

**华夏中证 500 指数智选增强型
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：国信证券股份有限公司

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。

基金托管人国信证券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.....	11
§6 中期报告财务会计报告（未经审计）.....	11
6.1 资产负债表.....	11
6.2 利润表.....	13
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	14
6.4 报表附注.....	15
§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.....	48
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.....	59
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	61
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.....	61
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.....	61
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.....	61
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.....	61
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	61
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	61
7.12 投资组合报告附注.....	62
§8 基金份额持有人信息.....	62
§9 开放式基金份额变动.....	63
§10 重大事件揭示.....	64
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	67
§12 备查文件目录.....	67

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华夏中证 500 指数智选增强型证券投资基金	
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	
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	
报告期末基金份额总额	2,765,779,947.49 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 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额总额	2,099,996,680.21 份	665,783,267.28 份

2.2 基金产品说明

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×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	国信证券股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李彬	薛璐
	联系电话	400-818-6666	0755-22940163
	电子邮箱	service@ChinaAMC.com	03339@guosen.com.cn
客户服务电话		400-818-6666	0755-61897778

传真	010-63136700	0755-22940165
注册地址	北京市顺义区安庆大街甲3号院	深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层
办公地址	北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座8层	深圳市福田区福华一路125号国信金融大厦19楼
邮政编码	100033	518000
法定代表人	杨明辉	张纳沙

2.5 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
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 500 指数智选增强 A	华夏中证 500 指数智选增强 C
本期已实现收益	142,704,808.80	32,615,021.47
本期利润	169,172,773.87	29,858,915.29
加权平均基金份额本期利润	0.0769	0.0498
本期加权平均净值利润率	7.89%	5.13%
本期基金份额净值增长率	7.95%	7.74%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 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
期末可供分配利润	-40,723,749.04	-17,803,794.75
期末可供分配基金份额利润	-0.0194	-0.0267
期末基金资产净值	2,059,272,931.17	647,979,472.53
期末基金份额净值	0.9806	0.9733

3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 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
基金份额累计净值增长率	-1.94%	-2.67%

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 500 指数智选增强 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	0.48%	0.75%	-0.77%	0.89%	1.25%	-0.14%
过去三个月	-1.01%	0.65%	-5.10%	0.78%	4.09%	-0.13%
过去六个月	7.95%	0.67%	2.20%	0.75%	5.75%	-0.08%
过去一年	6.30%	0.88%	-6.65%	0.91%	12.95%	-0.03%
自基金合同生效起至今	-1.94%	1.10%	-13.71%	1.10%	11.77%	0.00%

华夏中证 500 指数智选增强 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	0.45%	0.75%	-0.77%	0.89%	1.22%	-0.14%
过去三个月	-1.11%	0.65%	-5.10%	0.78%	3.99%	-0.13%
过去六个月	7.74%	0.67%	2.20%	0.75%	5.54%	-0.08%
过去一年	5.89%	0.88%	-6.65%	0.91%	12.54%	-0.03%
自基金合同生效起至今	-2.67%	1.10%	-13.71%	1.10%	11.04%	0.00%

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 500 指数智选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 8 月 11 日至 2023 年 6 月 30 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		
孙蒙	本基金的 基金经理	2021-08-11	-	9 年	硕士。曾任中信建投证券股份有限公司研究员、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 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 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。

上半年，全球主要经济体增长放缓，美欧通胀见顶回落，但仍处高位，主要经济体货币政策紧缩外溢效应突出，硅谷银行倒闭、瑞士信贷被收购等事件引发国际金融市场大幅震荡；西方继续对俄实施大规模制裁，地缘政治冲突升级并进一步影响全球经济秩序的风险犹存。国内方面，先后经历需求释放以及去库存带来的需求回落，流动性充裕。权益市场赚钱难度较大，一方面，去库存阶段使然，另一方面，缺乏能够短期兑现利润的超预期产业趋势。值得一提的是 AI 方向，正在发生长期变革性的产业变化，产业链涉及硬件和软件，并可渗透至社会的各行各业。目前处于发展早期，个股波动较大。

市场方面，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，中小市值板块相对占优。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 6 月 30 日，华夏中证 500 指数智选增强 A 基金份额净值为 0.9806 元，本报告期份额净值增长率为 7.95%；华夏中证 500 指数智选增强 C 基金份额净值为 0.9733 元，本报告期份额净值增长率为 7.74%，同期业绩比较基准增长率为 2.20%。本基金本报告期 A 类份额跟踪偏离度为 +5.75%，C 类份额跟踪偏离度为 +5.54%。

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，本基金管理人作为准确、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

本基金本报告期未进行利润分配，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合规守信情况声明

报告期内，国信证券股份有限公司（以下简称“托管人”）严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规的规定及基金合同的约定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

报告期内，托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益分配的情况等方面进行了必要的监督、复核和审查。

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

托管人认真复核了本报告中的财务指标、净值表现等财务信息相关内容，认为其不存在虚假记载、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 500 指数智选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	152,983,775.30	137,080,910.88
结算备付金		14,952,462.34	13,339,993.94
存出保证金		3,719,090.94	4,735,722.32
交易性金融资产	6.4.7.2	2,546,291,038.57	2,399,106,438.07
其中：股票投资		2,546,291,038.57	2,398,353,919.34
基金投资		-	-
债券投资		-	752,518.73
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		-	5,067,350.00
应收股利		-	-
应收申购款		6,229,870.93	2,144,037.24
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		2,724,176,238.08	2,561,474,452.45
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		6,027,894.40	-
应付赎回款		3,520,535.07	2,892,661.66
应付管理人报酬		1,772,544.85	1,766,052.06
应付托管费		221,568.10	220,756.48
应付销售服务费		211,576.90	142,920.20
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	3.83
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	5,169,715.06	3,722,041.86
负债合计		16,923,834.38	8,744,436.09
净资产：			

