

**华夏上证科创板 50 成份指数增强型发起式**

**证券投资基金**

**2023 年第 3 季度报告**

**2023 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：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二三年十月二十四日

## §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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 10 月 20 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 2023 年 7 月 25 日起至 9 月 30 日止。

## §2 基金产品概况

基金简称	华夏上证科创板 50 成份指数增强发起式	
基金主代码	018177	
交易代码	018177	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2023 年 7 月 25 日	
报告期末基金份额总额	301,662,836.66 份	
投资目标	通过量化方法进行积极的投资组合管理与风险控制，力争在控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 7.75%的基础上，追求获得超越标的指数的回报。	
投资策略	主要投资策略包括股票投资策略，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，融资、转融通证券出借业务投资策略等。	
业绩比较基准	上证科创板 50 成份指数收益率×95%+人民币活期存款税后利率×5%	
风险收益特征	本基金为股票指数增强型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种，其预期风险与收益高于混合型基金、债券型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	中国工商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	华夏上证科创板 50 成份指数增强发起式 A	华夏上证科创板 50 成份指数增强发起式 C
下属分级基金的交易代码	018177	018178
报告期末下属分级基金的份额总额	195,153,417.41 份	106,509,419.25 份

### §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 (2023 年 7 月 25 日 (基金合同生效日) -2023 年 9 月 30 日)	
	华夏上证科创板 50 成份指数增强发起式 A	华夏上证科创板 50 成份指数增强发起式 C
1.本期已实现收益	-1,076,855.13	-687,114.12
2.本期利润	-7,973,693.45	-4,506,583.50
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0405	-0.0400
4.期末基金资产净值	187,137,244.90	102,059,167.75
5.期末基金份额净值	0.9589	0.9582

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本基金合同于 2023 年 7 月 25 日生效。

#### 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

华夏上证科创板50成份指数增强发起式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
自基金合同生效起	-4.11%	0.92%	-6.26%	1.27%	2.15%	-0.35%

至今						
----	--	--	--	--	--	--

华夏上证科创板50成份指数增强发起式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
自基金合同生效起至今	-4.18%	0.92%	-6.26%	1.27%	2.08%	-0.35%

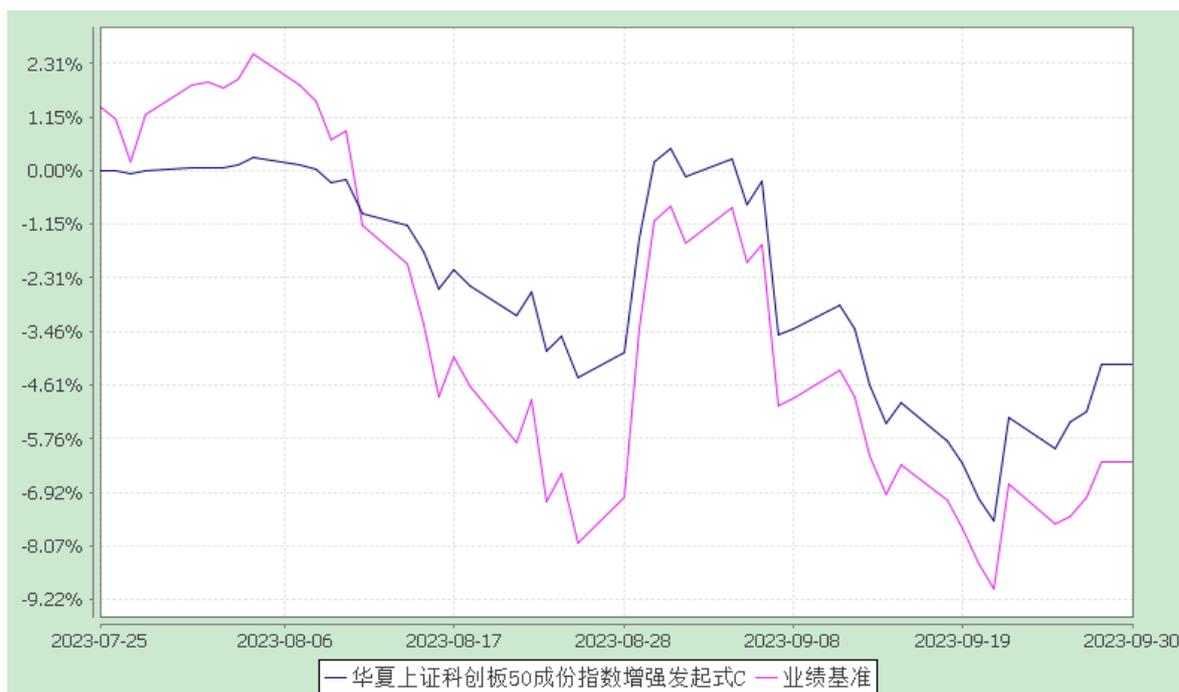
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华夏上证科创板 50 成份指数增强型发起式证券投资基金  
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  
(2023 年 7 月 25 日至 2023 年 9 月 30 日)

