

**华夏野村日经 225 交易型开放式指数
证券投资基金（QDII）
2019 年第 3 季度报告
2019 年 9 月 30 日**

基金管理人：华夏基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一九年十月二十二日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 10 月 18 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华夏野村日经 225ETF
场内简称	日经 ETF
基金主代码	513520
交易代码	513520
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2019 年 6 月 12 日
报告期末基金份额总额	43,287,188.00 份
投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	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。同时，为了更好地实现本基金的投资目标，本基金可适当借出证券。本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.3%，年跟踪误差不超过 3.0%。
业绩比较基准	经估值汇率调整后的日经 225 指数收益率。
风险收益特征	<p>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。基金主要投资于跟踪标的指数的 ETF 产品，在股票基金中属于高风险等级产品。</p> <p>本基金为境外证券投资的基金，主要投资于日本证券市场中具有良好流动性的 ETF 产品。除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、日本市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。</p>
基金管理人	华夏基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
境外资产托管人英文名称	Brown Brothers Harriman & Co.,
境外资产托管人中文名称	布朗兄弟哈里曼公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期
	(2019 年 7 月 1 日-2019 年 9 月 30 日)
1.本期已实现收益	3,885,008.19
2.本期利润	4,537,824.44
3.加权平均基金份额本期利润	0.0550
4.期末基金资产净值	45,489,649.10
5.期末基金份额净值	1.0509

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

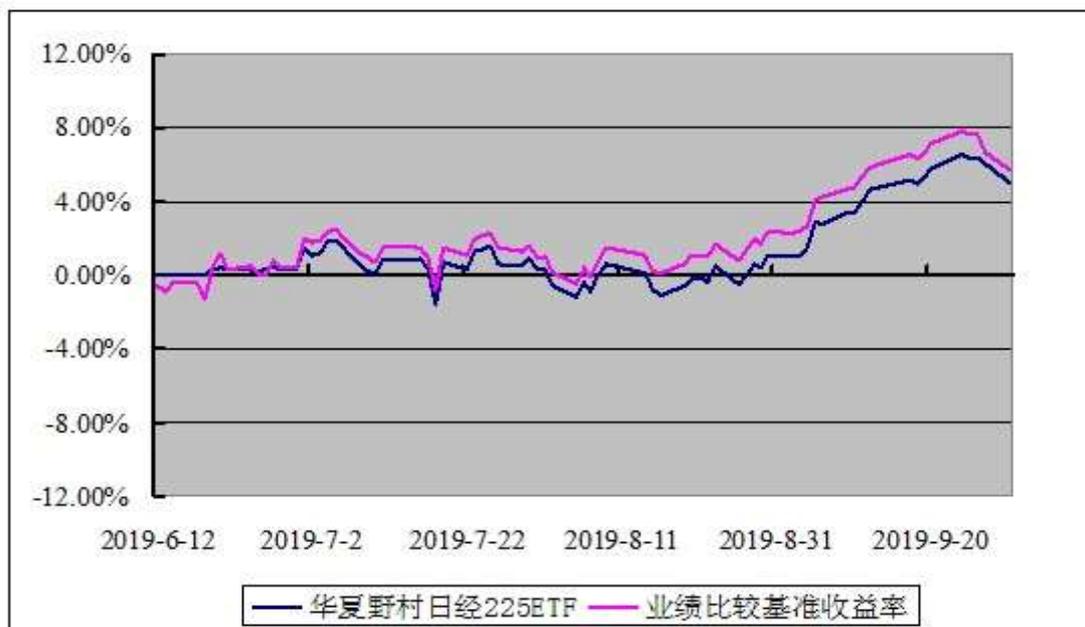
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	4.78%	0.68%	5.27%	0.69%	-0.49%	-0.01%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额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

华夏野村日经 225 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII)

累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2019 年 6 月 12 日至 2019 年 9 月 30 日)



注：①本基金合同于 2019 年 6 月 12 日生效。

②根据华夏野村日经 225 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 基金的基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同第十二部分“二、投资范围”、“四、投资限制”的有关约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
赵宗庭	本基金的基金经理、数量投资部高级副总裁	2019-06-12	-	11 年	对外经济贸易大学经济学硕士。曾任华夏基金管理有限公司研究发展部产品经理、数量投资部研究员，嘉实基金管理有限公司指数投资部基金经理助理，嘉实国际资产管理有限公司基金经理。2016 年 11 月加入华夏基金管理有限公司。

注：①上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

②证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基

金运作管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《基金管理公司开展投资、研究活动防控内幕交易指导意见》等法律法规和基金合同，本着诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在严格控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《华夏基金管理有限公司公平交易制度》的规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，未出现涉及本基金的交易所公开竞价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 5% 的情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

