

**华夏中证 1000 指数增强型
证券投资基金
2023 年中期报告
2023 年 6 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：二〇二三年八月三十日

§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。本中期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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 8 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	1
§2 基金简介.....	3
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	4
3.1 主要会计数据和财务指标.....	4
3.2 基金净值表现.....	5
§4 管理人报告.....	6
§5 托管人报告.....	12
§6 中期报告财务会计报告（未经审计）.....	12
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	14
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	16
§7 投资组合报告.....	47
7.1 期末基金资产组合情况.....	47
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	47
7.3 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.....	49
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	56
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	57
7.6 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.....	57
7.7 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.....	57
7.8 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.....	57
7.9 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.....	57
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	58
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	58
7.12 投资组合报告附注.....	58
§8 基金份额持有人信息.....	59
§9 开放式基金份额变动.....	60
§10 重大事件揭示.....	60
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	62
§12 备查文件目录.....	63

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华夏中证 1000 指数增强型证券投资基金	
基金简称	华夏中证 1000 指数增强	
基金主代码	014125	
交易代码	014125	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 12 月 7 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	
报告期末基金份额总额	1,102,901,213.96 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华夏中证 1000 指数增强 A	华夏中证 1000 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	014125	014126
报告期末下属分级基金的份额总额	161,769,305.58 份	941,131,908.38 份

2.2 基金产品说明

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	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。

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	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李彬	张姗
	联系电话	400-818-6666	0755-83077987
	电子邮箱	service@ChinaAMC.com	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		400-818-6666	95555
传真		010-63136700	0755-83195201

注册地址	北京市顺义区安庆大街甲3号院	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
办公地址	北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座8层	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
邮政编码	100033	518040
法定代表人	杨明辉	缪建民

2.5 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.ChinaAMC.com
基金中期报告备置地点	基金管理人和/或基金托管人的住所/办公地址

2.6 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	华夏基金管理有限公司	北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 8 层

§3 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期（2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日）	
	华夏中证 1000 指数增强 A	华夏中证 1000 指数增强 C
本期已实现收益	-3,186,910.19	-19,719,592.59
本期利润	7,297,504.50	57,170,900.47
加权平均基金份额本期利润	0.0563	0.0596
本期加权平均净值利润率	5.99%	6.36%
本期基金份额净值增长率	6.53%	6.33%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)	
	华夏中证 1000 指数增强 A	华夏中证 1000 指数增强 C
期末可供分配利润	-9,505,021.05	-60,804,127.37
期末可供分配基金份额利润	-0.0588	-0.0646
期末基金资产净值	152,264,284.53	880,327,781.01
期末基金份额净值	0.9412	0.9354
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)	

	华夏中证 1000 指数增强 A	华夏中证 1000 指数增强 C
基金份额累计净值增长率	-5.88%	-6.46%

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

华夏中证 1000 指数增强 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	2.29%	0.87%	0.59%	0.99%	1.70%	-0.12%
过去三个月	-1.18%	0.85%	-3.77%	0.87%	2.59%	-0.02%
过去六个月	6.53%	0.82%	4.87%	0.84%	1.66%	-0.02%
过去一年	-2.91%	1.02%	-5.27%	1.05%	2.36%	-0.03%
自基金合同生效起至今	-5.88%	1.25%	-15.57%	1.32%	9.69%	-0.07%

华夏中证 1000 指数增强 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	2.27%	0.87%	0.59%	0.99%	1.68%	-0.12%
过去三个月	-1.27%	0.85%	-3.77%	0.87%	2.50%	-0.02%
过去六个月	6.33%	0.82%	4.87%	0.84%	1.46%	-0.02%
过去一年	-3.29%	1.02%	-5.27%	1.05%	1.98%	-0.03%
自基金合同生效起至今	-6.46%	1.25%	-15.57%	1.32%	9.11%	-0.07%

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

华夏中证 1000 指数增强型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2021 年 12 月 7 日至 2023 年 6 月 30 日)

华夏中证 1000 指数增强 A



华夏中证 1000 指数增强 C



§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、青岛、武汉、沈阳设有分公司,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。

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、SmartBeta 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 2023 年 6 月 30 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:在养老目标风险 FOF(权益资产 0-30%)(A 类)中,华夏保守养老一年持有混合(FOF)(A 类)排名第 1/59;在对冲策略绝对收益目标基金(A 类)中,华夏安泰对冲策略 3 个月定开混合排名第 1/22;在汽车主题行业偏股型基金(A 类)中,华夏新能源车龙头混合发起式(A 类)排名第 1/11;在低碳环保行业股票型基金(A 类)中,华夏节能环保股票(A 类)排名第 2/10;在消费行业偏股型基金(A 类)中,华夏网购精选混合(A 类)排名第 2/66、华夏新兴消费混合(A 类)排名第 9/66;在 QDII 混合基金(A 类)中,华夏全球科技先锋混合(QDII)排名第 3/43;在偏债型基金(A 类)中,华夏磐泰混合(LOF)(A 类)排名前 2%(13/619)、华夏睿磐泰盛混合排名前 3%(19/619)、华夏永利一年持有混合(A 类)排名前 10%(61/619);在灵活配置型基金(基准股票比例 30%-60%)(A 类)中,华夏稳增混合排名前 3%(14/440)、华夏新锦绣混合(A 类)排名前 4%(18/440);在标准股票型基金(A 类)中,华夏智胜先锋股票(LOF)(A 类)排名前 4%(13/317)、华夏智胜价值成长股票(A 类)排名前 6%(20/317);在偏股型基金(股票上限 95%)(A 类)中,华夏磐利一年定开混合(A 类)排名前 5%(11/214)、华夏磐锐一年定开混合(A 类)排名前 10%(21/214);在偏股型基金(股票上下限 60%-95%)(A 类)中,华夏核心制造混合(A 类)排名前 9%(126/1403)、华夏价值精选混合排名前 9%(133/1403)。

固收与固收+产品：在 QDII 债券型基金(A 类)中，华夏大中华信用债券（QDII）(A 类)排名第 1/24、华夏收益债券（QDII）(A 类)排名第 3/24；在短期纯债债券型基金(A 类)中，华夏 30 天滚动短债债券发起式(A 类)排名第 8/108；在长期纯债债券型基金(A 类)中，华夏鼎隆债券(A 类)排名前 6%(71/1228)、华夏鼎航债券(A 类)排名前 6%(76/1228)、华夏鼎英债券(A 类)排名前 7%(87/1228)；在普通债券型基金(可投转债)(A 类)中，华夏鼎禄三个月定开债券(A 类)排名前 9%(32/376)；在普通债券型基金(二级)(A 类)中，华夏恒融债券排名前 8%(30/368)。

指数与量化产品：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)排名第 1/132、华夏中证 500 指数智选增强(A 类)排名第 2/132；在主题指数股票 ETF 联接基金(A 类)中，华夏中证动漫游戏 ETF 发起式联接(A 类)排名第 1/110；在信用债指数债券型基金(A 类)中，华夏亚债中国指数(A 类)排名第 2/16；在 QDII 跨境股票 ETF 基金中，华夏纳斯达克 100ETF（QDII）排名第 2/33、华夏野村日经 225ETF 排名第 7/33；在 QDII 跨境股票 ETF 联接基金(A 类)中，华夏恒生 ETF 联接(A 类)排名第 3/10；在主题指数股票 ETF 基金中，华夏中证动漫游戏 ETF 排名第 1/313、华夏中证云计算与大数据主题 ETF 排名第 6/313、华夏中证大数据产业 ETF 排名前 5%(15/313)、华夏中证文化传媒 ETF 排名前 6%(18/313)、华夏中证金融科技主题 ETF 排名前 10%(30/313)；在规模指数股票 ETF 基金中，华夏沪港通恒生 ETF 排名第 4/136；在规模指数股票 ETF 联接基金(A 类)中，华夏沪港通恒生 ETF 联接(A 类)排名第 4/102；在行业指数股票 ETF 联接基金(A 类)中，华夏中证银行 ETF 联接(A 类)排名第 6/30。

在《中国证券报》第十九届中国基金业金牛奖评选中，华夏基金荣获“被动投资金牛基金公司”，成为业内连续 7 年获此殊荣的基金公司。在证券时报主办的第十八届中国基金业明星基金奖评选活动中，华夏基金凭借卓越的投资实力以及优秀的中长期业绩回报，将两大奖项收入囊中：公司层面，华夏基金荣获“三年期海外投资明星基金公司”；产品层面，华夏沪深 300ETF 荣获“三年持续回报指数型明星基金奖”。在《上海证券报》主办的第十九届“金基金”奖评选活动中，华夏基金将三大金基金奖项收入囊中：公司层面，华夏基金荣获“金基金 被动投资基金管理公司奖”；产品层面，华夏能源革新股票荣获“金基金 投资回报基金奖”，华夏沪深 300ETF 荣获“金基金 指数基金三年期奖”。

