

**华夏中证 1000 交易型开放式指数**

**证券投资基金发起式联接基金**

**2022 年第 3 季度报告**

**2022 年 9 月 30 日**

基金管理人：华夏基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二二年十月二十五日

## §1 重要提示

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

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 10 月 21 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

## §2 基金产品概况

基金简称	华夏中证 1000ETF 发起式联接	
基金主代码	013922	
交易代码	013922	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022 年 1 月 25 日	
报告期末基金份额总额	115,200,139.82 份	
投资目标	通过对目标 ETF 基金份额的投资，追求跟踪标的指数，获得与指数收益相似的回报。本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。	
投资策略	主要投资策略包括目标 ETF 投资策略，股票投资策略，存托凭证投资策略，债券投资策略，衍生品投资策略，资产支持证券投资策略，可转换债券、可交换债券投资策略，参与转融通证券出借业务策略等。	
业绩比较基准	中证 1000 指数收益率×95%+人民币活期存款税后利率×5%	
风险收益特征	本基金为目标 ETF 的联接基金，目标 ETF 为股票型指数基金，因此本基金的风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。	
基金管理人	华夏基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	华夏中证 1000ETF 发起式联接 A	华夏中证 1000ETF 发起式联接 C
下属分级基金的交易代码	013922	013923
报告期末下属分级基金的份额总额	69,584,254.06 份	45,615,885.76 份

### 2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	华夏中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	159845

基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2021 年 3 月 18 日
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2021 年 3 月 31 日
基金管理人名称	华夏基金管理有限公司
基金托管人名称	招商银行股份有限公司

### 2.1.2 目标基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。
投资策略	主要投资策略包括完全复制策略，替代性策略，存托凭证投资策略，债券投资策略，资产支持证券投资策略，股指期货投资策略，国债期货投资策略，股票期权投资策略，融资、转融通证券出借业务投资策略等。
业绩比较基准	中证 1000 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。

## §3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期 (2022 年 7 月 1 日-2022 年 9 月 30 日)	
	华夏中证 1000ETF 发起式联接 A	华夏中证 1000ETF 发起式联接 C
1. 本期已实现收益	-443,771.11	-312,583.82
2. 本期利润	-8,194,127.72	-6,068,439.01
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.1567	-0.2294
4. 期末基金资产净值	60,393,471.21	39,513,129.39
5. 期末基金份额	0.8679	0.8662

净值		
----	--	--

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

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

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华夏中证1000ETF发起式联接A:

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	-11.89%	1.27%	-11.83%	1.27%	-0.06%	0.00%
过去六个月	-8.47%	1.62%	-9.01%	1.63%	0.54%	-0.01%
自基金合同生效起至今	-13.21%	1.57%	-16.61%	1.64%	3.40%	-0.07%

华夏中证1000ETF发起式联接C:

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	-11.95%	1.27%	-11.83%	1.27%	-0.12%	0.00%
过去六个月	-8.60%	1.62%	-9.01%	1.63%	0.41%	-0.01%
自基金合同生效起至今	-13.38%	1.57%	-16.61%	1.64%	3.23%	-0.07%

#### 3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

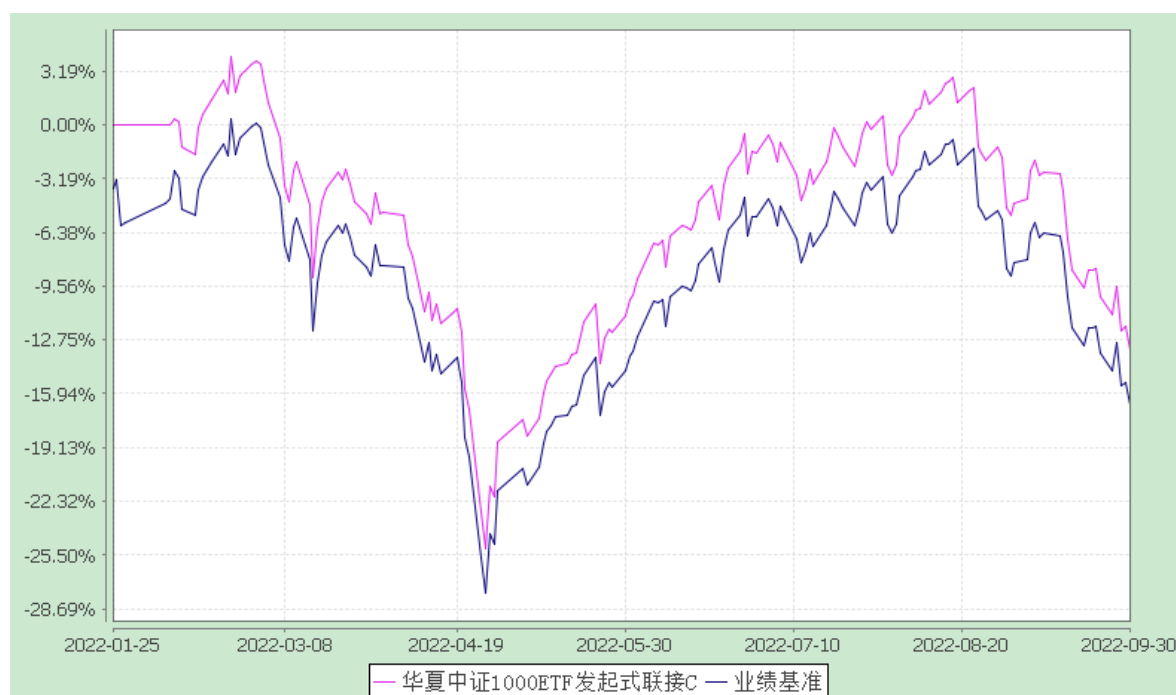
华夏中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金  
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2022 年 1 月 25 日至 2022 年 9 月 30 日)