实收基金	6.4.7.7	2,765,779,947.49	2,812,780,343.31
未分配利润	6.4.7.8	-58,527,543.79	-260,050,326.95
净资产合计		2,707,252,403.70	2,552,730,016.36
负债和净资产总计		2,724,176,238.08	2,561,474,452.45

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，华夏中证 500 指数智选增强 A 基金份额净值 0.9806 元，华夏中证 500 指数智选增强 C 基金份额净值 0.9733 元；华夏中证 500 指数智选增强基金份额总额 2,765,779,947.49 份（其中 A 类 2,099,996,680.21 份，C 类 665,783,267.28 份）。

6.2 利润表

会计主体：华夏中证 500 指数智选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		212,423,127.92	-308,795,637.07
1.利息收入		1,038,029.17	1,243,431.52
其中：存款利息收入	6.4.7.9	1,038,029.17	1,243,431.52
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）		187,596,354.87	-327,876,643.03
其中：股票投资收益	6.4.7.10	152,695,118.41	-346,113,335.33
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	560,663.29	274,530.45
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	-264,019.59	-8,205,455.51
股利收益	6.4.7.14	34,604,592.76	26,167,617.36
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	23,711,858.89	17,731,724.22
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	76,884.99	105,850.22
减：二、营业总支出		13,391,438.76	13,714,174.27
1.管理人报酬		10,799,984.15	11,365,816.44
2.托管费		1,349,998.01	1,420,727.08
3.销售服务费		1,147,235.27	828,031.37
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		1.78	20.43
8.其他费用	6.4.7.18	94,219.55	99,578.95
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		199,031,689.16	-322,509,811.34
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		199,031,689.16	-322,509,811.34
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		199,031,689.16	-322,509,811.34

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：华夏中证 500 指数智选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）	2,812,780,343.31	-	-260,050,326.95	2,552,730,016.36
二、本期期初净资产（基金净值）	2,812,780,343.31	-	-260,050,326.95	2,552,730,016.36
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-47,000,395.82	-	201,522,783.16	154,522,387.34
（一）、综合收益总额	-	-	199,031,689.16	199,031,689.16
（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）	-47,000,395.82	-	2,491,094.00	-44,509,301.82
其中：1.基金申购款	534,861,793.52	-	-11,079,855.57	523,781,937.95
2.基金赎回款	-581,862,189.34	-	13,570,949.57	-568,291,239.77
（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）	2,765,779,947.49	-	-58,527,543.79	2,707,252,403.70
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）	3,399,898,666.31	-	47,958,198.22	3,447,856,864.53
二、本期期初净资产（基金净值）	3,399,898,666.31	-	47,958,198.22	3,447,856,864.53
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-347,393,516.04	-	-286,171,814.00	-633,565,330.04
（一）、综合收益总额	-	-	-322,509,811.34	-322,509,811.34
（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）	-347,393,516.04	-	36,337,997.34	-311,055,518.70
其中：1.基金申购款	276,569,574.05	-	-30,419,774.10	246,149,799.95
2.基金赎回款	-623,963,090.09	-	66,757,771.44	-557,205,318.65
（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）	3,052,505,150.27	-	-238,213,615.78	2,814,291,534.49

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 500 指数智选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]2468 号文《关于准予华夏中证 500 指数智选增强型证

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 500 指数智选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。本基金于 2021 年 8 月 9 日共募集 3,948,146,798.72 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_A119 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华夏中证 500 指数智选增强型证券投资基金基金合同》于 2021 年 8 月 11 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 3,948,151,456.02 份基金份额，其中认购资金利息折合 4,657.30 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，基金托管人为国信证券股份有限公司。

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 500 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。

基金的投资组合比例为：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%-50%，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	152,983,775.30
等于：本金	152,934,133.70
加：应计利息	49,641.60
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	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
合计	152,983,775.30

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	2,563,311,954.75	-	2,546,291,038.57	-17,020,916.18
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	2,563,311,954.75	-	2,546,291,038.57	-17,020,916.18

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	16,544,400.00	-	-	-
其中：股指期货	16,544,400.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	16,544,400.00	-	-	-

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
IC2312	中证 500 期货 IC2312 合约	12	14,218,080.00	118,600.00
IC2309	中证 500 期货 IC2309 合约	2	2,388,000.00	-56,920.00
合计	-	-	-	61,680.00
减:可抵销期货暂收款	-	-	-	61,680.00
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	220.75
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	5,075,274.76
其中：交易所市场	5,075,274.76
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	94,219.55
合计	5,169,715.06

6.4.7.7 实收基金

华夏中证 500 指数智选增强 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	2,348,402,096.87	2,348,402,096.87
本期申购	162,966,255.43	162,966,255.43
本期赎回（以“-”号填列）	-411,371,672.09	-411,371,672.09
本期末	2,099,996,680.21	2,099,996,680.21

华夏中证 500 指数智选增强 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	464,378,246.44	464,378,246.44
本期申购	371,895,538.09	371,895,538.09
本期赎回（以“-”号填列）	-170,490,517.25	-170,490,517.25
本期末	665,783,267.28	665,783,267.28

6.4.7.8 未分配利润

华夏中证 500 指数智选增强 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	-189,596,626.55	-25,572,057.35	-215,168,683.90
本期利润	142,704,808.80	26,467,965.07	169,172,773.87
本期基金份额交易产生的变动数	10,425,289.68	-5,153,128.69	5,272,160.99
其中：基金申购款	-5,013,584.22	1,270,528.80	-3,743,055.42
基金赎回款	15,438,873.90	-6,423,657.49	9,015,216.41
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-36,466,528.07	-4,257,220.97	-40,723,749.04