在客户服务方面，2023 年上半年，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）华夏基金直销渠道优化页面显示，升级搜索及查询功能，给客户更方便直观的使用体验；（2）华夏基金管家客户端优化“忘记密码”功能及定投模块，从客户投资需求出发，进一步提升操作体验；（3）与华润银行等代销机构合作，拓展更加丰富的客户理财渠道；（4）开展“帮你问了 ChatGPT”、“华夏基金户口本”、“指数攻防值来啦！”、“亲子财商 36 计”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）及基金经理助理的简介

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		
袁英杰	本基金的 基金经 理、投委 会成员	2021-12-07	-	17 年	硕士。曾任兴业证券股份有限公司研究员，上海申银万国证券研究所有限公司分析师，申万菱信基金管理有限公司高级数量研究员、基金经理助理、申万菱信中证军工指数分级证券投资基金基金经理、申万菱信中证环保产业指数分级证券投资基金基金经理、申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金基金经理、申万菱信中小板指数证券投资基金（LOF）基金经理、申万菱信深证成指分级证券投资基金基金经理、申万菱信中证申万电子行业投资指数分级证券投资基金基金经理、申万菱信中证申万传媒行业投资指数分级证券投资基金基金经理、申万菱信中证申万医药生物指数分级证券投资基金基金经理、申万菱信中证申万新兴健康产业主题投资指数证券投资基金（LOF）基金经理、申万菱信沪深 300 指数增强型证券投资基金基金经理、申万菱信中证 500 指数优选增强型证券投资基金基金经理、申万菱信臻选 6 个月定期开放混合型证券投资基金基金经理、申万菱信智选一年定期开放混合型证券投资基金基金经理、申万菱信中证 500 指数增强型证券投资基金基金经理、申万菱信价值优利混合型证券投资基金基金经理、申万菱信价值优先混合型证券投资基金基金经理、申万菱信量化小盘股票型证券投资基金（LOF）基金经理、

					申万菱信量化对冲策略灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理。2020 年 5 月加入华夏基金管理有限公司。曾任投资经理。
--	--	--	--	--	---

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。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值(元)	任职时间
袁英杰	公募基金	3	4,702,210,331.12	2021-09-27
	私募资产管理计划	3	11,463,995,278.97	2021-04-27
	其他组合	-	-	-
	合计	6	16,166,205,610.09	

注：报告期内，袁英杰管理的 1 个私募资产管理计划已于 2023 年 6 月 21 日终止。

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 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 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 90 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 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中证 1000 指数，业绩比较基准为：中证 1000 指数收益率 \times 95%+银行活期存款利率(税后) \times 5%。本基金股票投资方面主要采用指数增强量化投资策略，在严格控制跟踪误差的基础上，力求获得超越标的指数的超额收益。

上半年，A 股市场上涨后震荡调整，结构性行情非常明显，同时主题板块轮动较快，小市值板块相对占优，其中沪深 300 指数下跌 0.75%，中证 500 指数上涨 2.29%，中证 1000 指数上涨 5.10%。行业间表现差异比较大：通信、传媒、计算机等科技相关行业表现较好，而商业贸易、房地产、美容护理等消费行业表现较差。市场风格轮动较快，整体上估值、反转等量价类因子表现较好，而盈利、成长等基本面类因子持续走弱，期间量化策略整体表现一般。

基金投资运作方面，报告期内本基金以多因子量化投资策略为主，选股模型比较符合市场行情特征，基金净值表现领先比较基准指数，并且有效地控制本基金的跟踪误差。同时，本基金秉承尽职尽责的态度，尽量降低投资者日常申购、赎回等对基金可能带来的影响。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2023 年 6 月 30 日，华夏中证 1000 指数增强 A 基金份额净值为 0.9412 元，本报告期份额净值增长率为 6.53%；华夏中证 1000 指数增强 C 基金份额净值为 0.9354 元，本报告期份额净值增长率为 6.33%，同期业绩比较基准增长率为 4.87%。本基金本报告期 A 类份额跟踪偏离度为+1.66%，C 类份额跟踪偏离度为+1.46%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年经济复苏弱于预期，下半年政府可能出台更多稳增长政策，货币政策将继续保持宽松，预计中国经济复苏有望加强。A 股上市公司盈利增速方向预计向上，同时投资者情绪逐渐修复。展望下半年，市场预计震荡上行，行业或者风格板块可能持续保持轮动特征，建议均衡配置。

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。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 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

托管人声明：

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本中期报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§6 中期报告财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华夏中证 1000 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			

银行存款	6.4.7.1	79,884,988.45	75,057,541.54
结算备付金		7,413,469.89	6,053,988.79
存出保证金		1,254,988.80	2,060,256.00
交易性金融资产	6.4.7.2	945,008,946.75	895,321,510.55
其中：股票投资		945,008,946.75	895,321,510.55
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		763,615.02	190,598.20
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		1,034,326,008.91	978,683,895.08
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		211.15	-
应付赎回款		525,788.35	7,515,932.22
应付管理人报酬		670,157.88	676,775.39
应付托管费		125,654.61	126,895.36
应付销售服务费		284,670.44	302,675.30
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	5.96
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	127,460.94	170,035.91
负债合计		1,733,943.37	8,792,320.14
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	1,102,901,213.96	1,101,970,150.75
未分配利润	6.4.7.8	-70,309,148.42	-132,078,575.81
净资产合计		1,032,592,065.54	969,891,574.94
负债和净资产总计		1,034,326,008.91	978,683,895.08

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，华夏中证 1000 指数增强 A 基金份额净值 0.9412 元，华夏

中证 1000 指数增强 C 基金份额净值 0.9354 元；华夏中证 1000 指数增强基金份额总额 1,102,901,213.96 份（其中 A 类 161,769,305.58 份，C 类 941,131,908.38 份）。

6.2 利润表

会计主体：华夏中证 1000 指数增强型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		71,152,497.21	-22,858,909.62
1.利息收入		202,397.07	191,619.15
其中：存款利息收入	6.4.7.9	202,397.07	191,619.15
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-16,492,044.32	-12,668,039.38
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-26,499,371.61	-17,645,640.51
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	251,932.90	258,932.88
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	-78,057.36	-2,686,096.99
股利收益	6.4.7.14	9,833,451.75	7,404,765.24
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	87,374,907.75	-10,421,110.06
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	67,236.71	38,620.67
减：二、营业总支出		6,684,092.24	5,545,422.14
1.管理人报酬		4,049,531.59	3,351,030.01
2.托管费		759,287.19	628,318.09
3.销售服务费		1,783,440.17	1,478,379.31
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.信用减值损失	6.4.7.17	-	-
7.税金及附加		4,028.69	0.81
8.其他费用	6.4.7.18	87,804.60	87,693.92

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		64,468,404.97	-28,404,331.76
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		64,468,404.97	-28,404,331.76
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		64,468,404.97	-28,404,331.76

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：华夏中证 1000 指数增强型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益(若有)	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	1,101,970,150.75	-	-132,078,575.81	969,891,574.94
二、本期期初净资产（基金净值）	1,101,970,150.75	-	-132,078,575.81	969,891,574.94
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	931,063.21	-	61,769,427.39	62,700,490.60
（一）、综合收益总额	-	-	64,468,404.97	64,468,404.97
（二）、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）	931,063.21	-	-2,698,977.58	-1,767,914.37
其中：1.基金申购款	582,769,585.89	-	-24,528,891.26	558,240,694.63
2.基金赎回款	-581,838,522.68	-	21,829,913.68	-560,008,609.00
（三）、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）	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	1,102,901,213.96	-	-70,309,148.42	1,032,592,065.54
项目	上年度可比期间			

	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益 (若有)	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产 (基金净值)	1,042,700,448.53	-	25,855,042.50	1,068,555,491.03
二、本期期初净资产 (基金净值)	1,042,700,448.53	-	25,855,042.50	1,068,555,491.03
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-17,366,139.96	-	-59,229,926.65	-76,596,066.61
(一)、综合收益总额	-	-	-28,404,331.76	-28,404,331.76
(二)、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)	-17,366,139.96	-	-30,825,594.89	-48,191,734.85
其中：1.基金申购款	336,257,527.70	-	-45,868,273.16	290,389,254.54
2.基金赎回款	-353,623,667.66	-	15,042,678.27	-338,580,989.39
(三)、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)	-	-	-	-
四、本期期末净资产 (基金净值)	1,025,334,308.57	-	-33,374,884.15	991,959,424.42

