

**华夏中证 500 指数智选增强型**

**证券投资基金**

**2023 年第 1 季度报告**

**2023 年 3 月 31 日**

基金管理人：华夏基金管理有限公司

基金托管人：国信证券股份有限公司

报告送出日期：二〇二三年四月二十一日

## §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。

基金托管人国信证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 4 月 19 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 1 月 1 日起至 3 月 31 日止。

## §2 基金产品概况

|             |  |                   |
|-------------|--|-------------------|
| 基金简称        | 华夏中证 500 指数智选增强  |                   |
| 基金主代码       | 013233   |                   |
| 交易代码        | 013233   |                   |
| 基金运作方式      | 契约型开放式   |                   |
| 基金合同生效日     | 2021 年 8 月 11 日  |                   |
| 报告期末基金份额总额  | 2,873,860,568.82 份   |                   |
| 投资目标        | 通过数量化投资分析及基本面研究等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      | 中证 500 指数收益率 $\times$ 95% + 人民币活期存款税后利率 $\times$ 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。本基金还将通过港股通渠道投资于香港证券市场，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，本基金还将面临汇率风险、香港市场风险等特殊投资风险。 |                   |
| 基金管理人       | 华夏基金管理有限公司   |                   |
| 基金托管人       | 国信证券股份有限公司   |                   |
| 下属分级基金的基金简称 | 华夏中证 500 指数智选增强 A  | 华夏中证 500 指数智选增强 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 013233   | 013234            |

|                     |                    |                  |
|---------------------|--------------------|------------------|
| 报告期末下属分级基金的份<br>额总额 | 2,188,788,148.83 份 | 685,072,419.99 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<br>(2023 年 1 月 1 日-2023 年 3 月 31 日) |                   |
|---------------------|---|-------------------|
|                     | 华夏中证 500 指数智选增强 A                       | 华夏中证 500 指数智选增强 C |
| 1. 本期已实现收<br>益      | 118,159,822.17                          | 25,822,842.71     |
| 2. 本期利润             | 190,267,013.63                          | 36,776,375.35     |
| 3. 加权平均基金<br>份额本期利润 | 0.0836                                  | 0.0688            |
| 4. 期末基金资产<br>净值     | 2,168,295,833.33                        | 674,245,366.42    |
| 5. 期末基金份额<br>净值     | 0.9906                                  | 0.9842            |

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500指数智选增强A:

| 阶段   | 净值增长<br>率① | 净值增长<br>率标准差<br>② | 业绩比较<br>基准收益<br>率③ | 业绩比较<br>基准收益<br>率标准差<br>④ | ①-③   | ②-④    |
|------|------------|-------------------|--------------------|---------------------------|-------|--------|
| 过去三个 | 9.05%      | 0.68%             | 7.70%              | 0.70%                     | 1.35% | -0.02% |

|            |        |       |        |       |        |       |
|------------|--------|-------|--------|-------|--------|-------|
| 月          |        |       |        |       |        |       |
| 过去六个月      | 14.40% | 0.85% | 10.41% | 0.85% | 3.99%  | 0.00% |
| 过去一年       | 11.49% | 1.20% | 0.33%  | 1.16% | 11.16% | 0.04% |
| 自基金合同生效起至今 | -0.94% | 1.16% | -9.07% | 1.14% | 8.13%  | 0.02% |