3 季度，尽管出口、生产和企业信心受到海外经济放缓的影响，但日本工业生产基本持平，整体经济仍处于温和增长趋势，这主要得益于日本强韧的内需。货币政策方面，日本央行货币政策会议决定维持此前宽松政策不变，继续实施收益率曲线管理下的量化和质化宽松货币政策 (QQE)，维持部分超额准备金利率为-0.1%，10 年期国债收益率在零左右，维持资产购买计划不变，并计划继续保持目前极低的利率水平至少至 2020 年春季左右。

市场方面，伴随着中美贸易摩擦的加剧，日本市场对全球经济放缓的担忧有所增加，加上受日元升值、美元贬值而导致公司业绩下滑担忧的影响，行情大幅走低；进入 9 月，受中美贸易谈判对峙减弱，以及日元贬值有利于日本制造业的出口和盈利的影响，日经 225 指数出现强劲反弹。

基金投资运作方面，报告期内，本基金进行了建仓操作，在做好跟踪标的指数的基础上，认真应对投资者日常申购、赎回等工作。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2019 年 9 月 30 日，本基金份额净值为 1.0509 元，本报告期份额净值增长率为 4.78%，同期经估值汇率调整的业绩比较基准增长率为 5.27%。本基金本报告期跟踪偏离度为-0.49%，与业绩比较基准产生偏离的主要原因为基金尚处于建仓期，基金组合的结构与指数结构尚存在差异。

4.5 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中：普通股	-	-
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托	-	-
2	基金投资	41,092,408.61	86.07
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	6,041,987.29	12.66
8	其他各项资产	608,705.38	1.27

9	合计	47,743,101.28	100.00
---	----	---------------	--------

注：基金投资的公允价值包括可退替代款的估值增值。

5.2 报告期末在各个国家（地区）证券市场的股票及存托凭证投资分布

本基金本报告期末未持有权益投资。

5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

本基金本报告期末未持有权益投资。

5.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票及存托凭证投资明细

本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.5 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

序号	衍生品类别	衍生品名称	公允价值 (元)	占基金资产 净值比例 (%)
1	股指期货	NIKKEI 225 (OSE) Dec19	-	-
2	-	-	-	-
3	-	-	-	-
4	-	-	-	-
5	-	-	-	-

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，具体投资情况详见

下表（买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示）：

代码	名称	持仓量 (买/卖) (单位： 手)	合约市值	公允价值变动
NKZ9 OSE	NIKKEI 225 (OSE) Dec19	3	4,288,830.72	54,082.59
公允价值变动总额合计				54,082.59
股指期货投资本期收益				-122,036.09

股指期货投资本期公允价值变动	54,082.59
----------------	-----------

5.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值 (元)	占基金资产 净值比例 (%)
1	NOMURA ETF-NIKK EI 225	股票型	交易型开放 式	Nomura Asset Managemen t Co.,Ltd.	41,092,408.61	90.33
2	-	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-	-
6	-	-	-	-	-	-
7	-	-	-	-	-	-
8	-	-	-	-	-	-
9	-	-	-	-	-	-
10	-	-	-	-	-	-

5.10 投资组合报告附注

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

5.10.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	186,995.78
2	应收证券清算款	420,437.47
3	应收股利	-
4	应收利息	1,272.13
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	608,705.38

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	214,487,188.00
报告期基金总申购份额	5,200,000.00
减：报告期基金总赎回份额	176,400,000.00
报告期基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	43,287,188.00

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况

本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

1、报告期内披露的主要事项

2019 年 7 月 3 日发布华夏基金管理有限公司关于华夏野村日经 225 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 新增申购赎回代办证券公司的公告。

2019 年 7 月 10 日发布华夏基金管理有限公司关于华夏野村日经 225 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 在境外主要投资场所 2019 年节假日暂停申购、赎回业务的公告。

2019 年 7 月 12 日发布华夏基金管理有限公司关于华夏野村日经 225 交易型开放式指数证券投资

资基金 (QDII) 新增申购赎回代办证券公司的公告。

2019 年 8 月 7 日发布华夏基金管理有限公司关于华夏野村日经 225 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 暂停申购、赎回业务的公告。

2019 年 9 月 10 日发布华夏基金管理有限公司关于华夏野村日经 225 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 暂停申购、赎回业务。

2019 年 9 月 18 日发布华夏基金管理有限公司关于华夏野村日经 225 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 暂停申购、赎回业务。