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华夏中证 1000 指数增强型证券投资基金 (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[2021]3382 号文《关于准予华夏中证 1000 指数增强型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》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《华夏中证 1000 指数增强型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。本基金为契约型开放式，存续期限为不定期。本基金自 2021 年 11 月 24 日至 2021 年 12 月 3 日共募集 1,042,462,550.53 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(2021)验字第 60739337_A181 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华夏中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同》于 2021 年 12 月 7 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,042,700,448.53 份基金份额,其中认购资金利息折合 237,898.00 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,基金托管人为招商银行股份有限公司。

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,本基金的标的指数为中证 1000 指数。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(含创业板、存托凭证及其他中国证监会注册或核准上市的股票)、港股通标的股票、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)、衍生品(包括股指期货、股票期权、国债期货)、资产支持证券、货币市场工具(含同业存单、债券回购等)、银行存款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。本基金可根据法律法规的规定参与融资、转融通证券出借业务。

本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产的 80%,港股通标的股票的投资比例为股票资产的 0%-15%,投资于标的指数成份股及其备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%;每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后,现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%,其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

6.4.2 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、《资产管理产品相关会计处理规定》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 6.4.4 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。

6.4.3 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净资产变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计

政策、会计估计一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 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。

6.4.6 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 7%、3%、2% 缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	39,385,401.83
等于：本金	39,380,808.60
加：应计利息	4,593.23
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
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	40,499,586.62

等于：本金	40,496,680.32
加：应计利息	2,906.30
合计	79,884,988.45

注：其他存款为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	934,751,922.53	-	945,008,946.75	10,257,024.22
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	934,751,922.53	-	945,008,946.75	10,257,024.22

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 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	10,324,280.00	-	-	-
其中：股指期货	10,324,280.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	10,324,280.00	-	-	-

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IM2309	中证 1000 期货 IM2309 合	8	10,458,240.00	133,960.00

	约			
合计	-	-	-	133,960.00
减: 可抵销期货暂收款	-	-	-	133,960.00
净额	-	-	-	-

注: 衍生金融资产项下的利率/权益/其他衍生工具为国债/股指/商品期货投资, 净额为 0。在当日无负债结算制度下, 结算准备金已包括所持股指/商品/国债期货合约产生的持仓损益, 则衍生金融资产项下的股指/商品/国债期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 0。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 其他资产

无。

6.4.7.6 其他负债

单位: 人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	99.38
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中: 交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	84,302.56
其他	43,059.00
合计	127,460.94

6.4.7.7 实收基金

华夏中证 1000 指数增强 A

金额单位: 人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
----	----------------------------

	基金份额	账面金额
上年度末	117,133,015.72	117,133,015.72
本期申购	92,644,408.27	92,644,408.27
本期赎回（以“-”号填列）	-48,008,118.41	-48,008,118.41
本期末	161,769,305.58	161,769,305.58

华夏中证 1000 指数增强 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	984,837,135.03	984,837,135.03
本期申购	490,125,177.62	490,125,177.62
本期赎回（以“-”号填列）	-533,830,404.27	-533,830,404.27
本期末	941,131,908.38	941,131,908.38

6.4.7.8 未分配利润

华夏中证 1000 指数增强 A

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	-1,584,646.98	-12,061,262.49	-13,645,909.47
本期利润	-3,186,910.19	10,484,414.69	7,297,504.50
本期基金份额交易产生的变动数	-184,639.49	-2,971,976.59	-3,156,616.08
其中：基金申购款	-759,557.27	-4,965,427.22	-5,724,984.49
基金赎回款	574,917.78	1,993,450.63	2,568,368.41
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-4,956,196.66	-4,548,824.39	-9,505,021.05

华夏中证 1000 指数增强 C

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	-17,130,995.60	-101,301,670.74	-118,432,666.34
本期利润	-19,719,592.59	76,890,493.06	57,170,900.47
本期基金份额交易产生的变动数	2,750,080.21	-2,292,441.71	457,638.50
其中：基金申购款	-2,978,120.07	-15,825,786.70	-18,803,906.77
基金赎回款	5,728,200.28	13,533,344.99	19,261,545.27
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-34,100,507.98	-26,703,619.39	-60,804,127.37

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期

	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	69,166.55
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	68,741.91
结算备付金利息收入	64,488.61
其他	-
合计	202,397.07

注：其他存款利息收入为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金产生的利息收入。

6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	1,253,390,323.77
减：卖出股票成本总额	1,277,061,890.51
减：交易费用	2,827,804.87
买卖股票差价收入	-26,499,371.61

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
债券投资收益——利息收入	109.39
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	251,823.51
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	251,932.90

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	824,710.87
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	572,600.00

减：应计利息总额	112.60
减：交易费用	174.76
买卖债券差价收入	251,823.51

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.13 衍生工具收益

6.4.7.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.13.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
股指期货投资收益	-78,057.36

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资产生的股利收益	9,833,451.75
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	9,833,451.75

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
1.交易性金融资产	86,840,694.42
——股票投资	86,840,694.42
——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	534,213.33
——权证投资	-
——期货投资	534,213.33
4.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	87,374,907.75
----	---------------

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
基金赎回费收入	67,236.71
合计	67,236.71

6.4.7.17 信用减值损失

无。

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
审计费用	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	3,502.04
合计	87,804.60

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无或有事项。

6.4.8.2 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。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

根据华夏基金管理有限公司于 2023 年 1 月 6 日发布的公告，华夏基金管理有限公司股权结构变更为中信证券（出资比例 62.2%）、MACKENZIE FINANCIAL CORPORATION（出资比例 27.8%）、天津海鹏科技咨询有限公司（出资比例 10%）。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	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
上海华夏财富投资管理有限公司（“华夏财富”）	基金管理人的子公司
中信证券华南股份有限公司（“中信证券（华南）”）	基金管理人第一大股东的子公司

中信期货有限公司（“中信期货”）	基金管理人第一大股东的子公司
中信证券(山东)有限责任公司（“中信证券（山东）”）	基金管理人第一大股东的子公司

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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

无。

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月 30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30 日
当期发生的基金应支付的管理费	4,049,531.59	3,351,030.01
其中：支付销售机构的客户维护费	975,695.58	1,393,909.55

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 0.80%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×0.80%/当年天数。

③客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用按照代销机构所代销基金的份额保有量作为基数进行计算，从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月 30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30 日
当期发生的基金应支付的托管费	759,287.19	628,318.09

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 0.15%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×0.15%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得 销售	本期 2023年1月1日至2023年6月30日 当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华夏中证 1000 指数增强 A	华夏中证 1000 指数增强 C	合计
华夏 基金 管理 有限 公司	-	744,487.87	744,487.87
招商 银行	-	4,550.22	4,550.22
中信 证券	-	2,506.24	2,506.24
中信 证券 (山 东)	-	692.49	692.49
华夏 财富	-	553.86	553.86
中信 证券 (华 南)	-	21.15	21.15
中信 期货	-	7.10	7.10
合计	-	752,818.93	752,818.93
获得 销售	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日 当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华夏中证 1000 指数增强	华夏中证 1000 指数增强	合计

服务 费的 各关 联方 名称	A	C	
华夏 基金 管理 有限 公司	-	226,830.76	226,830.76
中信 证券 (山 东)	-	1,110.47	1,110.47
华夏 财富	-	497.44	497.44
中信 证券	-	247.77	247.77
招商 银行	-	123.79	123.79
中信 期货	-	89.43	89.43
合计	-	228,899.66	228,899.66

注：①支付基金销售机构的基金销售服务费按 C 类基金份额前一日基金资产净值 0.40% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给基金管理人，再由基金管理人计算并支付给各基金销售机构。

②基金销售服务费计算公式为：C 类日基金销售服务费 = 前一日 C 类基金资产净值 × 0.40% / 当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 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

6.4.10.4.1 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。

6.4.10.4.2 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

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.5.2 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

无。

6.4.10.6 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 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行活期存款	39,385,401.83	69,166.55	16,686,804.45	66,819.72