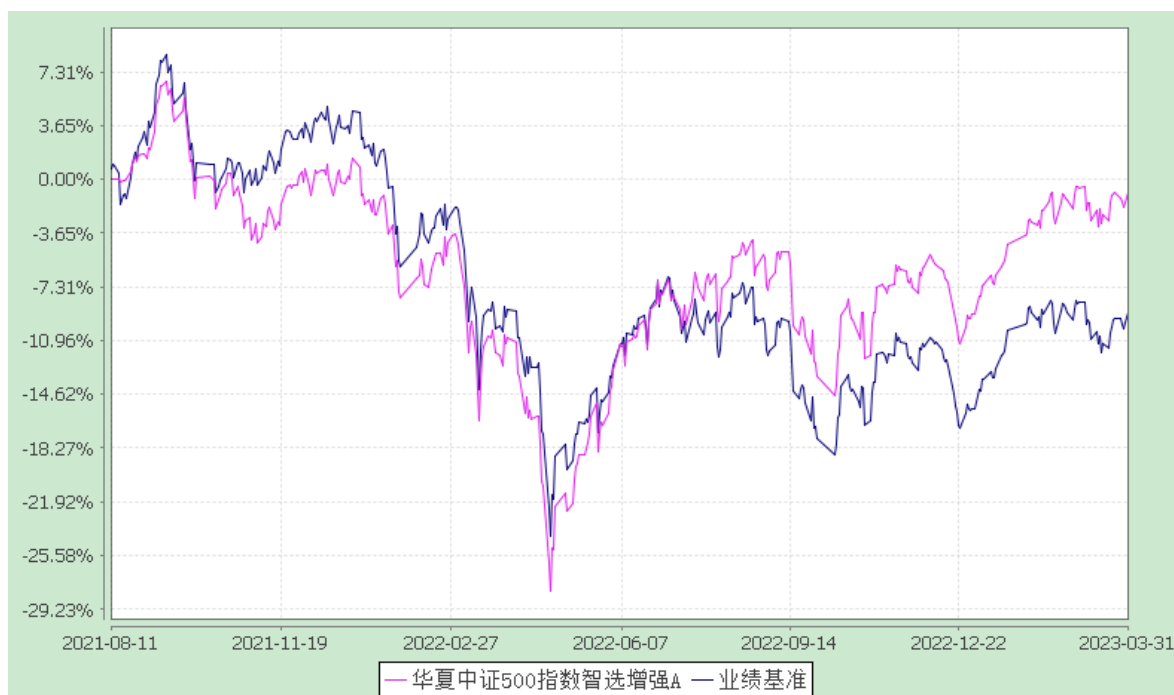
华夏中证500指数智选增强C:

| 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      | 8.94%  | 0.68%     | 7.70%      | 0.70%         | 1.24%  | -0.02% |
| 过去六个月      | 14.18% | 0.85%     | 10.41%     | 0.85%         | 3.77%  | 0.00%  |
| 过去一年       | 11.06% | 1.20%     | 0.33%      | 1.16%         | 10.73% | 0.04%  |
| 自基金合同生效起至今 | -1.58% | 1.16%     | -9.07%     | 1.14%         | 7.49%  | 0.02%  |

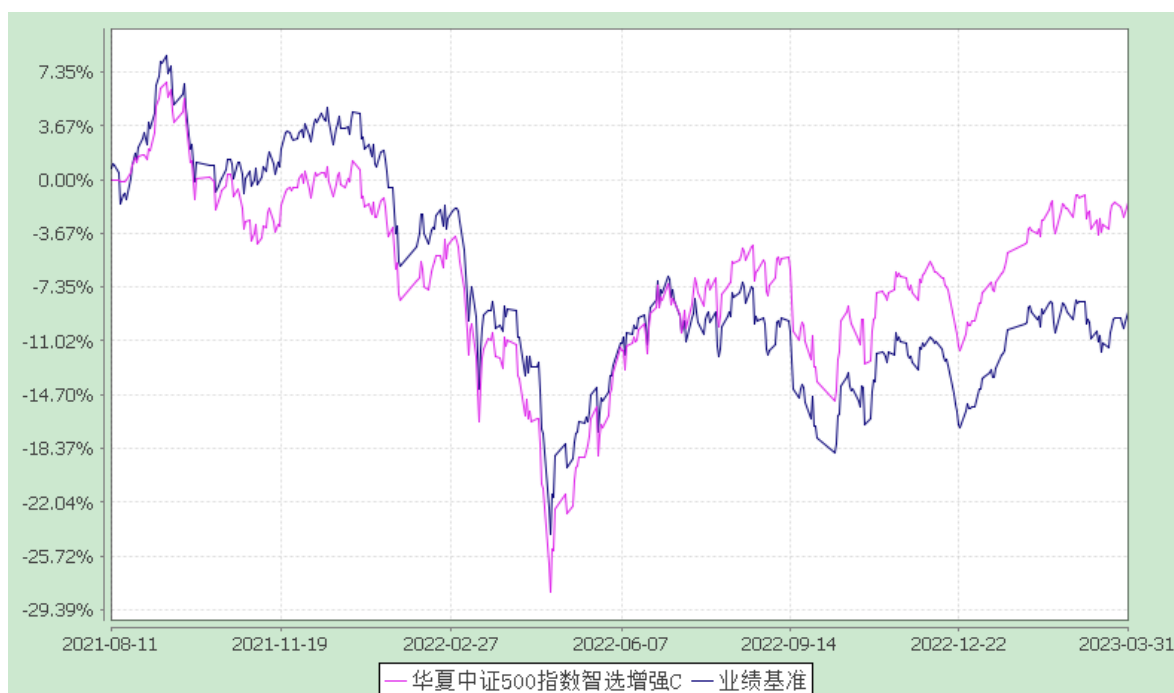
3.2.2自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华夏中证 500 指数智选增强型证券投资基金  
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  
(2021 年 8 月 11 日至 2023 年 3 月 31 日)