华夏上证科创板 50 成份指数增强发起式 A:



华夏上证科创板 50 成份指数增强发起式 C:



注：①本基金合同于 2023 年 7 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		
荣膺	本基金的基金经理、投委会成员	2023-07-25	-	13 年	硕士。2010 年 7 月加入华夏基金管理有限公司。历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

					<p>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）、华夏 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2018 年 9 月 17 日至 2021 年 10 月 21 日期间）、华夏 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（2018 年 9 月 17 日至 2021 年 10 月 21 日期间）、华夏中证央企结构调整交易型开放式指数证券投资基金联接基金</p>
--	--	--	--	--	---

					<p>基金经理(2018年11月14日至2021年10月21日期间)、华夏创业板低波价值交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理(2019年6月26日至2021年10月21日期间)、华夏沪港通上证 50AH 优选指数证券投资基金(LOF)基金经理(2016年10月27日至2022年8月22日期间)、华夏创业板动量成长交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理(2019年6月26日至2022年8月22日期间)、华夏饲料豆粕期货交易型开放式证券投资基金发起式联接基金基金经理(2020年1月13日至2022年8月22日期间)、华夏粤港澳大湾区创新 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理(2020年2月25日至</p>
--	--	--	--	--	---

					2022 年 8 月 22 日期间)、华夏粤港澳大湾区创新 100 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理 (2020 年 4 月 29 日至 2022 年 8 月 22 日期间) 等。
--	--	--	--	--	---

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

②证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

#### 4.3 公平交易专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，本基金管理人旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 68 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上证科创板 50 成份指数，业绩比较基准为：上证科创板 50 成份指数收益率×95%+人民币活期存款税后利率×5%。上证科创板 50 成份指数由上海证券交易所科创板中市值大、流动性好的 50 只证券组成，反映最具市场代表性的一批科创企业的整体表现。作为指数增强型基金，本基金股票投资方面主要采用指数增强量化投资策略，在跟踪误差控制在目标范围内的基础上，力求获得超越标的指数的超额收益。

3 季度，经济逐步修复，PMI 环比增长，地产销售改善。金融资产价格整体震荡，人民币汇率和权益市场偏弱，利率债偏强，商品期货明显走强。A 股政策底明确，静候市场底。板块方面，电力、能源、电信运营等相对稳定，TMT 板块调整。

本基金于 2023 年 7 月 25 日成立，基金管理人在建仓期内实施完成组合调整，逐步实现贴近标的指数，并于 8 月 31 日开放申购赎回。基金投资运作方面，报告期内，本基金基于数量化投资分析及基本面研究等方法智能筛选优质上市公司、优化投资组合，策略聚焦新一代科技创新企业板块，通过因子增强的方式，捕捉科创板中高成长、高弹性股票的投资机会。同时，本基金秉承尽职尽责的态度，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 2023 年 9 月 30 日，华夏上证科创板 50 成份指数增强发起式 A 基金份额净值为 0.9589 元，本报告期份额净值增长率为-4.11%；华夏上证科创板 50 成份指数增强发起式 C 基金份额净值为 0.9582 元，本报告期份额净值增长率为-4.18%，同期业绩比较基准增长率为-6.26%。本基金本报告期 A 类份额跟踪偏离度为+2.15%，C 类份额跟踪偏离度为+2.08%。

## §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	269,486,999.77	92.55
	其中：股票	269,486,999.77	92.55
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	20,534,003.37	7.05
8	其他资产	1,158,544.12	0.40
9	合计	291,179,547.26	100.00

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 指数投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	198,065,893.17	68.49
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	62,455,919.46	21.60
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	260,521,812.63	90.08

### 5.2.2 积极投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	7,693,361.74	2.66
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,271,825.40	0.44
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	8,965,187.14	3.10