注：本基金的活期银行存款由基金托管人招商银行保管，按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.10.7 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 2023年1月1日至2023年6月30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	688343	云天励飞	新股发行	14,810	650,455.20
中信证券	688146	中船特气	新股发行	10,101	365,151.15
中信证券	001286	陕西能源	新股发行	37,667	361,603.20
中信证券	688581	安杰思	新股发行	1,629	204,928.20
中信证券	688539	高华科技	新股发行	5,334	203,865.48
中信证券	688522	纳睿雷达	新股发行	4,299	200,677.32
中信证券	301439	泓淋电力	新股发行	9,486	189,625.14
中信证券	688523	航天环宇	新股发行	4,717	103,113.62
中信证券	301293	三博脑科	新股发行	3,324	98,390.40
中信证券	301323	新莱福	新股发行	2,277	88,939.62
中信证券	688631	莱斯信息	新股发行	3,357	84,864.96
中信证券	301170	锡南科技	新股发行	2,496	84,864.00
中信证券	301157	华塑科技	新股发行	1,498	84,637.00
中信证券	601133	柏诚股份	新股发行	6,632	77,329.12
中信证券	301261	恒工精密	新股发行	1,973	72,803.70
中信证券	603281	江瀚新材	新股发行	863	30,714.17
中信证券	001367	海森药业	新股发行	549	24,419.52
中信证券	001324	长青科技	新股发行	1,131	21,353.28
中信证券	603162	海通发展	新股发行	523	19,481.75

上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 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	688223	晶科能源	新股发行	134,261	671,305.00
中信证券	688302	海创药业	新股发行	13,082	561,479.44
中信证券	301200	大族数控	新股发行	5,082	389,077.92
中信证券	688326	经纬恒润	新股发行	2,809	339,889.00
中信证券	301109	军信股份	新股发行	8,942	311,271.02
中信证券	301302	华如科技	新股发行	4,651	241,991.53
中信证券	688150	莱特光电	新股发行	5,626	124,053.30
中信证券	688290	景业智能	新股发行	3,040	103,025.60
中信证券	600938	中国海油	新股发行	3,000	32,400.00
中信证券	603132	金徽股份	新股发行	1,342	14,493.60
中信证券	603191	望变电气	新股发行	1,149	13,627.14
中信证券	603209	兴通股份	新股发行	595	12,804.40
中信证券	001266	宏英智能	新股发行	247	9,536.67
中信证券	603215	比依股份	新股发行	575	7,187.50
中信证券	603051	鹿山新材	新股发行	272	7,014.88

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配事项。

6.4.12 期末（2023 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 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

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
301486	致尚科技	2023-06-30	1 个月内(含)	新发流通过受	57.66	57.66	4,338	250,129.08	250,129.08	-

				限						
301395	仁信新材	2023-06-21	1 个月内(含)	新发流通受限	26.68	26.68	4,676	124,755.68	124,755.68	-
688249	晶合集成	2023-04-24	6 个月	新发流通受限	19.86	18.06	6,343	125,971.98	114,554.58	-
301292	海科新源	2023-06-29	1 个月内(含)	新发流通受限	19.99	19.99	5,241	104,767.59	104,767.59	-
301488	豪恩光电	2023-06-26	1 个月内(含)	新发流通受限	39.78	39.78	2,356	93,721.68	93,721.68	-
688472	阿特斯	2023-06-02	6 个月	新发流通受限	11.10	17.04	4,501	49,961.10	76,697.04	-
301202	朗威股份	2023-06-28	1 个月内(含)	新发流通受限	25.82	25.82	2,754	71,108.28	71,108.28	-
688603	天承科技	2023-06-30	1 个月内(含)	新发流通受限	55.00	55.00	1,251	68,805.00	68,805.00	-
301261	恒工	2023-06-29	1 个月	新	36.90	36.90	1,775	65,497.50	65,497.50	-

	精密		内(含)	发 流 通 受 限						
301358	湖南裕能	2023-02-01	6 个月	新发 流 通 受 限	23.77	42.89	1,428	33,943.56	61,246.92	-
688469	中芯集成	2023-04-28	6 个月	新发 流 通 受 限	5.69	5.41	10,592	60,268.48	57,302.72	-
688361	中科飞测	2023-05-12	6 个月	新发 流 通 受 限	23.60	64.67	831	19,611.60	53,740.77	-
688531	日联科技	2023-03-24	6 个月	新发 流 通 受 限	152.38	135.97	318	48,456.84	43,238.46	-
301325	曼恩斯特	2023-05-04	6 个月	新发 流 通 受 限	76.80	107.95	364	27,955.20	39,293.80	-
688146	中船特气	2023-04-13	6 个月	新发 流 通 受 限	36.15	38.13	1,011	36,547.65	38,549.43	-
301291	明阳电气	2023-06-21	6 个月	新发 流 通 受 限	38.13	31.03	1,206	45,984.78	37,422.18	-

				通受限						
688484	南芯科技	2023-03-28	6 个月	新发流通受限	39.99	36.71	976	39,030.24	35,828.96	-
001286	陕西能源	2023-03-31	6 个月	新发流通受限	9.60	9.41	3,767	36,163.20	35,447.47	-
001287	中电港	2023-03-30	6 个月	新发流通受限	11.88	21.02	1,386	16,465.68	29,133.72	-
688576	西山科技	2023-05-30	6 个月	新发流通受限	135.80	120.41	240	32,592.00	28,898.40	-
301246	宏源药业	2023-03-10	6 个月	新发流通受限	50.00	30.71	931	46,550.00	28,591.01	-
688352	颀中科技	2023-04-11	6 个月	新发流通受限	12.10	12.07	2,361	28,568.10	28,497.27	-
301486	致尚科技	2023-06-30	6 个月	新发流通受限	57.66	57.66	482	27,792.12	27,792.12	-

				限						
688507	索辰科技	2023-04-10	6 个月	新发流通受限	245.56	122.11	222	36,834.00	27,108.42	含 证 券 送 配
301310	鑫宏业	2023-05-26	6 个月	新发流通受限	67.28	65.43	409	27,517.52	26,760.87	-
688582	芯动联科	2023-06-21	6 个月	新发流通受限	26.74	40.68	648	17,327.52	26,360.64	-
301293	三博脑科	2023-04-25	6 个月	新发流通受限	29.60	71.42	333	9,856.80	23,782.86	-
301303	真兰仪表	2023-02-13	6 个月	新发流通受限	26.80	22.32	1,058	28,354.40	23,614.56	-
688552	航天南湖	2023-05-08	6 个月	新发流通受限	21.17	23.50	956	20,238.52	22,466.00	-
688570	天玛智控	2023-05-29	6 个月	新发流通受限	30.26	25.33	884	26,749.84	22,391.72	-
301307	美利	2023-04-14	6 个月	新	32.34	31.86	687	22,217.58	21,887.82	-

	信			发 流 通 受 限						
688543	国科 军工	2023-06-14	6 个月	新 发 流 通 受 限	43.67	53.05	410	17,904.70	21,750.50	-
301322	绿通 科技	2023-02-27	6 个月	新 发 流 通 受 限	131.11	53.24	391	34,219.71	20,816.84	含 证 券 送 配
688458	美芯 晟	2023-05-15	6 个月	新 发 流 通 受 限	75.00	90.76	221	16,575.00	20,057.96	-
688581	安杰 思	2023-05-12	6 个月	新 发 流 通 受 限	125.80	118.03	163	20,505.40	19,238.89	-
301317	鑫磊 股份	2023-01-12	6 个月	新 发 流 通 受 限	20.67	26.17	694	14,344.98	18,161.98	-
301262	海看 股份	2023-06-13	6 个月	新 发 流 通 受 限	30.22	25.50	692	20,912.24	17,646.00	-
301383	天键 股份	2023-05-31	6 个月	新 发 流 通	46.16	35.72	493	22,756.88	17,609.96	-

				通受限						
688562	航天软件	2023-05-15	6 个月	新发流通受限	12.68	22.31	726	9,205.68	16,197.06	-
301439	泓淋电力	2023-03-10	6 个月	新发流通受限	19.99	16.90	949	18,970.51	16,038.10	-
688623	双元科技	2023-05-31	6 个月	新发流通受限	125.88	86.79	178	22,406.64	15,448.62	-
301332	德尔玛	2023-05-09	6 个月	新发流通受限	14.81	13.73	1,122	16,616.82	15,405.06	-
301399	英特科技	2023-05-16	6 个月	新发流通受限	43.99	51.57	293	12,889.07	15,110.01	-
301305	朗坤环境	2023-05-15	6 个月	新发流通受限	25.25	19.69	753	19,013.25	14,826.57	-
301397	溯联股份	2023-06-15	6 个月	新发流通受限	53.27	40.20	362	19,283.74	14,552.40	-

