020-12-10	58,000.00	10,000.00	14	3.40	76.69	-	-
中信证券	2020121500000633	苏交科	2020-12-15	67,300.00	10,000.00	14	4.70	123.01	-	-
中信证券	2020121500000653	长信科技	2020-12-15	384,000.00	40,000.00	14	3.40	507.73	-	-
中信证券	2020122400001368	顺网科技	2020-12-24	326,035.00	19,700.00	14	3.50	221.89	337,855.00	221.89
中信证券	2020122400013309	掌趣科技	2020-12-24	48,100.00	10,000.00	14	3.50	32.74	51,100.00	32.74
中信	2020122400013311	顺网	2020-12-24	248,250.00	15,000.00	14	1.80	86.89	257,250.00	86.89

证券		科技								
中信证券	2020122400013313	长信科技	2020-12-24	129,600.00	15,000.00	14	3.40	85.68	133,350.00	85.68
中信证券	2020122900000576	掌趣科技	2020-12-29	51,100.00	10,000.00	14	3.50	9.94	51,100.00	9.94
中信证券	2020122900000588	华宇软件	2020-12-29	448,339.00	19,300.00	14	3.50	87.18	460,691.00	87.18
中信证券	2020122900000590	苏交科	2020-12-29	59,400.00	10,000.00	14	4.90	16.17	59,500.00	16.17
中信证券	2020122900000592	数码科技	2020-12-29	46,700.00	10,000.00	14	4.50	11.68	46,700.00	11.68
中信证券	2020122900000594	长信科技	2020-12-29	881,000.00	100,000.00	14	3.50	171.31	889,000.00	171.31
中信证券	2020122900000596	深信服	2020-12-29	2,230,000.00	10,000.00	14	3.30	408.83	2,480,100.00	408.83
中信证券	2020122900007657	长信科技	2020-12-29	352,400.00	40,000.00	14	3.50	68.52	355,600.00	68.52
中信证券	2020122900007661	苏交科	2020-12-29	59,400.00	10,000.00	14	4.80	15.84	59,500.00	15.84

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.4.10.5.2 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 2021 年 12 月 31 日		上年度末 2020 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
华夏创蓝筹 ETF 联接	544,900,000.00	46.18%	1,338,134,861.00	48.18%
中信证券	5,341,582.00	0.45%	33,675,021.00	1.21%

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。

7.4.10.6 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 2021年1月1日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行活期存款	5,673,891.37	47,840.75	4,274,222.55	66,299.73

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国农业银行保管，按银行同业利率或约定利率计息。

7.4.10.7 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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 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	300982	苏文电能	新股发行	3,170	50,181.10
中信证券	300993	玉马遮阳	新股发行	4,097	49,573.70
中信证券	300997	欢乐家	新股发行	9,279	45,838.26
中信证券	300930	屹通新材	新股发行	3,220	42,214.20
中信证券	301028	东亚机械	新股发行	7,329	38,916.99
中信证券	301049	超越科技	新股发行	1,954	37,790.36
中信证券	301055	张小泉	新股发行	3,541	24,432.90
中信证券	300966	共同药业	新股发行	2,858	23,549.92
中信证券	301059	金三江	新股发行	2,581	20,880.29
中信证券	301053	远信工业	新股发行	1,544	18,327.28

中信证券	301062	上海艾录	新股发行	5,225	17,294.75
中信证券	001208	华菱线缆	新股发行	1,754	6,437.18
中信证券	003040	楚天龙	新股发行	1,101	5,086.62
中信证券	001219	青岛食品	新股发行	272	4,678.40
上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 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	300896	爱美客	新股发行	4,730	559,417.10
中信证券	300898	熊猫乳品	新股发行	4,953	53,393.34
中信证券	003013	地铁设计	新股发行	724	9,723.32
中信证券	003018	金富科技	新股发行	1,027	9,171.11
中信证券	003015	日久光电	新股发行	1,128	7,410.96
中信证券	003006	百亚股份	新股发行	804	5,314.44

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

7.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配事项。

7.4.12 期末（2021 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
301029	怡合达	2021-07-14	2022-01-24	新发流通受限	14.14	89.87	462	6,532.68	41,519.94	-
301211	亨迪药业	2021-12-14	2022-06-22	新发流通受限	25.80	33.65	967	24,948.60	32,539.55	-
301127	天源环保	2021-12-23	2022-06-30	新发流通受限	12.03	17.12	1,685	20,270.55	28,847.20	-
301039	中集	2021-07-01	2022-01-10	新发	6.96	12.51	2,064	14,365.44	25,820.64	-