华夏中证 500 指数智选增强 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	-39,790,798.81	-5,090,844.24	-44,881,643.05
本期利润	32,615,021.47	-2,756,106.18	29,858,915.29
本期基金份额交易产生的变动数	-9,212,828.49	6,431,761.50	-2,781,066.99
其中：基金申购款	-16,365,835.92	9,029,035.77	-7,336,800.15
基金赎回款	7,153,007.43	-2,597,274.27	4,555,733.16
本期已分配利润	-	-	-

本期末	-16,388,605.83	-1,415,188.92	-17,803,794.75
-----	----------------	---------------	----------------

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	910,019.22
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	114,521.87
其他	13,488.08
合计	1,038,029.17

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	6,597,186,581.41
减：卖出股票成本总额	6,433,428,086.17
减：交易费用	11,063,376.83
买卖股票差价收入	152,695,118.41

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	495.07
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	560,168.22
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	560,663.29

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	3,198,924.75

减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	2,638,000.00
减：应计利息总额	628.57
减：交易费用	127.96
买卖债券差价收入	560,168.22

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	-264,019.59

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	34,604,592.76
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	34,604,592.76

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	22,906,198.89
——股票投资	22,906,198.89
——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	805,660.00
——权证投资	-
——期货投资	805,660.00
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	23,711,858.89

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	76,884.99
合计	76,884.99

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	34,712.18
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
其他	-
合计	94,219.55

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
国信证券股份有限公司（“国信证券”）	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
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

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

金额单位：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	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
中信证券	-	-	9,164,565,840.56	53.86%

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：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	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
中信证券	-	-	284,107.33	14.80%

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
中信证券	2,119,712.92	53.86%	1,821,639.40	68.24%

关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
中信证券	2,119,712.92	53.86%	1,821,639.40	68.24%

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

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	10,799,984.15	11,365,816.44
其中：支付销售机构的客户维护费	3,290,133.54	3,557,524.47

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	1,349,998.01	1,420,727.08

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 0.10%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×0.10%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得 销售 服务 费的 各关 联方	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		合计
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
华夏中证 500 指数智选 增强 A	华夏中证 500 指数智选 增强 C		

名称			
华夏基金管理有限公司	-	270,877.70	270,877.70
中信证券	-	197,738.59	197,738.59
国信证券	-	43,550.72	43,550.72
中信证券（华南）	-	9,318.11	9,318.11
中信证券（山东）	-	5,757.75	5,757.75
中信期货	-	3,634.34	3,634.34
华夏财富	-	502.33	502.33
合计	-	531,379.54	531,379.54
获得	上年度可比期间		
销售	2022年1月1日至2022年6月30日		
服务	当期发生的基金应支付的销售服务费		
费的各关联方名称	华夏中证 500 指数智选增强 A	华夏中证 500 指数智选增强 C	合计
中信证券	-	217,586.91	217,586.91
国信证券	-	45,226.22	45,226.22
华夏基金管理有限公司	-	11,705.14	11,705.14
中信	-	11,542.93	11,542.93

证券 (华南)			
中信 证券 (山东)	-	6,049.99	6,049.99
中信 期货	-	4,559.14	4,559.14
华夏 财富	-	672.08	672.08
合计	-	297,342.41	297,342.41

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
国信证券活期存款	152,983,775.30	910,019.22	153,323,342.54	928,169.47

注：本基金的活期银行存款由基金托管人国信证券保管，存放在具有基金托管资格的银行，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	24,961	1,096,287.12
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
国信证券	301488	豪恩汽电	新股发行	2,618	104,144.04
国信证券	301203	国泰环保	新股发行	2,243	103,469.59
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
国信证券	688562	航天软件	新股发行	7,254	91,980.72
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
国信证券	001360	南矿集团	新股发行	1,762	27,099.56
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
国信证券	603073	彩蝶实业	新股发行	530	10,520.50
国信证券	001260	坤泰股份	新股发行	484	6,906.68
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	600938	中国海油	新股发行	120,005	1,296,054.00
中信证券	688223	晶科能源	新股发行	213,000	1,065,000.00

中信证券	688326	经纬恒润	新股发行	6,832	826,672.00
中信证券	301200	大族数控	新股发行	8,566	655,812.96
中信证券	688302	海创药业	新股发行	13,082	561,479.44
中信证券	301109	军信股份	新股发行	12,250	426,422.50
国信证券	688325	赛微微电	新股发行	4,039	301,107.45
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
国信证券	301279	金道科技	新股发行	2,956	92,227.20
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
国信证券	001270	铖昌科技	新股发行	568	12,314.24
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
688506	百利天恒	2022-12-28	6 个月	新发流通受限	24.70	71.38	15,622	385,863.40	1,115,098.36	-
688502	茂莱光	2023-02-28	6 个月	新发流	69.72	178.59	1,509	105,207.48	269,492.31	-

	学			通受限						
301486	致尚科技	2023-06-30	1 个月内(含)	新发流通受限	57.66	57.66	4,338	250,129.08	250,129.08	-
688249	晶合集成	2023-04-24	6 个月	新发流通受限	19.86	18.06	7,405	147,063.30	133,734.30	-
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	-
688472	阿特斯	2023-06-02	6 个月	新发流通受限	11.10	17.04	6,261	69,497.10	106,687.44	-
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	豪恩汽电	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	-
688443	智翔金泰	2023-06-13	6 个月	新发流通受	37.88	29.49	3,033	114,890.04	89,443.17	-

				限						
301358	湖南裕能	2023-02-01	6 个月	新发流通受限	23.77	42.89	2,023	48,086.71	86,766.47	-
688469	中芯集成	2023-04-28	6 个月	新发流通受限	5.69	5.41	13,800	78,522.00	74,658.00	-
301260	格力博	2023-01-20	6 个月	新发流通受限	30.85	23.63	3,121	96,282.85	73,749.23	-
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	恒工精密	2023-06-29	1 个月内(含)	新发流通受限	36.90	36.90	1,775	65,497.50	65,497.50	-
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	2023-03-24	6 个月	新	152.38	135.97	346	52,723.48	47,045.62	-