				限						
301387	光大 同创	2023-04-10	6 个月	新发 流通 受限	58.32	45.36	307	17,904.24	13,925.52	-
301395	仁信 新材	2023-06-21	6 个月	新发 流通 受限	26.68	26.68	520	13,873.60	13,873.60	-
301210	金杨 股份	2023-06-21	6 个月	新发 流通 受限	57.88	49.17	281	16,264.28	13,816.77	-
688512	慧智 微	2023-05-08	6 个月	新发 流通 受限	20.92	19.16	721	15,083.32	13,814.36	-
301382	蜂助 手	2023-05-09	6 个月	新发 流通 受限	23.80	32.84	408	9,710.40	13,398.72	-
688433	华曙 高科	2023-04-07	6 个月	新发 流通 受限	26.66	31.50	418	11,143.88	13,167.00	-
301360	荣旗 科技	2023-04-17	6 个月	新发 流通 受限	71.88	92.60	134	9,631.92	12,408.40	-
301345	涛涛	2023-03-10	6 个月	新	73.45	46.64	266	19,537.70	12,406.24	-

	车业			发 流 通 受 限						
301292	海科 新源	2023-06-29	6 个月	新 发 流 通 受 限	19.99	19.99	583	11,654.17	11,654.17	-
688523	航天 环宇	2023-05-26	6 个月	新 发 流 通 受 限	21.86	23.85	472	10,317.92	11,257.20	-
603135	中重 科技	2023-03-29	6 个月	新 发 流 通 受 限	17.80	17.89	628	11,178.40	11,234.92	-
301141	中科 磁业	2023-03-27	6 个月	新 发 流 通 受 限	41.20	42.69	262	10,794.40	11,184.78	-
301225	恒勃 股份	2023-06-08	6 个月	新 发 流 通 受 限	35.66	33.26	333	11,874.78	11,075.58	-
301429	森泰 股份	2023-04-10	6 个月	新 发 流 通 受 限	28.75	21.02	499	14,346.25	10,488.98	-
301488	豪恩 汽电	2023-06-26	6 个月	新 发 流 通 受 限	39.78	39.78	262	10,422.36	10,422.36	-

				通受限						
601065	江盐集团	2023-03-31	6 个月	新发流通受限	10.36	11.84	875	9,065.00	10,360.00	-
688631	莱斯信息	2023-06-19	6 个月	新发流通受限	25.28	29.87	336	8,494.08	10,036.32	-
688479	友车科技	2023-05-04	6 个月	新发流通受限	33.99	29.49	332	11,284.68	9,790.68	-
301232	飞沃科技	2023-06-08	6 个月	新发流通受限	72.50	58.42	165	11,962.50	9,639.30	-
301376	致欧科技	2023-06-14	6 个月	新发流通受限	24.66	22.51	420	10,357.20	9,454.20	-
301355	南王科技	2023-06-02	6 个月	新发流通受限	17.55	16.75	563	9,880.65	9,430.25	-
301357	北方长龙	2023-04-11	6 个月	新发流通受限	50.00	48.39	190	9,500.00	9,194.10	-

				限						
301386	未来 电器	2023-03-21	6 个月	新发 流通 受限	29.99	23.79	378	11,336.22	8,992.62	-
301323	新莱 福	2023-05-29	6 个月	新发 流通 受限	39.06	39.36	228	8,905.68	8,974.08	-
688429	时创 能源	2023-06-20	6 个月	新发 流通 受限	19.20	25.53	346	6,643.20	8,833.38	-
301170	锡南 科技	2023-06-16	6 个月	新发 流通 受限	34.00	34.93	250	8,500.00	8,732.50	-
301281	科源 制药	2023-03-28	6 个月	新发 流通 受限	44.18	25.10	337	10,647.38	8,458.70	含 证 券 送 配
688535	华海 诚科	2023-03-28	6 个月	新发 流通 受限	35.00	51.23	161	5,635.00	8,248.03	-
601133	柏诚 股份	2023-03-31	6 个月	新发 流通 受限	11.66	12.26	664	7,742.24	8,140.64	-
301157	华塑	2023-03-01	6 个月	新	56.50	52.93	150	8,475.00	7,939.50	-

	科技			发 流 通 受 限						
301202	朗威 股份	2023-06-28	6 个月	新 发 流 通 受 限	25.82	25.82	306	7,900.92	7,900.92	-
301295	美硕 科技	2023-06-19	6 个月	新 发 流 通 受 限	37.40	36.07	215	8,041.00	7,755.05	-
301203	国泰 环保	2023-03-28	6 个月	新 发 流 通 受 限	46.13	34.40	225	10,379.25	7,740.00	-
688603	天承 科技	2023-06-30	6 个月	新 发 流 通 受 限	55.00	55.00	140	7,700.00	7,700.00	-
300804	广康 生化	2023-06-15	6 个月	新 发 流 通 受 限	42.45	32.97	226	9,593.70	7,451.22	-
301261	恒工 精密	2023-06-29	6 个月	新 发 流 通 受 限	36.90	36.90	198	7,306.20	7,306.20	-
301337	亚华 电子	2023-05-16	6 个月	新 发 流 通 受 限	32.60	30.37	232	7,563.20	7,045.84	-

				通受限						
301428	世纪恒通	2023-05-10	6 个月	新发流通受限	26.35	30.60	229	6,034.15	7,007.40	-
001380	华纬科技	2023-05-09	6 个月	新发流通受限	28.84	30.78	170	4,902.80	5,232.60	-
603125	常青科技	2023-03-30	6 个月	新发流通受限	25.98	24.53	160	4,156.80	3,924.80	-
001328	登康口腔	2023-03-29	6 个月	新发流通受限	20.68	25.49	145	2,998.60	3,696.05	-
001282	三联锻造	2023-05-15	6 个月	新发流通受限	27.93	33.03	105	2,932.65	3,468.15	-
001360	南矿集团	2023-03-31	6 个月	新发流通受限	15.38	14.87	177	2,722.26	2,631.99	-
001324	长青科技	2023-05-12	6 个月	新发流通受限	18.88	19.60	114	2,152.32	2,234.40	-

				限						
001367	海森药业	2023-03-30	6 个月	新发流通受限	44.48	39.48	55	2,446.40	2,171.40	-
603172	万丰股份	2023-04-28	6 个月	新发流通受限	14.58	16.13	122	1,778.76	1,967.86	-

注：①根据中国证监会《上市公司证券发行注册管理办法》，基金参与上市公司向特定对象发行股票所获得的股票，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。

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设定限售期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。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300346	南大光电	2023-06-26	重大事项	34.39	2023-07-06	35.60	11,020	356,884.30	378,977.80	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 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。

6.4.13.2 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。

6.4.13.3 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。

本基金管理人通过限制投资集中度来管理投资品种变现的流动性风险。除在“6.4.12 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。

6.4.13.3.1 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，本基金主要投资于基金合同约定的具有良好流动性的金融工具。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开放期内投资者历史申赎、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及比例，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。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 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。

本基金为指数增强型基金，以中证 1000 指数为标的指数，基金股票投资方面将主要采用指数增强量化投资策略。因此，利率风险不是本基金的主要风险。

6.4.13.4.2 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。

6.4.13.4.3 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。

本基金为指数增强型基金，主要采用指数增强量化投资策略，运用多因子分析模型构建投资组合，同时优化组合交易并严格控制组合风险。本基金管理人通常用敏感性指标来衡量市场价格风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	945,008,946.75	91.52	895,321,510.55	92.31
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-

交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
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	945,008,946.75	91.52	895,321,510.55	92.31

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。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中证 1000 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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	-5%	-43,530,159.27	-45,274,807.95
	+5%	43,530,159.27	45,274,807.95

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 6 月 30 日
第一层次	942,272,129.67
第二层次	1,244,411.98
第三层次	1,492,405.10
合计	945,008,946.75

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券等投资，若出现交易不活跃（包括重大事项停牌、境内证券涨停等导致的交易不活跃）和非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。本基金政策以导致各层次之

间转换的事项发生日作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

截至 2023 年 6 月 30 日止，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，其账面价值与公允价值差异很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告

7.1 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	945,008,946.75	91.36
	其中：股票	945,008,946.75	91.36
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	87,298,458.34	8.44
8	其他各项资产	2,018,603.82	0.20
9	合计	1,034,326,008.91	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 指数投资期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-