	车辆			流通受限						
301099	雅创电子	2021-11-10	2022-05-23	新发流通受限	21.99	71.36	351	7,718.49	25,047.36	-
301069	凯盛新材	2021-09-16	2022-03-28	新发流通受限	5.17	44.21	539	2,786.63	23,829.19	-
301096	百诚医药	2021-12-13	2022-06-20	新发流通受限	79.60	78.53	245	19,502.00	19,239.85	-
300994	久祺股份	2021-08-02	2022-02-14	新发流通受限	11.90	45.45	420	4,998.00	19,089.00	-
301168	通灵股份	2021-12-02	2022-06-10	新发流通受限	39.08	52.13	329	12,857.32	17,150.77	-
301108	洁雅股份	2021-11-25	2022-06-06	新发流通受限	57.27	53.71	280	16,035.60	15,038.80	-
301179	泽宇智能	2021-12-01	2022-06-08	新发流通受限	43.99	50.77	295	12,977.05	14,977.15	-
301089	拓新药业	2021-10-20	2022-04-27	新发流通受限	19.11	67.93	220	4,204.20	14,944.60	-
301046	能辉科技	2021-08-10	2022-02-17	新发流通受限	8.34	48.99	290	2,418.60	14,207.10	-
301111	粤万年青	2021-11-30	2022-06-07	新发流通受限	10.48	36.68	379	3,971.92	13,901.72	-
301188	力诺特玻	2021-11-04	2022-05-11	新发流通受限	13.00	20.48	647	8,411.00	13,250.56	-
301017	漱玉平民	2021-06-23	2022-01-05	新发流通受限	8.86	23.80	555	4,917.30	13,209.00	-
301020	密封科技	2021-06-28	2022-01-06	新发流通受限	10.64	30.44	421	4,479.44	12,815.24	-
301026	浩通科技	2021-07-08	2022-01-17	新发流通受限	18.03	62.73	203	3,660.09	12,734.19	-

301021	英诺激光	2021-06-28	2022-01-06	新发流通受限	9.46	41.43	290	2,743.40	12,014.70	-
301048	金鹰重工	2021-08-11	2022-02-28	新发流通受限	4.13	12.96	843	3,481.59	10,925.28	-
301028	东亚机械	2021-07-12	2022-01-20	新发流通受限	5.31	13.50	733	3,892.23	9,895.50	-
301045	天禄科技	2021-08-06	2022-02-17	新发流通受限	15.81	28.37	335	5,296.35	9,503.95	-
301078	孩子王	2021-09-30	2022-04-14	新发流通受限	5.77	12.14	756	4,362.12	9,177.84	-
301062	上海艾录	2021-09-07	2022-03-14	新发流通受限	3.31	17.01	523	1,731.13	8,896.23	-
301193	家联科技	2021-12-02	2022-06-09	新发流通受限	30.73	29.14	297	9,126.81	8,654.58	-
301025	读客文化	2021-07-06	2022-01-24	新发流通受限	1.55	20.88	403	624.65	8,414.64	-
301066	万事利	2021-09-13	2022-03-22	新发流通受限	5.24	22.84	344	1,802.56	7,856.96	-
300814	中富电路	2021-08-04	2022-02-14	新发流通受限	8.40	23.88	328	2,755.20	7,832.64	-
301055	张小泉	2021-08-26	2022-03-07	新发流通受限	6.90	21.78	355	2,449.50	7,731.90	-
301133	金钟股份	2021-11-19	2022-05-26	新发流通受限	14.33	26.95	286	4,098.38	7,707.70	-
301198	喜悦智行	2021-11-25	2022-06-02	新发流通受限	21.76	29.20	262	5,701.12	7,650.40	-
301030	仕净科技	2021-07-15	2022-01-24	新发流通受限	6.10	31.52	242	1,476.20	7,627.84	-
301098	金埔园林	2021-11-04	2022-05-12	新发流通	12.36	22.17	307	3,794.52	6,806.19	-