	联科技			发流通受限						
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	-
688484	南芯科技	2023-03-28	6 个月	新发流通受限	39.99	36.71	1,008	40,309.92	37,003.68	-
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	2023-05-30	6 个月	新发流	135.80	120.41	240	32,592.00	28,898.40	-

	技			通受限						
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	-
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	29.60	71.42	333	9,856.80	23,782.86	-

				限						
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	美利信	2023-04-14	6 个月	新发流通受限	32.34	31.86	687	22,217.58	21,887.82	-
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	2023-05-12	6 个月	新	125.80	118.03	163	20,505.40	19,238.89	-

	杰思			发 流 通 受 限						
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 受 限	46.16	35.72	493	22,756.88	17,609.96	-
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	14.81	13.73	1,122	16,616.82	15,405.06	-

				通受限						
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	-
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	20.92	19.16	721	15,083.32	13,814.36	-

				限						
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	涛涛车业	2023-03-10	6 个月	新发流通受限	73.45	46.64	266	19,537.70	12,406.24	-
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	2023-03-27	6 个月	新	41.20	42.69	262	10,794.40	11,184.78	-

	科磁业			发流通受限						
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	-
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	2023-06-08	6 个月	新发流	72.50	58.42	165	11,962.50	9,639.30	-

	技			通受限						
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	-
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	34.00	34.93	250	8,500.00	8,732.50	-

				限						
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	华塑科技	2023-03-01	6 个月	新发流通受限	56.50	52.93	150	8,475.00	7,939.50	-
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	2023-06-30	6 个月	新	55.00	55.00	140	7,700.00	7,700.00	-

	承科技			发流通受限						
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	-
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	2023-03-29	6 个月	新发流	20.68	25.49	145	2,998.60	3,696.05	-

	腔			通受限						
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	-
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
601298	青岛港	2023-06-28	重大事项	6.97	2023-07-03	7.40	1,229,800	7,184,601.74	8,571,706.00	-

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。

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 500 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	2,546,291,038.57	94.05	2,398,353,919.34	93.95
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	752,518.73	0.03
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	2,546,291,038.57	94.05	2,399,106,438.07	93.98

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 500 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%	-116,359,624.90	-112,308,770.66
	+5%	116,359,624.90	112,308,770.66

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	2,533,716,683.39
第二层次	9,437,140.18
第三层次	3,137,215.00
合计	2,546,291,038.57

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、境内证券涨跌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	2,546,291,038.57	93.47
	其中：股票	2,546,291,038.57	93.47
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	167,936,237.64	6.16
8	其他各项资产	9,948,961.87	0.37
9	合计	2,724,176,238.08	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	21,943,015.00	0.81
B	采矿业	95,705,812.85	3.54
C	制造业	1,270,199,286.22	46.92
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	123,104,102.30	4.55
E	建筑业	27,209,831.66	1.01
F	批发和零售业	44,083,803.00	1.63
G	交通运输、仓储和邮政业	49,777,955.64	1.84
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	116,611,021.64	4.31
J	金融业	252,010,387.45	9.31
K	房地产业	12,337,737.00	0.46
L	租赁和商务服务业	19,733,697.00	0.73
M	科学研究和技术服务业	15,858,890.00	0.59
N	水利、环境和公共设施管理业	9,229,443.00	0.34
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	26,540,883.10	0.98
S	综合	4,172,599.00	0.15
	合计	2,088,518,464.86	77.15

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	347,773,928.56	12.85
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	35,447.47	0.00
E	建筑业	4,953,688.64	0.18
F	批发和零售业	2,945,047.92	0.11
G	交通运输、仓储和邮政业	19,282,767.00	0.71
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	24,422,231.69	0.90
J	金融业	6,200,419.00	0.23
K	房地产业	8,822,952.71	0.33
L	租赁和商务服务业	7,861,962.29	0.29
M	科学研究和技术服务业	21,201,971.00	0.78
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	14,225,808.00	0.53
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	457,772,573.71	16.91

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	300003	乐普医疗	1,174,900	26,564,489.00	0.98
2	002966	苏州银行	3,974,250	26,031,337.50	0.96
3	600161	天坛生物	886,592	24,070,972.80	0.89
4	601077	渝农商行	6,673,000	23,956,070.00	0.88
5	002273	水晶光电	1,972,092	23,546,778.48	0.87
6	002028	思源电气	498,566	23,293,003.52	0.86
7	002203	海亮股份	1,926,743	23,140,183.43	0.85
8	688009	中国通号	3,979,700	23,082,260.00	0.85
9	000997	新大陆	1,208,888	22,847,983.20	0.84
10	000623	吉林敖东	1,419,894	22,775,099.76	0.84
11	002595	豪迈科技	648,100	22,767,753.00	0.84
12	600879	航天电子	2,620,800	22,250,592.00	0.82
13	000060	中金岭南	4,670,050	22,182,737.50	0.82