		21,115,255.40	2.04
C	制造业	665,664,406.80	64.47
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	30,829,623.00	2.99
E	建筑业	21,906,480.04	2.12
F	批发和零售业	26,967,984.53	2.61
G	交通运输、仓储和邮政业	21,521,241.62	2.08
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	74,040,995.81	7.17
J	金融业	20,421,095.07	1.98
K	房地产业	14,366,842.60	1.39
L	租赁和商务服务业	7,883,098.00	0.76
M	科学研究和技术服务业	7,184,430.00	0.70
N	水利、环境和公共设施管理业	13,944,739.58	1.35
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	7,899,419.00	0.77
R	文化、体育和娱乐业	6,539,950.00	0.63
S	综合	-	-
	合计	940,285,561.45	91.06

7.2.2 积极投资期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	4,410,685.46	0.43
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	35,892.27	0.00
E	建筑业	8,140.64	0.00
F	批发和零售业	38,587.92	0.00
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	134,194.70	0.01
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	49,534.88	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	22,566.57	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	23,782.86	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	4,723,385.30	0.46

7.3 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

7.3.1 期末指数投资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	002126	银轮股份	525,500	9,301,350.00	0.90
2	603129	春风动力	56,200	9,098,780.00	0.88
3	002139	拓邦股份	687,000	8,965,350.00	0.87
4	600835	上海机电	518,700	8,911,266.00	0.86
5	600933	爱柯迪	377,800	8,798,962.00	0.85
6	002851	麦格米特	241,000	8,789,270.00	0.85
7	603305	旭升集团	311,335	8,676,906.45	0.84
8	000543	皖能电力	1,314,400	8,675,040.00	0.84
9	002085	万丰奥威	1,229,800	8,522,514.00	0.83
10	601882	海天精工	254,300	8,468,190.00	0.82
11	603298	杭叉集团	359,000	8,454,450.00	0.82
12	002130	沃尔核材	1,036,700	8,418,004.00	0.82
13	002929	润建股份	193,900	8,417,199.00	0.82
14	002292	奥飞娱乐	840,100	8,384,198.00	0.81
15	601137	博威合金	537,100	8,357,276.00	0.81
16	688033	天宜上佳	435,537	8,327,467.44	0.81
17	000951	中国重汽	492,900	8,305,365.00	0.80
18	002484	江海股份	383,200	8,158,328.00	0.79
19	300470	中密控股	175,710	8,121,316.20	0.79
20	000928	中钢国际	837,667	8,083,486.55	0.78
21	300206	理邦仪器	534,600	8,061,768.00	0.78
22	300224	正海磁材	626,711	8,059,503.46	0.78
23	603368	柳药集团	322,597	7,971,371.87	0.77
24	601126	四方股份	523,400	7,950,446.00	0.77
25	600458	时代新材	662,000	7,937,380.00	0.77
26	002724	海洋王	913,400	7,928,312.00	0.77
27	300382	斯莱克	600,900	7,925,871.00	0.77
28	603187	海容冷链	396,300	7,922,037.00	0.77
29	300666	江丰电子	116,315	7,904,767.40	0.77
30	002318	久立特材	463,200	7,888,296.00	0.76
31	603300	华铁应急	1,446,440	7,883,098.00	0.76

32	603197	保隆科技	145,000	7,866,250.00	0.76
33	601890	亚星锚链	679,000	7,862,820.00	0.76
34	603690	至纯科技	225,480	7,855,723.20	0.76
35	002044	美年健康	1,104,000	7,849,440.00	0.76
36	300696	爱乐达	317,692	7,815,223.20	0.76
37	002978	安宁股份	242,800	7,796,308.00	0.76
38	688268	华特气体	96,454	7,786,731.42	0.75
39	002060	粤水电	1,179,800	7,763,084.00	0.75
40	300185	通裕重工	2,777,000	7,747,830.00	0.75
41	000690	宝新能源	1,100,900	7,728,318.00	0.75
42	002782	可立克	505,200	7,724,508.00	0.75
43	000682	东方电子	794,400	7,721,568.00	0.75
44	603032	德新科技	223,440	7,717,617.60	0.75
45	601678	滨化股份	1,662,100	7,712,144.00	0.75
46	603439	贵州三力	451,800	7,707,708.00	0.75
47	600312	平高电气	622,000	7,706,580.00	0.75
48	300775	三角防务	227,500	7,684,950.00	0.74
49	603881	数据港	339,140	7,661,172.60	0.74
50	688037	芯源微	44,681	7,638,216.95	0.74
51	688261	东微半导	54,500	7,622,915.00	0.74
52	603871	嘉友国际	484,420	7,610,238.20	0.74
53	603033	三维股份	373,500	7,600,725.00	0.74
54	002158	汉钟精机	304,000	7,587,840.00	0.73
55	000028	国药一致	173,810	7,579,854.10	0.73
56	300634	彩讯股份	287,100	7,579,440.00	0.73
57	002847	盐津铺子	89,100	7,577,955.00	0.73
58	300393	中来股份	538,700	7,563,348.00	0.73
59	002641	公元股份	1,340,433	7,560,042.12	0.73
60	000860	顺鑫农业	224,400	7,560,036.00	0.73
61	002216	三全食品	484,800	7,553,184.00	0.73
62	688100	威胜信息	252,790	7,535,669.90	0.73
63	688066	航天宏图	123,008	7,491,187.20	0.73
64	603297	永新光学	93,700	7,486,630.00	0.73
65	002063	远光软件	861,180	7,475,042.40	0.72
66	600285	羚锐制药	465,000	7,467,900.00	0.72
67	688278	特宝生物	169,486	7,442,130.26	0.72
68	300294	博雅生物	205,000	7,437,400.00	0.72
69	300827	上能电气	206,259	7,435,636.95	0.72
70	300777	中简科技	157,204	7,429,461.04	0.72
71	600483	福能股份	642,500	7,420,875.00	0.72
72	300457	赢合科技	420,000	7,417,200.00	0.72
73	300109	新开源	297,600	7,401,312.00	0.72
74	300398	飞凯材料	430,400	7,398,576.00	0.72

75	688389	普门科技	314,622	7,390,470.78	0.72
76	300602	飞荣达	477,000	7,388,730.00	0.72
77	301268	铭利达	176,200	7,377,494.00	0.71
78	601567	三星医疗	578,500	7,306,455.00	0.71
79	002768	国恩股份	300,993	7,281,020.67	0.71
80	301095	广立微	88,000	7,273,200.00	0.70
81	002737	葵花药业	298,500	7,265,490.00	0.70
82	300232	洲明科技	790,100	7,221,514.00	0.70
83	002461	珠江啤酒	816,400	7,192,484.00	0.70
84	688315	诺禾致源	270,600	7,184,430.00	0.70
85	600428	中远海特	1,138,500	7,172,550.00	0.69
86	600197	伊力特	263,500	7,159,295.00	0.69
87	000915	华特达因	202,800	7,156,812.00	0.69
88	300811	铂科新材	120,380	7,155,387.20	0.69
89	300633	开立医疗	131,125	7,146,312.50	0.69
90	600641	万业企业	374,340	7,146,150.60	0.69
91	603896	寿仙谷	161,146	7,138,767.80	0.69
92	000528	柳工	903,000	7,133,700.00	0.69
93	002987	京北方	325,320	7,131,014.40	0.69
94	300171	东富龙	311,800	7,093,450.00	0.69
95	600908	无锡银行	1,323,200	7,092,352.00	0.69
96	002727	一心堂	268,200	7,080,480.00	0.69
97	002549	凯美特气	613,400	7,054,100.00	0.68
98	600583	海油工程	1,190,400	6,963,840.00	0.67
99	603567	珍宝岛	465,200	6,959,392.00	0.67
100	300525	博思软件	450,859	6,916,177.06	0.67
101	600007	中国国贸	373,000	6,907,960.00	0.67
102	600496	精工钢构	1,851,800	6,907,214.00	0.67
103	300443	金雷股份	194,500	6,895,025.00	0.67
104	601375	中原证券	1,857,800	6,892,438.00	0.67
105	002895	川恒股份	348,900	6,873,330.00	0.67
106	002135	东南网架	1,061,200	6,855,352.00	0.66
107	002746	仙坛股份	863,900	6,807,532.00	0.66
108	600869	远东股份	1,223,100	6,751,512.00	0.65
109	000875	吉电股份	1,241,000	6,688,990.00	0.65
110	002612	朗姿股份	280,200	6,663,156.00	0.65
111	688019	安集科技	40,401	6,659,296.83	0.64
112	002034	旺能环境	419,700	6,635,457.00	0.64
113	603466	风语筑	470,500	6,539,950.00	0.63
114	603609	禾丰股份	717,785	6,531,843.50	0.63
115	603301	振德医疗	219,000	6,486,780.00	0.63
116	603323	苏农银行	1,528,550	6,435,195.50	0.62
117	601975	招商南油	2,243,200	6,415,552.00	0.62