华夏中证 500 指数智选增强 A:



华夏中证 500 指数智选增强 C:



## §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 |        |               |
| 孙蒙 | 本基金的基金 | 2021-08-11  | -    | 9 年    | 硕士。曾任中信建投证券股份 |

|  |    |  |  |  |   |
|--|----|--|--|--|---|
|  | 经理 |  |  |  | 有限公司研究员、投资经理等。2017 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 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 29 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 500 指数，业绩比较基准为：中证 500 指数收益率\*95%+银行活期存款利率(税后)\*5%。中证 500 指数成份股由全部 A 股中剔除沪深 300 指数成份股

及总市值排名前 300 名的股票后，总市值排名靠前的 500 只股票组成，综合反映中国 A 股市场中一批中小市值公司的股票价格表现。本基金作为增强型的指数基金，一方面采用指数化被动投资以追求有效跟踪标的指数，另一方面采用量化模型调整投资组合力求超越标的指数表现。

1 季度，国际方面，尽管主要发达经济体通胀水平出现了一定程度的回落，但核心通胀总体上仍处在高位，主要源于服务价格强劲上涨、部分行业利润率上升以及劳动力市场紧张带来的成本压力等方面的支撑；由于美联储 2022 年以来的持续激进加息，始于美国银行业的冲击开始向欧洲市场蔓延，全球经济面临的不确定性有所增强。国内方面，伴随着疫情防控较快平稳转段，生产需求明显改善，就业物价总体稳定，消费市场活力回升，市场预期加快好转，经济运行呈现企稳回升态势，但外部环境更趋复杂，需求不足仍较突出，经济回升基础仍需巩固；全国两会胜利召开，国务院明确“高质量发展”、“深化改革开放”等政策目标和工作重点；货币政策上，3 月央行降准时点超出市场普遍预期，但缓解了银行负债端的压力，保持了银行体系流动性合理充裕。

市场方面，A 股市场上涨后震荡整理，结构性行情非常明显。行业间分化较大：计算机、传媒、通信等行业表现较好，而美容护理、商业贸易、房地产等行业表现较差。市场风格轮动，小市值占优，有效因子以反转、低波等量价指标为主，期间量化策略整体表现正常。

基金投资运作方面，本基金以多因子量化投资策略为主，在控制基金与标的指数跟踪偏离度的基础上，力争获取更高的超额收益。我们在依据量化模型进行股票投资决策之外，还积极参与了科创板、创业板新股申购，获取较为确定性的收益增厚机会。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 3 月 31 日，华夏中证 500 指数智选增强 A 基金份额净值为 0.9906 元，本报告期份额净值增长率为 9.05%；华夏中证 500 指数智选增强 C 基金份额净值为 0.9842 元，本报告期份额净值增长率为 8.94%，同期业绩比较基准增长率为 7.70%。本基金本报告期 A 类份额跟踪偏离度为+1.35%，C 类份额跟踪偏离度为+1.24%。