				受限						
301033	迈普医学	2021-07-15	2022-01-26	新发流通受限	15.14	59.97	108	1,635.12	6,476.76	-
301049	超越科技	2021-08-17	2022-02-24	新发流通受限	19.34	32.92	196	3,790.64	6,452.32	-
301032	新柴股份	2021-07-15	2022-01-24	新发流通受限	4.97	12.51	513	2,549.61	6,417.63	-
301056	森赫股份	2021-08-27	2022-03-07	新发流通受限	3.93	11.09	572	2,247.96	6,343.48	-
301036	双乐股份	2021-07-21	2022-02-16	新发流通受限	23.38	29.93	205	4,792.90	6,135.65	-
301041	金百泽	2021-08-02	2022-02-11	新发流通受限	7.31	28.21	215	1,571.65	6,065.15	-
301072	中捷精工	2021-09-22	2022-03-29	新发流通受限	7.46	33.41	181	1,350.26	6,047.21	-
300854	中兰环保	2021-09-08	2022-03-16	新发流通受限	9.96	27.29	203	2,021.88	5,539.87	-
301063	海锅股份	2021-09-09	2022-03-24	新发流通受限	17.40	36.11	153	2,662.20	5,524.83	-
001234	泰慕士	2021-12-31	2022-01-11	新发流通受限	16.53	16.53	333	5,504.49	5,504.49	-
301059	金三江	2021-09-03	2022-03-14	新发流通受限	8.09	19.30	259	2,095.31	4,998.70	-
301027	华蓝集团	2021-07-08	2022-01-19	新发流通受限	11.45	16.65	286	3,274.70	4,761.90	-
301037	保立佳	2021-07-21	2022-02-07	新发流通受限	14.82	24.26	193	2,860.26	4,682.18	-
301073	君亭酒店	2021-09-22	2022-03-30	新发流通受限	12.24	32.00	144	1,762.56	4,608.00	-
301053	远信	2021-08-25	2022-03-01	新发	11.87	28.78	155	1,839.85	4,460.90	-

	工业			流通受限						
301057	汇隆新材	2021-08-31	2022-03-09	新发流通受限	8.03	19.02	218	1,750.54	4,146.36	-
301068	大地海洋	2021-09-16	2022-03-28	新发流通受限	13.98	28.38	144	2,013.12	4,086.72	-
301079	邵阳液压	2021-10-11	2022-04-19	新发流通受限	11.92	24.82	140	1,668.80	3,474.80	-

注：①根据中国证监会《上市公司证券发行管理办法》、《创业板上市公司证券发行管理暂行办法》以及《上市公司非公开发行股票实施细则》，本基金作为特定投资者所认购的 2020 年 2 月 14 日前发行完毕的非公开发行股份，自发行结束之日起 12 个月内不得转让。根据《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》，本基金持有的上市公司非公开发行股份，采取集中竞价交易方式的，在任意连续 90 日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的 1%，且自股份解除限售之日起 12 个月内，通过集中竞价交易减持的数量不得超过本基金持有该次非公开发行股份数量的 50%；采取大宗交易方式的，在任意连续 90 日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的 2%。本基金通过大宗交易方式受让的原上市公司大股东减持或者特定股东减持的股份，在受让后 6 个月内，不得转让所受让的股份。

根据中国证监会《关于修改<上市公司证券发行管理办法>的决定》、《关于修改<创业板上市公司证券发行管理暂行办法>的决定》以及《关于修改<上市公司非公开发行股票实施细则>的决定》，本基金所认购的 2020 年 2 月 14 日(含)后发行完毕的非公开发行股份，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。此外，本基金减持上述非公开发行股份不适用《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》的有关规定。

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股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。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根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于 6 个月的限售期。

⑤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以上“可流通日”是根据上市公司公告估算的流通日期，最终日期以上市公司公告为准。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.12.4 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（单位：股）	期末估值总额
1	300450	先导智能	2022 年 1 月 14 日-2022 年 1 月 14 日	74.37	78,000.00	5,800,860.00
2	300760	迈瑞医疗	2022 年 1 月 3 日-2022 年 1 月 14 日	380.80	11,300.00	4,303,040.00
3	300015	爱尔眼科	2022 年 1 月 7 日-2022 年 1 月 13 日	42.28	96,300.00	4,071,564.00
4	300088	长信科技	2022 年 1 月 6 日-2022 年 1 月 25 日	13.28	293,700.00	3,900,336.00
5	300773	拉卡拉	2022 年 1 月 6 日-2022 年 1 月 13 日	29.02	75,000.00	2,176,500.00
6	300315	掌趣科技	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 14 日	4.86	334,000.00	1,623,240.00
7	300677	英科医疗	2022 年 1 月 6 日-2022 年 1 月 28 日	57.84	24,400.00	1,411,296.00
8	300009	安科生物	2022 年 1 月 4 日	13.09	102,600.00	1,343,034.00