118	300075	数字政通	255,900	6,366,792.00	0.62
119	600971	恒源煤电	787,000	6,130,730.00	0.59
120	600502	安徽建工	1,147,500	6,058,800.00	0.59
121	301087	可孚医疗	120,380	5,934,734.00	0.57
122	300726	宏达电子	112,400	5,026,528.00	0.49
123	002283	天润工业	777,100	4,988,982.00	0.48
124	605123	派克新材	40,800	4,432,920.00	0.43
125	688190	云路股份	59,501	4,343,573.00	0.42
126	301015	百洋医药	156,206	4,336,278.56	0.42
127	300639	凯普生物	68,700	688,374.00	0.07
128	600330	天通股份	52,700	628,184.00	0.06
129	300346	南大光电	11,020	378,977.80	0.04
130	600125	铁龙物流	52,900	319,516.00	0.03
131	603693	江苏新能	22,600	316,400.00	0.03
132	600557	康缘药业	11,500	315,790.00	0.03
133	600639	浦东金桥	25,200	312,732.00	0.03
134	603179	新泉股份	7,100	311,619.00	0.03
135	002635	安洁科技	21,100	291,180.00	0.03
136	600562	国睿科技	16,900	273,780.00	0.03
137	002100	天康生物	33,100	273,075.00	0.03
138	000550	江铃汽车	19,400	268,496.00	0.03
139	601908	京运通	43,300	261,965.00	0.03
140	603588	高能环境	27,234	255,182.58	0.02
141	300119	瑞普生物	13,300	236,740.00	0.02
142	600123	兰花科创	27,430	224,377.40	0.02
143	603678	火炬电子	6,300	217,098.00	0.02
144	002539	云图控股	23,400	210,132.00	0.02
145	300101	振芯科技	9,913	192,213.07	0.02
146	301267	华夏眼科	820	49,979.00	0.00
147	301363	美好医疗	445	19,575.55	0.00
148	301206	三元生物	275	9,622.25	0.00
149	301316	慧博云通	359	8,203.15	0.00
150	603713	密尔克卫	38	3,385.42	0.00
151	603236	移远通信	57	3,289.47	0.00
152	300593	新雷能	95	2,176.45	0.00
153	300685	艾德生物	76	1,843.76	0.00
154	603733	仙鹤股份	86	1,793.10	0.00
155	300623	捷捷微电	83	1,503.96	0.00
156	000049	德赛电池	40	1,411.20	0.00
157	688007	光峰科技	64	1,334.40	0.00
158	002597	金禾实业	54	1,274.40	0.00
159	002961	瑞达期货	77	1,109.57	0.00
160	002051	中工国际	93	1,109.49	0.00

161	300432	富临精工	88	1,022.56	0.00
162	603583	捷昌驱动	46	990.84	0.00
163	300458	全志科技	33	899.25	0.00
164	603728	鸣志电器	10	803.00	0.00
165	002258	利尔化学	51	658.41	0.00
166	603612	索通发展	30	519.90	0.00
167	300035	中科电气	35	420.70	0.00
168	603876	鼎胜新材	20	383.80	0.00
169	002541	鸿路钢构	10	288.10	0.00
170	601677	明泰铝业	20	277.60	0.00
171	600740	山西焦化	44	225.72	0.00
172	000672	上峰水泥	16	146.08	0.00
173	002145	中核钛白	20	117.80	0.00
174	600360	华微电子	2	13.76	0.00

7.3.2 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	301291	明阳电气	12,054.00	391,066.98	0.04
2	688525	佰维存储	4,614.00	368,612.46	0.04
3	300740	水羊股份	20,500.00	317,750.00	0.03
4	300487	蓝晓科技	4,650.00	290,253.00	0.03
5	301486	致尚科技	4,820.00	277,921.20	0.03
6	600416	湘电股份	13,800.00	263,442.00	0.03
7	600378	昊华科技	6,500.00	244,660.00	0.02
8	301210	金杨股份	2,801.00	143,168.37	0.01
9	301395	仁信新材	5,196.00	138,629.28	0.01
10	301292	海科新源	5,824.00	116,421.76	0.01
11	688249	晶合集成	6,343.00	114,554.58	0.01
12	301488	豪恩汽电	2,618.00	104,144.04	0.01
13	301202	朗威股份	3,060.00	79,009.20	0.01
14	688472	阿特斯	4,501.00	76,697.04	0.01
15	688603	天承科技	1,391.00	76,505.00	0.01
16	300804	广康生化	2,226.00	76,071.22	0.01
17	301261	恒工精密	1,973.00	72,803.70	0.01
18	301358	湖南裕能	1,428.00	61,246.92	0.01
19	688469	中芯集成	10,592.00	57,302.72	0.01
20	688361	中科飞测	831.00	53,740.77	0.01
21	688531	日联科技	318.00	43,238.46	0.00
22	301325	曼恩斯特	364.00	39,293.80	0.00
23	688146	中船特气	1,011.00	38,549.43	0.00
24	688484	南芯科技	976.00	35,828.96	0.00

25	001286	陕西能源	3,767.00	35,447.47	0.00
26	301246	宏源药业	1,003.00	30,847.49	0.00
27	001287	中电港	1,386.00	29,133.72	0.00
28	301391	卡莱特	247.00	28,940.99	0.00
29	688576	西山科技	240.00	28,898.40	0.00
30	688352	颀中科技	2,361.00	28,497.27	0.00
31	688507	索辰科技	222.00	27,108.42	0.00
32	301310	鑫宏业	409.00	26,760.87	0.00
33	688582	芯动联科	648.00	26,360.64	0.00
34	301356	天振股份	1,105.00	24,199.50	0.00
35	301293	三博脑科	333.00	23,782.86	0.00
36	301303	真兰仪表	1,058.00	23,614.56	0.00
37	301368	丰立智能	337.00	23,317.03	0.00
38	301389	隆扬电子	1,269.00	23,070.42	0.00
39	688552	航天南湖	956.00	22,466.00	0.00
40	688570	天玛智控	884.00	22,391.72	0.00
41	301307	美利信	687.00	21,887.82	0.00
42	688543	国科军工	410.00	21,750.50	0.00
43	301322	绿通科技	391.00	20,816.84	0.00
44	688458	美芯晟	221.00	20,057.96	0.00
45	688581	安杰思	163.00	19,238.89	0.00
46	301317	鑫磊股份	694.00	18,161.98	0.00
47	301377	鼎泰高科	770.00	17,710.00	0.00
48	301262	海看股份	692.00	17,646.00	0.00
49	301383	天键股份	493.00	17,609.96	0.00
50	301397	溯联股份	418.00	16,926.80	0.00
51	301230	泓博医药	376.00	16,882.40	0.00
52	688562	航天软件	726.00	16,197.06	0.00
53	301439	泓淋电力	949.00	16,038.10	0.00
54	301115	建科股份	685.00	15,659.10	0.00
55	301396	宏景科技	475.00	15,508.75	0.00
56	688623	双元科技	178.00	15,448.62	0.00
57	301332	德尔玛	1,122.00	15,405.06	0.00
58	301223	中荣股份	815.00	15,256.80	0.00
59	301399	英特科技	293.00	15,110.01	0.00
60	301280	珠城科技	418.00	14,947.68	0.00
61	301305	朗坤环境	753.00	14,826.57	0.00
62	301335	天元宠物	588.00	14,017.92	0.00
63	301387	光大同创	307.00	13,925.52	0.00
64	688512	慧智微	721.00	13,814.36	0.00
65	301382	蜂助手	408.00	13,398.72	0.00
66	688433	华曙高科	418.00	13,167.00	0.00
67	301277	新天地	658.00	12,837.58	0.00