### 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

#### 5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净
----	------	------	-------	---------	--------

					值比例 (%)
1	688981	中芯国际	525,643	26,886,639.45	9.30
2	688111	金山办公	66,001	24,473,170.80	8.46
3	688012	中微公司	157,492	23,710,420.60	8.20
4	688036	传音控股	150,905	21,992,894.70	7.60
5	688169	石头科技	34,218	10,106,628.48	3.49
6	688599	天合光能	308,234	9,422,713.38	3.26
7	688256	寒武纪	72,593	8,997,902.35	3.11
8	688396	华润微	151,722	8,206,642.98	2.84
9	688008	澜起科技	146,061	7,259,231.70	2.51
10	688777	中控技术	151,243	7,229,415.40	2.50

5.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	688617	惠泰医疗	5,889.00	2,254,544.76	0.78
2	688235	百济神州	12,431.00	1,755,878.75	0.61
3	688002	睿创微纳	35,270.00	1,682,379.00	0.58
4	688088	虹软科技	29,317.00	1,190,270.20	0.41
5	688578	艾力斯	28,958.00	1,131,099.48	0.39

5.4 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。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

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十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无股指期货投资。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末无股指期货投资。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末无国债期货投资。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无国债期货投资。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货投资。

5.11 投资组合报告附注

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

5.11.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	34,097.79
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,124,446.33
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,158,544.12

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.5.1 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

#### 5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

### §6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华夏上证科创板50成份指数增强发起式A	华夏上证科创板50成份指数增强发起式C
基金合同生效日基金份额总额	198,354,348.72	116,123,978.47
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	13,787,767.44	11,760,626.13
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	16,988,698.75	21,375,185.35
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	195,153,417.41	106,509,419.25

注：本基金合同于 2023 年 7 月 25 日生效。

### §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	华夏上证科创板50成份指数增强发起式A	华夏上证科创板50成份指数增强发起式C
基金合同生效日管理人持有的本基金份额	10,009,334.27	-
基金合同生效日起至报告期期末买入/申购总份额	-	-
基金合同生	-	-

效日起至报 告期期末卖 出/赎回总份 额		
报告期期末 管理人持有 的本基金份 额	10,009,334.27	-
报告期期末 持有的本基 金份额占基 金总份额比 例 (%)	5.13	-

注：本基金合同于 2023 年 7 月 25 日生效。

#### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易 方式	交易日期	交易份额 (份)	交易金额 (元)	适用 费率
1	认 购	2023-07-03	10,009,334.27	10,000,000.00	-
合计			10,009,334.27	10,000,000.00	

注：本基金管理人此项认购本基金适用的费用为 1,000.00 元。

### §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	10,009,334.27	3.32%	10,000,000.00	3.31%	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	10,009,334.27	3.32%	10,000,000.00	3.31%	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

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。

### 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

2023 年 7 月 26 日发布华夏基金管理有限公司关于设立沈阳分公司的公告。

2023 年 7 月 26 日发布华夏上证科创板 50 成份指数增强型发起式证券投资基金基金合同生效公告。

2023 年 8 月 24 日发布华夏上证科创板 50 成份指数增强型发起式证券投资基金开放日常申购、赎回、转换、定期定额申购业务的公告。

2023 年 9 月 27 日发布华夏基金管理有限公司关于杭州分公司营业场所变更的公告。

#### 2、其他相关信息

华夏基金管理有限公司成立于 1998 年 4 月 9 日，是经中国证监会批准成立的首批全国性基金管理公司之一。公司总部设在北京，在北京、上海、深圳、成都、南京、杭州、广州、青岛、武汉及沈阳设有分公司，在香港、深圳、上海、北京设有子公司。公司是首批全国社保基金管理人、首批企业年金基金管理人、境内首批 QDII 基金管理人、境内首只 ETF 基金管理人、境内首只沪港通 ETF 基金管理人、首批内地与香港基金互认基金管理人、首批基本养老保险基金投资管理人资格、首家加入联合国责任投资原则组织的公募基金公司、首批公募 FOF 基金管理人、首批公募养老目标基金管理人、首批个人养老金基金管理人、境内首批中日互通 ETF 基金管理人、首批商品期货 ETF 基金管理人、首批公募 MOM 基金管理人、首批纳入互联互通 ETF 基金管理人、首批北交所主题基金管理人以及特定客户资产管理人、保险资金投资管理人、公募 REITs 管理人，国内首家承诺“碳中和”具体目标和路径的公募基金公司，香港子公司是首批 RQFII 基金管理人。华夏基金是业务领域最广泛的基金管理公司之一。

## §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、《华夏上证科创板 50 成份指数增强型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《华夏上证科创板 50 成份指数增强型发起式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。

#### 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

二〇二三年十月二十四日