14	002152	广电运通	1,877,564	22,005,050.08	0.81
15	601577	长沙银行	2,824,455	21,917,770.80	0.81
16	600380	健康元	1,718,544	21,842,694.24	0.81
17	600582	天地科技	3,732,279	21,759,186.57	0.80
18	300136	信维通信	1,078,565	21,657,585.20	0.80
19	002249	大洋电机	3,773,830	21,510,831.00	0.79
20	600511	国药股份	548,600	21,313,110.00	0.79
21	000598	兴蓉环境	3,887,430	21,108,744.90	0.78
22	601717	郑煤机	1,693,200	21,080,340.00	0.78
23	603444	吉比特	42,800	21,019,508.00	0.78
24	002745	木林森	2,274,500	20,925,400.00	0.77
25	600967	内蒙一机	2,071,264	20,919,766.40	0.77
26	002690	美亚光电	812,105	20,911,703.75	0.77
27	600060	海信视像	834,323	20,649,494.25	0.76
28	600909	华安证券	4,348,600	20,307,962.00	0.75
29	000559	万向钱潮	3,683,384	20,074,442.80	0.74
30	002563	森马服饰	3,206,600	19,945,052.00	0.74
31	688819	天能股份	540,264	19,903,325.76	0.74
32	600167	联美控股	2,855,400	19,902,138.00	0.74
33	002500	山西证券	3,551,230	19,815,863.40	0.73
34	002465	海格通信	1,912,141	19,771,537.94	0.73
35	002250	联化科技	1,881,726	19,682,853.96	0.73
36	002128	电投能源	1,483,701	19,614,527.22	0.72
37	600968	海油发展	6,349,333	19,492,452.31	0.72
38	000785	居然之家	5,114,100	19,484,721.00	0.72
39	002138	顺络电子	807,600	19,309,716.00	0.71
40	600498	烽火通信	940,900	19,166,133.00	0.71
41	000027	深圳能源	2,887,040	19,025,593.60	0.70
42	002511	中顺洁柔	1,704,700	19,007,405.00	0.70
43	300146	汤臣倍健	783,400	18,785,932.00	0.69
44	000869	张裕 A	604,961	18,548,104.26	0.69
45	000987	越秀资本	2,915,005	18,510,281.75	0.68
46	600580	卧龙电驱	1,260,693	18,418,724.73	0.68
47	000513	丽珠集团	467,302	18,182,720.82	0.67
48	600315	上海家化	624,001	18,102,269.01	0.67
49	600377	宁沪高速	1,817,300	17,864,059.00	0.66
50	000783	长江证券	3,053,889	17,712,556.20	0.65
51	600398	海澜之家	2,522,500	17,354,800.00	0.64
52	002683	广东宏大	582,153	17,138,584.32	0.63
53	601158	重庆水务	3,032,680	16,861,700.80	0.62
54	300296	利亚德	2,465,300	16,098,409.00	0.59
55	600497	驰宏锌锗	3,199,100	16,059,482.00	0.59
56	600271	航天信息	1,117,200	15,294,468.00	0.56

57	600623	华谊集团	2,450,808	15,268,533.84	0.56
58	000089	深圳机场	2,130,600	14,807,670.00	0.55
59	601555	东吴证券	2,095,775	14,544,678.50	0.54
60	002600	领益智造	2,031,500	14,037,665.00	0.52
61	300012	华测检测	704,000	13,728,000.00	0.51
62	603355	莱克电气	538,666	13,687,503.06	0.51
63	600166	福田汽车	3,956,500	13,452,100.00	0.50
64	600170	上海建工	4,933,914	13,272,228.66	0.49
65	002065	东华软件	1,874,800	13,236,088.00	0.49
66	002925	盈趣科技	653,812	12,683,952.80	0.47
67	600131	国网信通	624,500	12,608,655.00	0.47
68	600517	国网英大	2,203,300	12,558,810.00	0.46
69	300866	安克创新	139,900	12,241,250.00	0.45
70	688777	中控技术	192,198	12,066,190.44	0.45
71	002078	太阳纸业	1,122,506	11,999,589.14	0.44
72	000932	华菱钢铁	2,422,400	11,554,848.00	0.43
73	688002	睿创微纳	254,200	11,388,160.00	0.42
74	002739	万达电影	904,365	11,340,737.10	0.42
75	002092	中泰化学	1,755,700	11,324,265.00	0.42
76	002131	利欧股份	4,919,000	11,313,700.00	0.42
77	600820	隧道股份	1,879,400	11,295,194.00	0.42
78	002299	圣农发展	578,300	11,074,445.00	0.41
79	600755	厦门国贸	1,429,300	11,062,782.00	0.41
80	603317	天味食品	755,472	11,037,445.92	0.41
81	000629	钒钛股份	2,818,600	11,020,726.00	0.41
82	300009	安科生物	1,095,980	10,959,800.00	0.40
83	002019	亿帆医药	742,900	10,846,340.00	0.40
84	600008	首创环保	3,763,600	10,839,168.00	0.40
85	600329	达仁堂	241,142	10,824,864.38	0.40
86	002508	老板电器	426,810	10,794,024.90	0.40
87	688072	拓荆科技	25,300	10,777,041.00	0.40
88	000883	湖北能源	2,290,800	10,446,048.00	0.39
89	002372	伟星新材	504,289	10,358,096.06	0.38
90	000738	航发控制	423,000	10,321,200.00	0.38
91	600566	济川药业	355,108	10,312,336.32	0.38
92	600642	申能股份	1,474,100	10,303,959.00	0.38
93	301029	怡合达	229,840	10,269,251.20	0.38
94	600177	雅戈尔	1,546,700	9,759,677.00	0.36
95	600873	梅花生物	1,069,800	9,553,314.00	0.35
96	601869	长飞光纤	257,300	9,522,673.00	0.35
97	000728	国元证券	1,455,971	9,492,930.92	0.35
98	000031	大悦城	2,547,200	9,322,752.00	0.34
99	002926	华西证券	1,108,200	9,209,142.00	0.34