68	301365	矩阵股份	774.00	12,740.04	0.00
69	301379	天山电子	449.00	12,540.57	0.00
70	301360	荣旗科技	134.00	12,408.40	0.00
71	301345	涛涛车业	266.00	12,406.24	0.00
72	688523	航天环宇	472.00	11,257.20	0.00
73	603135	中重科技	628.00	11,234.92	0.00
74	301141	中科磁业	262.00	11,184.78	0.00
75	301225	恒勃股份	333.00	11,075.58	0.00
76	301429	森泰股份	499.00	10,488.98	0.00
77	301313	凡拓数创	247.00	10,455.51	0.00
78	601065	江盐集团	875.00	10,360.00	0.00
79	688631	莱斯信息	336.00	10,036.32	0.00
80	688479	友车科技	332.00	9,790.68	0.00
81	301232	飞沃科技	165.00	9,639.30	0.00
82	301398	星源卓镁	255.00	9,562.50	0.00
83	301265	华新环保	819.00	9,516.78	0.00
84	301376	致欧科技	420.00	9,454.20	0.00
85	301355	南王科技	563.00	9,430.25	0.00
86	301357	北方长龙	190.00	9,194.10	0.00
87	301386	未来电器	378.00	8,992.62	0.00
88	301323	新莱福	228.00	8,974.08	0.00
89	688429	时创能源	346.00	8,833.38	0.00
90	301170	锡南科技	250.00	8,732.50	0.00
91	301273	瑞晨环保	277.00	8,686.72	0.00
92	603065	宿迁联盛	581.00	8,656.90	0.00
93	301326	捷邦科技	227.00	8,632.81	0.00
94	301281	科源制药	337.00	8,458.70	0.00
95	688535	华海诚科	161.00	8,248.03	0.00
96	601133	柏诚股份	664.00	8,140.64	0.00
97	301157	华塑科技	150.00	7,939.50	0.00
98	301388	欣灵电气	292.00	7,840.20	0.00
99	301295	美硕科技	215.00	7,755.05	0.00
100	301203	国泰环保	225.00	7,740.00	0.00
101	301337	亚华电子	232.00	7,045.84	0.00
102	301428	世纪恒通	229.00	7,007.40	0.00
103	301319	唯特偶	115.00	6,882.75	0.00
104	001380	华纬科技	170.00	5,232.60	0.00
105	301228	实朴检测	273.00	4,253.34	0.00
106	603125	常青科技	160.00	3,924.80	0.00
107	001328	登康口腔	145.00	3,696.05	0.00
108	001282	三联锻造	105.00	3,468.15	0.00
109	001360	南矿集团	177.00	2,631.99	0.00
110	001324	长青科技	114.00	2,234.40	0.00

111	001367	海森药业	55.00	2,171.40	0.00
112	603172	万丰股份	122.00	1,967.86	0.00
113	688122	西部超导	18.00	1,003.14	0.00
114	002497	雅化集团	37.00	657.86	0.00
115	601158	重庆水务	80.00	444.80	0.00
116	002407	多氟多	17.00	337.62	0.00
117	000683	远兴能源	3.00	21.57	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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	002006	精工科技	12,722,930.00	1.31
2	002549	凯美特气	12,151,600.00	1.25
3	002060	粤水电	11,124,994.00	1.15
4	603368	柳药集团	10,987,161.79	1.13
5	603690	至纯科技	10,974,214.00	1.13
6	600995	南网储能	10,895,010.68	1.12
7	300726	宏达电子	10,597,044.00	1.09
8	300007	汉威科技	10,234,340.00	1.06
9	002051	中工国际	10,064,018.45	1.04
10	002276	万马股份	10,059,250.00	1.04
11	002390	信邦制药	9,894,751.00	1.02
12	603338	浙江鼎力	8,901,293.00	0.92
13	300443	金雷股份	8,854,725.00	0.91
14	300358	楚天科技	8,780,394.00	0.91
15	603297	永新光学	8,740,618.00	0.90
16	300393	中来股份	8,738,729.00	0.90
17	002135	东南网架	8,660,541.00	0.89
18	688389	普门科技	8,530,521.20	0.88
19	002139	拓邦股份	8,449,098.00	0.87
20	002929	润建股份	8,433,129.00	0.87

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。

7.4.2 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	300502	新易盛	19,338,773.02	1.99
2	300229	拓尔思	16,264,133.54	1.68
3	002675	东诚药业	14,729,614.07	1.52

4	300726	宏达电子	14,530,151.02	1.50
5	002463	沪电股份	14,033,109.82	1.45
6	002276	万马股份	13,510,449.72	1.39
7	002472	双环传动	12,928,239.00	1.33
8	603236	移远通信	12,881,872.50	1.33
9	002051	中工国际	12,660,283.00	1.31
10	603920	世运电路	12,552,530.68	1.29
11	300346	南大光电	12,376,215.32	1.28
12	000810	创维数字	12,182,683.00	1.26
13	600481	双良节能	12,131,612.83	1.25
14	002832	比音勒芬	12,096,919.86	1.25
15	300394	天孚通信	11,992,232.93	1.24
16	300054	鼎龙股份	11,941,947.00	1.23
17	300803	指南针	11,715,722.19	1.21
18	000811	冰轮环境	11,360,323.26	1.17
19	002006	精工科技	11,241,378.76	1.16
20	000933	神火股份	11,107,300.20	1.15

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。

7.4.3 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	1,239,908,632.29
卖出股票收入（成交）总额	1,253,390,323.77

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。

7.5 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。

7.6 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。

7.7 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。

7.8 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。

7.9 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。

7.10 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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 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。

7.11.2 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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。

7.12.2 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。

7.12.3 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	1,254,988.80
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	763,615.02
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,018,603.82

7.12.4 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。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 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。

7.12.5.2 期末积极投资前五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	301486	致尚科技	277,921.20	0.03	新发流通受限
2	301291	明阳电气	37,422.18	0.00	新发流通受限

7.12.6 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。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	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	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
华夏中证 1000 指数增强 A	3,897	41,511.24	50,820,851.21	31.42%	110,948,454.37	68.58%
华夏中证 1000 指数增强 C	11,827	79,574.86	432,293,278.06	45.93%	508,838,630.32	54.07%
合计	15,724	70,141.26	483,114,129.27	43.80%	619,787,084.69	56.20%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	华夏中证 1000 指数增强 A	907,764.67	0.56%
	华夏中证 1000 指数增强 C	520.29	0.00%
	合计	908,284.96	0.08%

8.3 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的情况

项目	份额级别	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	华夏中证 1000 指数增强 A	0
	华夏中证 1000 指数增强 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放	华夏中证 1000 指数增强 A	0
	华夏中证 1000 指数增强 C	0

式基金	合计	0
-----	----	---

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华夏中证 1000 指数增强 A	华夏中证 1000 指数增强 C
基金合同生效日（2021 年 12 月 7 日）基金份额总额	134,043,843.62	908,656,604.91
本报告期期初基金份额总额	117,133,015.72	984,837,135.03
本报告期基金总申购份额	92,644,408.27	490,125,177.62
减：本报告期基金总赎回份额	48,008,118.41	533,830,404.27
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	161,769,305.58	941,131,908.38

§10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 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

本报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期未发生影响基金管理人经营或基金运营业务的诉讼。

本报告期无涉及基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 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。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金所聘用的会计师事务所未发生改变。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人及其高级管理人员在本报告期内无受稽查或处罚等情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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	
海通证券	2	2,475,922,644.37	100.00%	1,376,051.35	100.00%	-

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。

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 有较强的全方位金融服务能力和水平：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；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

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 本基金管理人根据上述标准进行评估并确定选用的券商。

ii 本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议/证券经纪服务协议。

③除本表列示外，本基金本报告期末选择其他交易单元作为本基金交易单元。

④本报告期内，本基金租用的券商交易单元未发生变更。

10.7.2 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		权证交易		基金交易	
	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	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
海通证券	824,710.87	100.00%	-	-	-	-	-	-

10.8 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公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-01-06
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	2023-01-19
3	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	2023-02-24
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	2023-03-03
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	2023-03-11
6	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	2023-03-23
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	2023-03-30
8	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	2023-04-01
9	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	2023-04-13
10	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	2023-04-15
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	2023-04-27
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	2023-05-13
13	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	2023-05-27
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	2023-05-31

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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	2023-01-01 至	385,721,051.64	311,049,597.83	385,721,051.64	311,049,597.83	28.20%

		2023-02-21, 2023-02-28 至 2023-06-30					
产品特有风险							
<p>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。</p> <p>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。</p>							

§12 备查文件目录

12.1 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 指数增强型证券投资基金基金合同》；
- 3、《华夏中证 1000 指数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。

12.2 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。

12.3 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

二〇二三年八月三十日