			-2022 年 1 月 14 日			
9	300676	华大基因	2022 年 1 月 5 日 -2022 年 1 月 13 日	87.80	14,900.00	1,308,220.00
10	300188	美亚柏科	2022 年 1 月 11 日 -2022 年 1 月 14 日	17.19	75,000.00	1,289,250.00
11	300348	长亮科技	2022 年 1 月 10 日 -2022 年 1 月 14 日	15.67	72,600.00	1,137,642.00
12	300567	精测电子	2022 年 1 月 13 日 -2022 年 1 月 13 日	72.43	14,600.00	1,057,478.00
13	300369	绿盟科技	2022 年 1 月 6 日 -2022 年 1 月 20 日	15.86	65,200.00	1,034,072.00
14	300036	超图软件	2022 年 1 月 11 日 -2022 年 1 月 11 日	30.05	30,000.00	901,500.00
15	300463	迈克生物	2022 年 1 月 19 日 -2022 年 1 月 19 日	29.19	30,000.00	875,700.00
16	300033	同花顺	2022 年 1 月 3 日 -2022 年 1 月 14 日	144.58	5,900.00	853,022.00
17	300454	深信服	2022 年 1 月 3 日 -2022 年 1 月 5 日	191.00	3,500.00	668,500.00
18	300699	光威复材	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 11 日	84.48	7,900.00	667,392.00
19	300244	迪安诊断	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 6 日	33.57	17,300.00	580,761.00
20	300498	温氏股份	2022 年 1 月 10 日 -2022 年 1 月 13 日	19.26	26,600.00	512,316.00
21	300253	卫宁健康	2022 年 1 月 6 日 -2022 年 1 月 13 日	16.76	21,300.00	356,988.00
22	300017	网宿科技	2022 年 1 月 11 日 -2022 年 1 月 11 日	6.69	47,000.00	314,430.00
23	300529	健帆生物	2022 年 1 月 11 日 -2022 年 1 月 11 日	53.30	3,000.00	159,900.00
24	300285	国瓷材料	2022 年 1 月 6 日 -2022 年 1 月 6 日	42.57	3,000.00	127,710.00
25	300327	中颖电子	2022 年 1 月 13 日 -2022 年 1 月 13 日	67.90	1,000.00	67,900.00
26	300379	东方通	2022 年 1 月 14 日 -2022 年 1 月 14 日	29.53	1,000.00	29,530.00
合计					1,455,100.00	36,572,181.00

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。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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内。

7.4.13.2 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。

7.4.13.3 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“7.4.12 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。

7.4.13.3.1 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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日		上年度末 2020 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净	公允价值	占基金资产净

		值比例（%）		值比例（%）
交易性金融资产－股票投资	755,978,062.58	98.88	1,784,762,463.02	99.34
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
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	755,978,062.58	98.88	1,784,762,463.02	99.34

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。

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除创业板低波蓝筹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 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
	-5%	-34,824,727.46	-82,971,882.81
	+5%	34,824,727.46	82,971,882.81

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

（1）金融工具公允价值计量的方法

根据企业会计准则的相关规定，以公允价值计量的金融工具，其公允价值的计量可分为三个层次：

第一层次：对存在活跃市场报价的金融工具，可以相同资产/负债在活跃市场上的报价确定公允价值。

第二层次：对估值日活跃市场无报价的金融工具，可以类似资产/负债在活跃市场上的报价为依据做必要调整确定公允价值；对估值日不存在活跃市场的金融工具，可以相同或类似资产/负债在非活跃市场上的报价为依据做必要调整确定公允价值。

第三层次：对无法获得相同或类似资产可比市场交易价格的金融工具，可以其他反映市场参与者对资产/负债定价时所使用的参数为依据确定公允价值。

（2） 各层次金融工具公允价值

截至 2021 年 12 月 31 日止，本基金持有的以公允价值计量的金融工具第一层次的余额为 755,398,981.91 元，第二层次的余额为 579,080.67 元，第三层次的余额为 0 元。（截至 2020 年 12 月 31 日止：第一层次的余额为 1,782,882,946.59 元，第二层次的余额为 1,879,516.43 元，第三层次的余额为 0 元。）