100	002867	周大生	517,087	9,193,806.86	0.34
101	601139	深圳燃气	1,242,500	9,057,825.00	0.33
102	002797	第一创业	1,559,900	8,922,628.00	0.33
103	601966	玲珑轮胎	396,800	8,816,896.00	0.33
104	601298	青岛港	1,229,800	8,571,706.00	0.32
105	600598	北大荒	638,600	8,512,538.00	0.31
106	000729	燕京啤酒	682,305	8,508,343.35	0.31
107	300832	新产业	142,510	8,408,090.00	0.31
108	601098	中南传媒	720,005	8,352,058.00	0.31
109	300418	昆仑万维	205,400	8,273,512.00	0.31
110	600435	北方导航	712,900	8,191,221.00	0.30
111	300357	我武生物	242,690	8,161,664.70	0.30
112	600782	新钢股份	2,007,800	7,448,938.00	0.28
113	000709	河钢股份	3,173,300	7,171,658.00	0.26
114	002223	鱼跃医疗	197,000	7,090,030.00	0.26
115	000553	安道麦 A	832,244	7,024,139.36	0.26
116	600885	宏发股份	215,120	6,851,572.00	0.25
117	000807	云铝股份	537,100	6,837,283.00	0.25
118	002936	郑州银行	2,943,500	6,770,050.00	0.25
119	600901	江苏金租	1,632,788	6,743,414.44	0.25
120	603156	养元饮品	262,164	6,475,450.80	0.24
121	000967	盈峰环境	1,257,100	6,348,355.00	0.23
122	002653	海思科	260,942	6,158,231.20	0.23
123	000423	东阿阿胶	113,900	6,087,955.00	0.22
124	601997	贵阳银行	1,153,700	5,953,092.00	0.22
125	000878	云南铜业	534,800	5,909,540.00	0.22
126	000750	国海证券	1,727,500	5,787,125.00	0.21
127	600718	东软集团	542,500	5,783,050.00	0.21
128	000933	神火股份	430,200	5,592,600.00	0.21
129	600863	内蒙华电	1,339,500	5,558,925.00	0.21
130	002572	索菲亚	318,991	5,556,823.22	0.21
131	002353	杰瑞股份	219,100	5,505,983.00	0.20
132	688390	固德威	32,900	5,489,694.00	0.20
133	000975	银泰黄金	459,240	5,373,108.00	0.20
134	603786	科博达	79,400	5,216,580.00	0.19
135	601187	厦门银行	980,900	4,924,118.00	0.18
136	000830	鲁西化工	458,700	4,843,872.00	0.18
137	600143	金发科技	550,200	4,803,246.00	0.18
138	601000	唐山港	1,359,552	4,799,218.56	0.18
139	600597	光明乳业	460,200	4,786,080.00	0.18
140	601718	际华集团	1,603,600	4,762,692.00	0.18
141	000050	深天马 A	513,100	4,710,258.00	0.17
142	601958	金钼股份	382,700	4,267,105.00	0.16

143	600827	百联股份	318,900	4,263,693.00	0.16
144	002294	信立泰	136,400	4,254,316.00	0.16
145	600985	淮北矿业	365,400	4,209,408.00	0.16
146	002195	二三四五	1,448,300	4,185,587.00	0.15
147	000009	中国宝安	345,700	4,172,599.00	0.15
148	600489	中金黄金	396,200	4,092,746.00	0.15
149	600928	西安银行	1,064,200	3,745,984.00	0.14
150	002791	坚朗五金	57,500	3,720,825.00	0.14
151	603228	景旺电子	142,850	3,664,102.50	0.14
152	300699	光威复材	117,700	3,631,045.00	0.13
153	600066	宇通客车	246,200	3,628,988.00	0.13
154	002444	巨星科技	165,400	3,618,952.00	0.13
155	601198	东兴证券	448,900	3,600,178.00	0.13
156	000778	新兴铸管	879,600	3,588,768.00	0.13
157	601108	财通证券	486,500	3,522,260.00	0.13
158	601928	凤凰传媒	305,800	3,486,120.00	0.13
159	600373	中文传媒	252,400	3,361,968.00	0.12
160	000630	铜陵有色	1,158,100	3,346,909.00	0.12
161	600637	东方明珠	416,000	3,253,120.00	0.12
162	603737	三棵树	47,320	3,095,674.40	0.11
163	601665	齐鲁银行	781,386	3,063,033.12	0.11
164	600704	物产中大	618,700	3,056,378.00	0.11
165	002531	天顺风能	198,500	3,023,155.00	0.11
166	600848	上海临港	252,300	3,014,985.00	0.11
167	000898	鞍钢股份	1,049,900	2,918,722.00	0.11
168	002266	浙富控股	697,600	2,881,088.00	0.11
169	002110	三钢闽光	665,796	2,809,659.12	0.10
170	000959	首钢股份	770,200	2,695,700.00	0.10
171	688185	康希诺	32,800	2,673,200.00	0.10
172	002673	西部证券	417,300	2,649,855.00	0.10
173	002081	金螳螂	585,900	2,642,409.00	0.10
174	603589	口子窖	53,400	2,635,290.00	0.10
175	600378	昊华科技	65,900	2,480,476.00	0.09
176	601636	旗滨集团	286,900	2,473,078.00	0.09
177	000937	冀中能源	385,700	2,460,766.00	0.09
178	002155	湖南黄金	195,600	2,386,320.00	0.09
179	601118	海南橡胶	525,900	2,356,032.00	0.09
180	600153	建发股份	214,100	2,335,831.00	0.09
181	603529	爱玛科技	71,200	2,294,064.00	0.08
182	000581	威孚高科	144,200	2,271,150.00	0.08
183	603127	昭衍新药	52,100	2,130,890.00	0.08
184	600399	抚顺特钢	205,800	2,099,160.00	0.08
185	600535	天士力	141,000	2,045,910.00	0.08