#### 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              | 2,672,027,080.86 | 93.37        |
|    | 其中：股票             | 2,672,027,080.86 | 93.37        |
| 2  | 基金投资              | -                | -            |
| 3  | 固定收益投资            | 348,034.32       | 0.01         |
|    | 其中：债券             | 348,034.32       | 0.01         |
|    | 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      | 175,516,189.25   | 6.13         |
| 8  | 其他资产              | 13,792,863.24    | 0.48         |
| 9  | 合计                | 2,861,684,167.67 | 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         | 14,556,798.00    | 0.51         |
| B  | 采矿业              | 78,971,207.55    | 2.78         |
| C  | 制造业              | 1,303,839,629.87 | 45.87        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 64,046,083.24    | 2.25         |
| E  | 建筑业              | 79,830,948.00    | 2.81         |
| F  | 批发和零售业           | 62,479,679.97    | 2.20         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 79,253,202.36    | 2.79         |

|   |                 |                  |       |
|---|-----------------|------------------|-------|
| H | 住宿和餐饮业          | -                | -     |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 162,589,050.97   | 5.72  |
| J | 金融业             | 235,889,226.14   | 8.30  |
| K | 房地产业            | 25,334,490.00    | 0.89  |
| L | 租赁和商务服务业        | 28,644,792.00    | 1.01  |
| M | 科学研究和技术服务业      | 466,768.00       | 0.02  |
| N | 水利、环境和公共设施管理业   | 8,773,614.00     | 0.31  |
| 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       | 68,078,197.42    | 2.39  |
| S | 综合              | -                | -     |
|   | 合计              | 2,212,753,687.52 | 77.84 |

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              | 421,756.00     | 0.01         |
| C  | 制造业              | 297,988,519.41 | 10.48        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 368,222.80     | 0.01         |
| E  | 建筑业              | 21,737,789.87  | 0.76         |
| F  | 批发和零售业           | 13,182,485.80  | 0.46         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 1,795,263.00   | 0.06         |
| H  | 住宿和餐饮业           | -              | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 69,212,554.33  | 2.43         |
| J  | 金融业              | 150,748.00     | 0.01         |
| K  | 房地产业             | -              | -            |
| L  | 租赁和商务服务业         | 11,653,200.00  | 0.41         |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 30,449.85      | 0.00         |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 3,952,802.74   | 0.14         |
| O  | 居民服务、修理和其他服务业    | -              | -            |

|   |           |                |       |
|---|-----------|----------------|-------|
| P | 教育        | 2,444,715.00   | 0.09  |
| Q | 卫生和社会工作   | 73,528.54      | 0.00  |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 34,329,233.00  | 1.21  |
| S | 综合        | 1,932,125.00   | 0.07  |
|   | 合计        | 459,273,393.34 | 16.16 |

## 5.3 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  | 688777 | 中控技术 | 314,871   | 32,699,353.35 | 1.15         |
| 2  | 002273 | 水晶光电 | 2,089,192 | 29,081,552.64 | 1.02         |
| 3  | 600060 | 海信视像 | 1,436,035 | 28,332,970.55 | 1.00         |
| 4  | 000878 | 云南铜业 | 2,092,902 | 26,977,506.78 | 0.95         |
| 5  | 300009 | 安科生物 | 2,363,280 | 26,114,244.00 | 0.92         |
| 6  | 600820 | 隧道股份 | 4,574,400 | 26,074,080.00 | 0.92         |
| 7  | 000785 | 居然之家 | 5,623,500 | 26,036,805.00 | 0.92         |
| 8  | 000997 | 新大陆  | 1,513,288 | 25,332,441.12 | 0.89         |
| 9  | 603228 | 景旺电子 | 970,650   | 24,848,640.00 | 0.87         |
| 10 | 600131 | 国网信通 | 1,245,800 | 24,841,252.00 | 0.87         |