（3）公允价值所属层次间的重大变动

对于特殊事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)的股票，本基金将相关股票公允价值所属层次于其进行估值调整之日起从第一层次转入第二层次或第三层次，于股票复牌能体现公允价值并恢复市价估值之日起从第二层次或第三层次转入第一层次。对于持有的非公开发行股票，本基金于限售期内将相关股票公允价值所属层次列入第二层次，于限售期满并恢复市价估值之日起从第二层次转入第一层次。

（4）第三层次公允价值本期变动金额

本基金持有的以公允价值计量的金融工具第三层次公允价值本期未发生变动。

（5）新金融工具准则

根据财政部发布的《企业会计准则第 22 号－金融工具确认计量》、《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》和《企业会计准则第 37 号-金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”)相关衔接规定，以及财政部、银保监会于 2020 年 12 月 30 日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金应当自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。

除公允价值和执行新金融工具准则外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 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	755,978,062.58	98.77
	其中：股票	755,978,062.58	98.77
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	8,263,424.37	1.08

8	其他各项资产	1,164,782.00	0.15
9	合计	765,406,268.95	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 36,572,181.00 元，占本基金期末资产净值的 4.78%。

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	30,128,822.46	3.94
B	采矿业	-	-
C	制造业	500,213,121.14	65.43
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	6,806.19	0.00
F	批发和零售业	47,434.20	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	4,608.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	95,792,244.08	12.53
J	金融业	19,346,538.96	2.53
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	6,488,876.26	0.85
M	科学研究和技术服务业	42,943,848.20	5.62
N	水利、环境和公共设施管理业	40,839.39	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	48,127,785.06	6.29
R	文化、体育和娱乐业	12,837,138.64	1.68
S	综合	-	-
	合计	755,978,062.58	98.88

8.3 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	300760	迈瑞医疗	204,574	77,901,779.20	10.19
2	300124	汇川技术	670,401	45,989,508.60	6.02
3	300015	爱尔眼科	944,121	39,917,435.88	5.22
4	300274	阳光电源	246,900	35,998,020.00	4.71
5	300750	宁德时代	58,500	34,398,000.00	4.50
6	300782	卓胜微	104,501	34,150,926.80	4.47
7	300498	温氏股份	1,564,321	30,128,822.46	3.94

8	300012	华测检测	1,047,505	28,146,459.35	3.68
9	300450	先导智能	372,344	27,691,223.28	3.62
10	300454	深信服	104,195	19,901,245.00	2.60
11	300033	同花顺	133,812	19,346,538.96	2.53
12	300699	光威复材	225,710	19,067,980.80	2.49
13	300088	长信科技	1,271,650	16,887,512.00	2.21
14	300285	国瓷材料	389,532	16,582,377.24	2.17
15	300676	华大基因	168,100	14,759,180.00	1.93
16	300253	卫宁健康	841,500	14,103,540.00	1.84
17	300413	芒果超媒	224,200	12,828,724.00	1.68
18	300661	圣邦股份	41,057	12,686,613.00	1.66
19	300529	健帆生物	237,691	12,668,930.30	1.66
20	300628	亿联网络	154,100	12,551,445.00	1.64
21	300677	英科医疗	209,450	12,114,588.00	1.58
22	300408	三环集团	258,503	11,529,233.80	1.51
23	300316	晶盛机电	159,000	11,050,500.00	1.45
24	300773	拉卡拉	355,860	10,327,057.20	1.35
25	300777	中简科技	163,900	10,142,132.00	1.33
26	300751	迈为股份	15,385	9,881,785.50	1.29
27	300009	安科生物	704,769	9,225,426.21	1.21
28	300558	贝达药业	111,349	8,888,990.67	1.16
29	300136	信维通信	345,400	8,745,528.00	1.14
30	300315	掌趣科技	1,742,841	8,470,207.26	1.11
31	300122	智飞生物	67,883	8,458,221.80	1.11
32	300244	迪安诊断	244,574	8,210,349.18	1.07
33	300327	中颖电子	120,883	8,207,955.70	1.07
34	300674	宇信科技	328,980	7,862,622.00	1.03
35	300151	昌红科技	176,300	7,210,670.00	0.94
36	300685	艾德生物	92,494	6,984,221.94	0.91
37	300348	长亮科技	442,200	6,929,274.00	0.91
38	300357	我武生物	113,888	6,525,782.40	0.85
39	300662	科锐国际	104,306	6,488,876.26	0.85
40	300747	锐科激光	104,350	6,168,128.50	0.81
41	300036	超图软件	201,408	6,052,310.40	0.79
42	300567	精测电子	81,900	5,932,017.00	0.78
43	300188	美亚柏科	342,649	5,890,136.31	0.77
44	300298	三诺生物	196,626	5,881,083.66	0.77
45	300369	绿盟科技	365,676	5,799,621.36	0.76
46	300638	广和通	105,600	5,755,200.00	0.75
47	300017	网宿科技	852,800	5,705,232.00	0.75
48	300463	迈克生物	191,700	5,595,723.00	0.73
49	300627	华测导航	106,920	4,918,320.00	0.64
50	300379	东方通	160,380	4,736,021.40	0.62
51	301029	怡合达	462	41,519.94	0.01