186	002156	通富微电	88,900	2,009,140.00	0.07
187	001872	招商港口	115,304	1,991,300.08	0.07
188	603858	步长制药	93,200	1,918,988.00	0.07
189	601231	环旭电子	124,300	1,859,528.00	0.07
190	000887	中鼎股份	141,000	1,845,690.00	0.07
191	000739	普洛药业	103,700	1,839,638.00	0.07
192	603056	德邦股份	113,100	1,744,002.00	0.06
193	600549	厦门钨业	85,800	1,632,774.00	0.06
194	002221	东华能源	187,300	1,620,145.00	0.06
195	688208	道通科技	49,500	1,500,345.00	0.06
196	002056	横店东磁	82,100	1,495,041.00	0.06
197	603658	安图生物	25,151	1,301,061.23	0.05
198	300682	朗新科技	54,200	1,261,776.00	0.05
199	600038	中直股份	24,900	991,518.00	0.04
200	000636	风华高科	62,700	961,818.00	0.04
201	600927	永安期货	58,757	955,388.82	0.04
202	600409	三友化工	172,900	942,305.00	0.03
203	600959	江苏有线	225,400	761,852.00	0.03
204	601128	常熟银行	102,200	697,004.00	0.03
205	600339	中油工程	150,200	611,314.00	0.02
206	603939	益丰药房	11,672	431,864.00	0.02
207	600109	国金证券	42,400	367,608.00	0.01
208	603868	飞科电器	4,300	271,287.00	0.01
209	600390	五矿资本	46,700	251,246.00	0.01
210	002010	传化智联	46,800	248,976.00	0.01
211	002507	涪陵榨菜	9,360	171,381.60	0.01
212	603638	艾迪精密	7,400	151,848.00	0.01
213	002568	百润股份	2,800	101,780.00	0.00
214	000401	冀东水泥	4,000	29,480.00	0.00
215	300285	国瓷材料	1,000	27,400.00	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	300749	顶固集创	1,824,540.00	16,767,522.60	0.62
2	603551	奥普家居	1,245,700.00	16,106,901.00	0.59
3	688013	天臣医疗	458,107.00	10,861,716.97	0.40
4	002879	长缆科技	626,420.00	10,317,137.40	0.38
5	002774	快意电梯	1,287,900.00	10,238,805.00	0.38
6	688560	明冠新材	335,400.00	9,320,766.00	0.34
7	000063	中兴通讯	203,600.00	9,271,944.00	0.34
8	688210	统联精密	462,700.00	9,031,904.00	0.33

9	603488	展鹏科技	1,111,100.00	8,922,133.00	0.33
10	301028	东亚机械	799,800.00	8,917,770.00	0.33
11	300767	震安科技	351,600.00	8,916,576.00	0.33
12	000608	阳光股份	3,243,401.00	8,789,616.71	0.32
13	603421	鼎信通讯	827,589.00	8,648,305.05	0.32
14	300384	三联虹普	497,600.00	8,454,224.00	0.31
15	301182	凯旺科技	365,600.00	8,397,832.00	0.31
16	002855	捷荣技术	794,300.00	8,332,207.00	0.31
17	600826	兰生股份	765,527.00	7,861,962.29	0.29
18	605098	行动教育	189,400.00	7,498,346.00	0.28
19	002381	双箭股份	967,500.00	7,469,100.00	0.28
20	688395	正弦电气	278,200.00	7,397,338.00	0.27
21	600362	江西铜业	376,500.00	7,145,970.00	0.26
22	300462	华铭智能	602,700.00	7,075,698.00	0.26
23	688616	西力科技	534,232.00	7,067,889.36	0.26
24	600897	厦门空港	333,900.00	6,908,391.00	0.26
25	300371	汇中股份	517,260.00	6,776,106.00	0.25
26	300515	三德科技	404,700.00	6,523,764.00	0.24
27	600662	外服控股	1,073,200.00	6,138,704.00	0.23
28	603040	新坐标	228,700.00	6,081,133.00	0.22
29	688215	瑞晟智能	152,917.00	6,031,046.48	0.22
30	601336	新华保险	154,700.00	5,688,319.00	0.21
31	605167	利柏特	539,300.00	5,220,424.00	0.19
32	002611	东方精工	903,800.00	5,187,812.00	0.19
33	603499	翔港科技	537,400.00	5,126,796.00	0.19
34	603839	安正时尚	679,900.00	5,112,848.00	0.19
35	301076	新瀚新材	257,155.00	5,045,381.10	0.19
36	002376	新北洋	610,400.00	4,925,928.00	0.18
37	002830	名雕股份	364,800.00	4,673,088.00	0.17
38	000980	众泰汽车	1,859,600.00	4,574,616.00	0.17
39	002763	汇洁股份	512,900.00	4,544,294.00	0.17
40	688681	科汇股份	275,800.00	4,456,928.00	0.16
41	603320	迪贝电气	306,100.00	4,450,694.00	0.16
42	603377	东方时尚	553,100.00	4,446,924.00	0.16
43	603808	歌力思	331,600.00	4,353,908.00	0.16
44	002732	燕塘乳业	200,900.00	4,343,458.00	0.16
45	300074	华平股份	957,200.00	4,125,532.00	0.15
46	000811	冰轮环境	253,500.00	3,995,160.00	0.15
47	688073	毕得医药	56,300.00	3,984,914.00	0.15
48	688619	罗普特	256,900.00	3,861,207.00	0.14
49	688360	德马科技	169,600.00	3,763,424.00	0.14
50	603226	菲林格尔	716,898.00	3,656,179.80	0.14
51	603508	思维列控	210,080.00	3,581,864.00	0.13