## 5.3.1 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  | 603600 | 永艺股份 | 1,198,100.00 | 13,047,309.00 | 0.46         |
| 2  | 603421 | 鼎信通讯 | 1,124,589.00 | 12,078,085.86 | 0.42         |
| 3  | 688585 | 上纬新材 | 1,191,847.00 | 11,119,932.51 | 0.39         |
| 4  | 688032 | 禾迈股份 | 16,600.00    | 11,051,284.00 | 0.39         |
| 5  | 002322 | 理工能科 | 938,100.00   | 10,975,770.00 | 0.39         |

## 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种      | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|---------|--------------|
| 1  | 国家债券      | -       | -            |
| 2  | 央行票据      | -       | -            |
| 3  | 金融债券      | -       | -            |
|    | 其中：政策性金融债 | -       | -            |
| 4  | 企业债券      | -       | -            |

|    |           |            |      |
|----|-----------|------------|------|
| 5  | 企业短期融资券   | -          | -    |
| 6  | 中期票据      | -          | -    |
| 7  | 可转债（可交换债） | 348,034.32 | 0.01 |
| 8  | 同业存单      | -          | -    |
| 9  | 其他        | -          | -    |
| 10 | 合计        | 348,034.32 | 0.01 |

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

| 序号 | 债券代码   | 债券名称    | 数量（张） | 公允价值（元）    | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|---------|-------|------------|--------------|
| 1  | 113667 | 春 23 转债 | 3,480 | 348,034.32 | 0.01         |
| 2  | -      | -       | -     | -          | -            |
| 3  | -      | -       | -     | -          | -            |
| 4  | -      | -       | -     | -          | -            |
| 5  | -      | -       | -     | -          | -            |

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

| 代码     | 名称                    | 持仓量 | 合约市值（元）       | 公允价值变动（元）  | 风险说明                            |
|--------|-----------------------|-----|---------------|------------|---------------------------------|
| IC2306 | 中证 500 股指期货 IC2306 合约 | 12  | 15,096,480.00 | 554,544.00 | 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。 |
| IC2309 | 中证 500 股指期货 IC2309 合约 | 2   | 2,483,840.00  | 38,920.00  | 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）     | 593,464.00   |
| 股指期货投资本期收益（元）     | -41,063.24   |
| 股指期货投资本期公允价值变动（元） | 1,337,444.00 |

### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金为指数增强型基金，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，投资于标的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。

### 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   | 3,995,919.76 |
| 2  | 应收证券清算款 | 2,213,484.54 |
| 3  | 应收股利    | -            |
| 4  | 应收利息    | -            |
| 5  | 应收申购款   | 7,583,458.94 |
| 6  | 其他应收款   | -            |
| 7  | 待摊费用    | -            |
| 8  | 其他      | -            |

|   |    |               |
|---|----|---------------|
| 9 | 合计 | 13,792,863.24 |
|---|----|---------------|

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             | 华夏中证500指数智选增强A   | 华夏中证500指数智选增强C |
|----------------|------------------|----------------|
| 本报告期初基金份额总额    | 2,348,402,096.87 | 464,378,246.44 |
| 报告期期间基金总申购份额   | 66,897,820.45    | 299,275,010.96 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 226,511,768.49   | 78,580,837.41  |
| 报告期期间基金拆分变动份额  | -                | -              |
| 本报告期末基金份额总额    | 2,188,788,148.83 | 685,072,419.99 |

## §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

2023 年 1 月 6 日发布华夏基金管理有限公司公告。

2023 年 1 月 19 日发布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。

2023 年 2 月 4 日发布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。

2023 年 2 月 11 日发布

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。

2023 年 2 月 18 日发布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。

2023 年 2 月 24 日发布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。

2023 年 3 月 3 日发布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。

2023 年 3 月 11 日发布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。

2023 年 3 月 16 日发布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。

2023 年 3 月 23 日发布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。

2023 年 3 月 30 日发布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。

2023 年 3 月 31 日发布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。

### 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、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。

## §9 备查文件目录

### 9.1 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 500 指数智选增强型证券投资基金基金合同》；
- 3、《华夏中证 500 指数智选增强型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。

### 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  
二〇二三年四月二十一日