52	301211	亨迪药业	967	32,539.55	0.00
53	301127	天源环保	1,685	28,847.20	0.00
54	301039	中集车辆	2,064	25,820.64	0.00
55	301099	雅创电子	351	25,047.36	0.00
56	301069	凯盛新材	539	23,829.19	0.00
57	301096	百诚医药	245	19,239.85	0.00
58	300994	久祺股份	420	19,089.00	0.00
59	301168	通灵股份	329	17,150.77	0.00
60	301108	洁雅股份	280	15,038.80	0.00
61	301179	泽宇智能	295	14,977.15	0.00
62	301089	拓新药业	220	14,944.60	0.00
63	301046	能辉科技	290	14,207.10	0.00
64	301111	粤万年青	379	13,901.72	0.00
65	301188	力诺特玻	647	13,250.56	0.00
66	301017	漱玉平民	555	13,209.00	0.00
67	301020	密封科技	421	12,815.24	0.00
68	301026	浩通科技	203	12,734.19	0.00
69	301021	英诺激光	290	12,014.70	0.00
70	301048	金鹰重工	843	10,925.28	0.00
71	301028	东亚机械	733	9,895.50	0.00
72	301045	天禄科技	335	9,503.95	0.00
73	301078	孩子王	756	9,177.84	0.00
74	301062	上海艾录	523	8,896.23	0.00
75	301193	家联科技	297	8,654.58	0.00
76	301025	读客文化	403	8,414.64	0.00
77	301066	万事利	344	7,856.96	0.00
78	300814	中富电路	328	7,832.64	0.00
79	301055	张小泉	355	7,731.90	0.00
80	301133	金钟股份	286	7,707.70	0.00
81	301198	喜悦智行	262	7,650.40	0.00
82	301030	仕净科技	242	7,627.84	0.00
83	301098	金埔园林	307	6,806.19	0.00
84	301033	迈普医学	108	6,476.76	0.00
85	301049	超越科技	196	6,452.32	0.00
86	301032	新柴股份	513	6,417.63	0.00
87	301056	森赫股份	572	6,343.48	0.00
88	301036	双乐股份	205	6,135.65	0.00
89	301041	金百泽	215	6,065.15	0.00
90	301072	中捷精工	181	6,047.21	0.00
91	300854	中兰环保	203	5,539.87	0.00
92	301063	海锅股份	153	5,524.83	0.00
93	001234	泰慕士	333	5,504.49	0.00
94	301059	金三江	259	4,998.70	0.00
95	301027	华蓝集团	286	4,761.90	0.00