华夏中证 1000ETF 发起式联接 A:



华夏中证 1000ETF 发起式联接 C:



注：①本基金合同于 2022 年 1 月 25 日生效。

②根据本基金的基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同中投资范围、投资限制的有关约定。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金经理（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		
严筱娴	本基金的基金经理	2022-01-25	-	7 年	硕士。2015 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、基金经理助理。

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

②证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

### 4.3 公平交易专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，本基金管理人旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 25 次，均为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。

#### 4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金跟踪的标的指数为中证 1000 指数,业绩比较基准为:中证 1000 指数收益率\*95%+人民币活期存款利率(税后)\*5%。中证 1000 指数由全部 A 股中剔除中证 800 指数成份股后,规模偏小且流动性好的 1000 只股票组成,综合反映中国 A 股市场中一批小市值公司的股票价格表现。本基金通过交易所买卖或申购赎回的方式投资于目标 ETF(华夏中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金),从而实现基金投资目标。基金也可以通过买入标的指数成份股来跟踪标的指数。

3 季度,海外方面,美联储继 7 月加息 75bp 后,9 月议息会议再度将短期利率上调 75 个基点,瑞士等多国央行跟随式加息。美元流动性进一步趋紧,美元指数大幅走高,离岸和在岸人民币均突破 7 关口。欧洲地缘政治局势的紧张和升级为全球市场平添了外部不确定性,市场对新一轮升级可能给全球大宗商品价格带来上行压力的担忧加剧。国内方面,货币政策继续保持宽松,稳增长政策持续加码助力经济增长。8 月增长数据在此前宽松政策的支持下有一定起色,整体看经济处于弱修复阶段:生产增速小幅回升,地产投资有望筑底,基建投资受益于政策性金融加码高位提速,制造业投资逆市走高,消费增速有所改善,失业率继续缓慢回落。

市场方面,美元指数的快速上行叠加国际地缘局势的紧张,加剧了全球资产价格的波动,人民币贬值压力的加大也对 A 股投资情绪产生影响。3 季度 A 股市场整体表现低迷走势下行,7 月受流动性和企业盈利边际下行影响市场震荡调整,8 月初得益于中报预期修复市场短暂企稳之后继续承压,9 月初受益于地产政策改善市场有所反弹之后继续调整并创本轮调整新低。行业方面,煤炭板块相对表现占优,建材、医药表现垫底。

基金投资运作方面,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、赎回工作。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2022 年 9 月 30 日,华夏中证 1000ETF 发起式联接 A 份额净值为 0.8679 元,本报告期份额净值增长率为-11.89%,同期业绩比较基准增长率-11.83%,本报告期跟踪偏离度为-0.06%;华夏中证 1000ETF 发起式联接 C 份额净值为 0.8662 元,本报告期份额净值增长率为-11.95%,同期业绩比较基准增长率-11.83%,本报告期跟踪偏离度为-0.12%。与业绩比较基准产生偏离的主要原因为日常运作费用、指数结构调整、申购赎回、成份股分红等产生的差异。



## §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：股票	-	-
2	基金投资	93,627,926.14	92.86
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	6,368,919.33	6.32
8	其他资产	827,812.83	0.82
9	合计	100,824,658.30	100.00

### 5.2 期末投资目标基金明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	华夏中证 1000ETF	股票型	交易型开放式	华夏基金管理有限公司	93,627,926.14	93.72

### 5.3 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

### 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投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

### 5.5 报告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。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

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序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.8 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。

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五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.10.1 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	合约市值 (元)	公允价值 变动 (元)	风险说明
IM2212	中证 1000 股 指期货 IM2212 合约	1	1,206,160.00	-209,880.00	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)					-209,880.00
股指期货投资本期收益 (元)					24,338.13
股指期货投资本期公允价值变动 (元)					-209,880.00

5.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金为指数型联接基金,主要投资于目标 ETF 基金份额、标的指数成份股和备选成份股。本基金根据基金合同规定投资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。

5.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.11.1 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。

5.11.2 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。

5.11.3 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。

5.12 投资组合报告附注

5.12.1 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。

5.12.2 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。

5.12.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	206,988.91
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	620,823.92
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	827,812.83

5.12.4 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。

5.12.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

5.12.6 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。

## §6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华夏中证1000ETF发起式联接A	华夏中证1000ETF发起式联接C
本报告期期初基金份额总额	19,805,514.57	4,830,823.35
报告期期间基金总申购份额	55,824,959.94	82,661,018.29

减：报告期期间基金总赎回份额	6,046,220.45	41,875,955.88
报告期期间基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	69,584,254.06	45,615,885.76

## §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

单位：份

项目	华夏中证1000ETF发起式联接A	华夏中证1000ETF发起式联接C
报告期期初管理人持有的本基金份额	10,004,861.60	-
报告期期间买入/申购总份额	-	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	10,004,861.60	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	14.38	-

### 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 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,004,861.60	8.68%	10,000,000.00	8.68%	不少于三年

基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,004,861.60	8.68%	10,000,000.00	8.68%	不少于三年

## 9 影响投资者决策的其他重要信息

### 9.1 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	2022-07-01 至 2022-07-24	10,004,861.60	-	-	10,004,861.60	8.68%

#### 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。

### 9.2 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

本基金本报告期内无需要披露的主要事项。

#### 2、其他相关信息

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

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

## §10 备查文件目录

### 10.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予基金注册的文件；
- 2、《华夏中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》；
- 3、《华夏中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金托管协议》；
- 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。

### 10.2 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。

### 10.3 查阅方式

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

华夏基金管理有限公司

二〇二二年十月二十五日