2、其他相关信息

华夏基金管理有限公司成立于 1998 年 4 月 9 日,是经中国证监会批准成立的首批全国性基金管理公司之一。公司总部设在北京,在北京、上海、深圳、成都、南京、杭州、广州和青岛设有分公司,在香港、深圳、上海设有子公司。公司是首批全国社保基金管理人、首批企业年金基金管理人、境内首批 QDII 基金管理人、境内首只 ETF 基金管理人、境内首只沪港通 ETF 基金管理人、首批内地与香港基金互认基金管理人、首批基本养老保险基金投资管理人资格、首家加入联合国责任投资原则组织的公募基金公司、首批公募 FOF 基金管理人、首批公募养老目标基金管理人、境内首批中日互通 ETF 基金管理人,首批商品期货 ETF 基金管理人,以及特定客户资产管理人、保险资金投资管理人,香港子公司是首批 RQFII 基金管理人。华夏基金是业务领域最广泛的基金管理公司之一。

华夏基金是境内 ETF 基金资产管理规模最大的基金管理公司之一,在 ETF 基金管理方面积累了丰富的经验,目前旗下管理华夏上证 50ETF、华夏沪深 300ETF、华夏 MSCI 中国 A 股国际通 ETF、华夏恒生 ETF、华夏沪港通恒生 ETF、华夏野村日经 225ETF、华夏中证 500ETF、华夏中小板 ETF、华夏创业板 ETF、华夏中证央企 ETF、华夏中证四川国改 ETF、华夏战略新兴成指 ETF、5GETF、华夏消费 ETF、华夏金融 ETF、华夏医药 ETF、华夏证券 ETF、华夏创蓝筹 ETF、华夏创成长 ETF、华夏快线货币 ETF、华夏 3-5 年中高级可质押信用债 ETF、华夏豆粕 ETF,初步形成了覆盖宽基指数、大盘蓝筹指数、中小创指数、主题指数、行业指数、Smart Beta 策略、A 股市场指数、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基金业绩统计报告,在基金分类排名中(截至 2019 年 9 月 30 日数据),华夏移动互联混合(QDII)及华夏全球科技先锋混合(QDII)在“QDII 基金-QDII 混合基金-QDII 混合基金(A 类)”中分别排序 2/33 和 7/33;华夏海外收益债券(QDII)(C 类)及华夏大中华信用债券(QDII)(C 类)在“QDII 基金-QDII 债券基金-QDII 债券型基金(非 A 类)”中分别排序 4/29 和 8/29;华夏鼎沛债券(A 类)在“债券基金-普通债券型基金-普通债券型基金(二级)(A 类)”中排序 2/225;华夏恒融定开债券在“债券

基金-定期开放式普通债券型基金-定期开放式普通债券型基金(二级)(A类)”中排序 8/18; 华夏债券(C类)及华夏双债债券(C类)在“债券基金-普通债券型基金-普通债券型基金(可投转债)(非 A类)”分别排序 9/105 和 7/105; 华夏聚利债券在“债券基金-普通债券型基金-普通债券型基金(可投转债)(A类)”中排名 9/169; 华夏医疗健康混合(C类)在“混合基金-偏股型基金-普通偏股型基金(非 A类)”中排序 4/19; 华夏创业板 ETF 在“股票基金-股票 ETF 基金-规模指数股票 ETF 基金”中排序 7/59; 华夏消费 ETF 在“股票基金-股票 ETF 基金-行业指数股票 ETF 基金”排序 4/31; 华夏战略新兴成指 ETF 在“股票基金-股票 ETF 基金-主题指数股票 ETF 基金”排序 8/31; 华夏创业板 ETF 联接(A类)及华夏 MSCI 中国 A 股国际通 ETF 联接(A类)在“股票基金-股票 ETF 联接基金-规模指数股票 ETF 联接基金(A类)”中排序 5/46 和 9/46。

在客户服务方面, 3 季度, 华夏基金继续以客户需求为导向, 努力提高客户使用的便利性和服务体验: (1) 直销电子交易平台开通华夏沃利货币 A 的快速赎回业务, 华夏基金管家 APP、华夏基金微信公众号上线智能快取功能, 满足了广大投资者对资金流动的迫切需求; (2) 华夏基金净值服务全面升级为微信实时查看、订阅推送模式, 方便客户及时、精准查询基金净值变动情况; (3) 与万和证券、五矿证券、阳光人寿等代销机构合作, 提供更多便捷的理财渠道; (4) 开展“微信全勤奖”、“户龄(第三期)”、“看谁能猜中”、“寻人启事”等活动, 为客户提供了多样化的投资者教育和关怀服务。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 9.1.1 中国证监会准予基金注册的文件;
- 9.1.2 《华夏野村日经 225 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 基金合同》;
- 9.1.3 《华夏野村日经 225 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 托管协议》;
- 9.1.4 法律意见书;
- 9.1.5 基金管理人业务资格批件、营业执照;
- 9.1.6 基金托管人业务资格批件、营业执照。

9.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

9.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的住所免费查阅备查文件。在支付工本费后, 投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

华夏基金管理有限公司

二〇一九年十月二十二日