96	301037	保立佳	193	4,682.18	0.00
97	301073	君亭酒店	144	4,608.00	0.00
98	301053	远信工业	155	4,460.90	0.00
99	301057	汇隆新材	218	4,146.36	0.00
100	301068	大地海洋	144	4,086.72	0.00
101	301079	邵阳液压	140	3,474.80	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	117,652,157.14	6.55
2	300782	卓胜微	49,269,277.53	2.74
3	300124	汇川技术	33,507,540.00	1.87
4	300413	芒果超媒	33,472,147.94	1.86
5	300274	阳光电源	29,015,723.00	1.62
6	300015	爱尔眼科	25,534,324.30	1.42
7	300760	迈瑞医疗	21,550,691.17	1.20
8	300676	华大基因	20,051,325.00	1.12
9	300558	贝达药业	16,630,460.77	0.93
10	300628	亿联网络	15,901,177.75	0.89
11	300661	圣邦股份	15,798,145.00	0.88
12	300450	先导智能	15,332,443.49	0.85
13	300677	英科医疗	15,297,168.53	0.85
14	300773	拉卡拉	15,122,395.00	0.84
15	300253	卫宁健康	14,107,876.80	0.79
16	300146	汤臣倍健	13,257,870.00	0.74
17	300285	国瓷材料	12,840,908.62	0.71
18	300408	三环集团	12,561,014.16	0.70
19	300348	长亮科技	11,216,540.88	0.62
20	300751	迈为股份	10,503,997.84	0.58

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。

8.4.2 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	82,066,379.74	4.57
2	300760	迈瑞医疗	58,040,104.10	3.23
3	300015	爱尔眼科	38,836,107.92	2.16

4	300498	温氏股份	34,633,887.20	1.93
5	300408	三环集团	30,447,524.22	1.69
6	300146	汤臣倍健	28,222,590.74	1.57
7	300601	康泰生物	25,611,877.01	1.43
8	300144	宋城演艺	22,487,986.12	1.25
9	300454	深信服	22,483,916.00	1.25
10	300012	华测检测	19,874,104.62	1.11
11	300003	乐普医疗	18,711,128.68	1.04
12	300450	先导智能	18,514,872.46	1.03
13	300661	圣邦股份	16,240,797.00	0.90
14	300496	中科创达	15,763,665.30	0.88
15	300529	健帆生物	15,404,906.00	0.86
16	300033	同花顺	13,971,037.00	0.78
17	300124	汇川技术	13,145,557.00	0.73
18	300271	华宇软件	9,612,551.52	0.54
19	300747	锐科激光	9,035,732.60	0.50
20	300079	数码视讯	7,794,588.50	0.43

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。

8.4.3 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	782,855,496.19
卖出股票收入（成交）总额	709,498,377.98

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。

8.5 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。

8.6 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。

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）（手）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
IC2203	中证 500 股指期货 IC2203 合约	5	7,305,800.00	368,560.00	买入股指期货合约的目的是进行更有效地流动性管理，实现投资目标。
公允价值变动总额合计（元）					368,560.00
股指期货投资本期收益（元）					2,174,906.41
股指期货投资本期公允价值变动（元）					257,400.00

8.10.2 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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 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。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无国债期货投资。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货投资。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 报告期内，本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求，未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.12.2 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。

8.12.3 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	1,127,571.37
2	应收证券清算款	22,345.71
3	应收股利	-
4	应收利息	14,864.92
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,164,782.00

8.12.4 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。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300450	先导智能	5,800,860.00	0.76	转融通出借证券受限
2	300760	迈瑞医疗	4,303,040.00	0.56	转融通出借证券受限
3	300015	爱尔眼科	4,071,564.00	0.53	转融通出借证券受限
4	300454	深信服	668,500.00	0.09	转融通出借证券受限
5	300498	温氏股份	512,316.00	0.07	转融通出借证券受限

8.12.6 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。

§9 基金份额持有人信息

9.1 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		华夏创蓝筹 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
11,957	98,678.56	270,207,333.00	22.90%	364,792,188.00	30.92%	544,900,000.00	46.18%

9.2 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	上海东证期货－工商银行－东证期货工银慧享二号集合资产管理计划	108,783,200.00	9.22%
2	中国人寿保险股份有限公司	56,529,774.00	4.79%
3	中信期货－工商银行－中信期货灵活配置 2 号集合资产管理计划	46,871,600.00	3.97%
4	平安资管－工商银行－平安资产鑫享	9,299,600.00	0.79%

	32 号资产管理产品		
5	光大理财有限责任公司－阳光橙增盈稳健 3 号	7,250,561.00	0.61%
6	海通证券股份有限公司	6,679,984.00	0.57%
7	中信证券股份有限公司	5,341,582.00	0.45%
8	姚燕青	5,000,104.00	0.42%
9	马双山	4,947,000.00	0.42%
10	张超	4,300,600.00	0.36%
11	中国农业银行股份有限公司－华夏创业板低波蓝筹交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	544,900,000.00	46.18%

9.3 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	-	-

9.4 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

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2019 年 6 月 14 日)基金份额总额	354,550,619.00
本报告期期初基金份额总额	2,777,099,521.00
本报告期基金总申购份额	1,782,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	3,379,200,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,179,899,521.00

§11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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

本基金管理人于 2021 年 4 月 9 日发布公告，郑煜女士、孙彬先生担任华夏基金管理有限公司副

总经理，蔡向阳先生担任华夏基金管理有限公司高级管理人员。

本基金管理人于 2021 年 11 月 2 日发布公告，蔡向阳先生不再担任华夏基金管理有限公司高级管理人员。

2021 年 5 月，中国农业银行总行决定谭敦宇任托管业务部总裁。

2021 年 8 月，中国农业银行总行决定王霄勇任托管业务部副总裁。

11.3 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。

11.4 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。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期应支付给安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为 80,000 元人民币。截至本报告期末，该事务所已向本基金提供 3 年的审计服务。

11.6 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	615,761,966.81	41.42%	265,579.81	41.42%	-
方正证券	2	408,527,187.01	27.48%	176,199.06	27.48%	-
中信证券	10	236,774,409.88	15.93%	102,120.96	15.93%	-
华泰证券	1	215,883,774.59	14.52%	93,112.05	14.52%	-
招商证券	1	9,734,848.48	0.65%	4,198.71	0.65%	-

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，在近一年内无重大违规行为。

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有较强的研究能力，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。

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对交易单元候选券商的研究服务进行评估

本基金管理人组织相关人员依据交易单元选择标准对交易单元候选券商的服务质量和研究实力进行评估，确定选用交易单元的券商。

ⅱ协议签署及通知托管人

本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。

③除本表列示外，本基金还选择了长江证券、东方证券、高华证券、国泰君安证券、西部证券、中金公司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，中金公司、中信证券的部分交易单元为本基金本期新增的交易单元，中信证券的部分交易单元为本期剔除的交易单元。

11.7.2 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	
	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
广发证券	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-
中信证券	1,193,017.65	69.95%	-	-
华泰证券	-	-	-	-
招商证券	512,453.43	30.05%	-	-

11.8 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	2021-01-09
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	2021-01-15
3	华夏基金管理有限公司关于终止部分代销机构办理本公司旗下基金销售业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-01-20
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	2021-01-27
5	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	2021-02-01
6	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关	中国证监会指定报刊及	2021-02-24

	联方承销证券的公告	网站	
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	2021-03-12
8	华夏基金管理有限公司关于华夏创业板低波蓝筹交易型开放式指数证券投资基金流动性服务商的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-22
9	华夏基金管理有限公司关于根据《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号-指数基金指引》修订旗下部分公募基金基金合同的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-29
10	华夏基金管理有限公司关于华夏创业板低波蓝筹交易型开放式指数证券投资基金流动性服务商的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-29
11	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	2021-04-02
12	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	2021-04-07
13	华夏基金管理有限公司公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-09
14	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	2021-04-09
15	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	2021-04-21
16	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	2021-05-08
17	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	2021-05-12
18	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	2021-05-13
19	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	2021-05-19
20	华夏基金管理有限公司关于深圳分公司营业场所变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-05-25
21	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	2021-05-28
22	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	2021-06-04
23	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	2021-06-09
24	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	2021-06-17
25	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	2021-07-14
26	华夏基金管理有限公司关于华夏创业板低波蓝筹交易型开放式指数证券投资基金流动性	中国证监会指定报刊及网站	2021-08-18

	服务商的公告		
27	华夏基金管理有限公司关于旗下深交所基金新增扩位简称的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-08-21
28	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	2021-10-13
29	华夏基金管理有限公司关于华夏创业板低波蓝筹交易型开放式指数证券投资基金新增流动性服务商的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-10-29
30	华夏基金管理有限公司公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-11-02

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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
华夏创蓝筹ETF联接	1	2021-01-01至2021-12-31	1,338,134,861.00	98,903,072.00	892,137,933.00	544,900,000.00	46.18%
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。							

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

1、中国证监会准予基金注册的文件；

2、《华夏创业板低波蓝筹交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；

3、《华夏创业板低波蓝筹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。

13.2 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。

13.3 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

二〇二二年三月三十日