52	603321	梅轮电梯	457,700.00	3,565,483.00	0.13
53	003008	开普检测	123,300.00	3,542,409.00	0.13
54	603758	秦安股份	295,300.00	3,141,992.00	0.12
55	603556	海兴电力	115,970.00	2,927,082.80	0.11
56	600628	新世界	402,000.00	2,906,460.00	0.11
57	300976	达瑞电子	51,700.00	2,621,190.00	0.10
58	605288	凯迪股份	60,900.00	2,621,136.00	0.10
59	002516	旷达科技	528,600.00	2,558,424.00	0.09
60	002928	华夏航空	295,800.00	2,499,510.00	0.09
61	002322	理工能科	231,600.00	2,408,640.00	0.09
62	605066	天正电气	255,500.00	2,404,255.00	0.09
63	688078	龙软科技	45,700.00	2,355,835.00	0.09
64	688519	南亚新材	97,826.00	2,350,758.78	0.09
65	002659	凯文教育	477,100.00	2,280,538.00	0.08
66	603871	嘉友国际	142,200.00	2,233,962.00	0.08
67	000030	富奥股份	443,200.00	2,233,728.00	0.08
68	603709	中源家居	123,000.00	2,231,220.00	0.08
69	002749	国光股份	189,500.00	2,147,035.00	0.08
70	688125	安达智能	39,500.00	2,146,825.00	0.08
71	603855	华荣股份	80,200.00	2,133,320.00	0.08
72	003006	百亚股份	117,100.00	2,023,488.00	0.07
73	003003	天元股份	190,800.00	2,018,664.00	0.07
74	000020	深华发 A	173,600.00	2,008,552.00	0.07
75	000528	柳工	240,600.00	1,900,740.00	0.07
76	688267	中触媒	89,800.00	1,892,086.00	0.07
77	301106	骏成科技	51,500.00	1,834,430.00	0.07
78	688718	唯赛勃	103,600.00	1,793,316.00	0.07
79	002345	潮宏基	221,500.00	1,740,990.00	0.06
80	688618	三旺通信	25,308.00	1,713,857.76	0.06
81	603535	嘉诚国际	92,500.00	1,502,200.00	0.06
82	300329	海伦钢琴	209,700.00	1,482,579.00	0.05
83	688288	鸿泉物联	58,151.00	1,478,198.42	0.05
84	603515	欧普照明	68,000.00	1,380,400.00	0.05
85	301005	超捷股份	45,000.00	1,287,000.00	0.05
86	603861	白云电器	130,400.00	1,251,840.00	0.05
87	603657	春光科技	69,900.00	1,226,745.00	0.05
88	601686	友发集团	174,900.00	1,196,316.00	0.04
89	301004	嘉益股份	29,500.00	1,144,600.00	0.04
90	688506	百利天恒	15,622.00	1,115,098.36	0.04
91	688096	京源环保	111,120.00	1,093,420.80	0.04
92	002990	盛视科技	29,200.00	1,074,560.00	0.04
93	603283	赛腾股份	24,100.00	1,072,450.00	0.04
94	688211	中科微至	23,300.00	1,052,461.00	0.04

95	688670	金迪克	21,800.00	1,026,344.00	0.04
96	688038	中科通达	67,900.00	1,015,784.00	0.04
97	603725	天安新材	123,200.00	1,001,616.00	0.04
98	300667	必创科技	50,000.00	984,500.00	0.04
99	300865	大宏立	42,300.00	914,526.00	0.03
100	002397	梦洁股份	262,200.00	909,834.00	0.03
101	600261	阳光照明	246,900.00	901,185.00	0.03
102	603511	爱慕股份	50,600.00	870,320.00	0.03
103	301011	华立科技	37,020.00	867,378.60	0.03
104	600845	宝信软件	16,220.00	824,138.20	0.03
105	001209	洪兴股份	42,300.00	753,363.00	0.03
106	300719	安达维尔	50,100.00	707,412.00	0.03
107	300445	康斯特	44,400.00	703,740.00	0.03
108	002937	兴瑞科技	27,100.00	666,660.00	0.02
109	688080	映翰通	12,520.00	612,228.00	0.02
110	002448	中原内配	85,600.00	599,200.00	0.02
111	688696	极米科技	4,000.00	557,560.00	0.02
112	000725	京东方 A	132,300.00	541,107.00	0.02
113	601328	交通银行	85,100.00	493,580.00	0.02
114	603326	我乐家居	51,500.00	402,215.00	0.01
115	301291	明阳电气	12,054.00	391,066.98	0.01
116	603587	地素时尚	22,900.00	335,256.00	0.01
117	300433	蓝思科技	27,800.00	326,928.00	0.01
118	300697	电工合金	26,700.00	319,866.00	0.01
119	688100	威胜信息	10,600.00	315,986.00	0.01
120	301486	致尚科技	4,820.00	277,921.20	0.01
121	000010	美丽生态	119,500.00	272,460.00	0.01
122	688502	茂莱光学	1,509.00	269,492.31	0.01
123	300717	华信新材	14,800.00	252,340.00	0.01
124	300314	戴维医疗	9,900.00	209,286.00	0.01
125	603615	茶花股份	21,700.00	204,848.00	0.01
126	000698	沈阳化工	48,400.00	198,924.00	0.01
127	301397	溯联股份	3,618.00	152,606.80	0.01
128	301210	金杨股份	2,801.00	143,168.37	0.01
129	301395	仁信新材	5,196.00	138,629.28	0.01
130	688249	晶合集成	7,405.00	133,734.30	0.00
131	301292	海科新源	5,824.00	116,421.76	0.00
132	688472	阿特斯	6,261.00	106,687.44	0.00
133	301488	豪恩汽电	2,618.00	104,144.04	0.00
134	603628	清源股份	6,400.00	101,312.00	0.00
135	688443	智翔金泰	3,033.00	89,443.17	0.00
136	603059	倍加洁	3,900.00	88,686.00	0.00
137	301358	湖南裕能	2,023.00	86,766.47	0.00

138	301202	朗威股份	3,060.00	79,009.20	0.00
139	300804	广康生化	2,257.00	77,134.83	0.00
140	688603	天承科技	1,391.00	76,505.00	0.00
141	688469	中芯集成	13,800.00	74,658.00	0.00
142	301260	格力博	3,121.00	73,749.23	0.00
143	301261	恒工精密	1,973.00	72,803.70	0.00
144	603701	德宏股份	4,300.00	61,017.00	0.00
145	688361	中科飞测	831.00	53,740.77	0.00
146	688531	日联科技	346.00	47,045.62	0.00
147	301325	曼恩斯特	364.00	39,293.80	0.00
148	688146	中船特气	1,011.00	38,549.43	0.00
149	002014	永新股份	4,400.00	38,192.00	0.00
150	688484	南芯科技	1,008.00	37,003.68	0.00
151	001286	陕西能源	3,767.00	35,447.47	0.00
152	600007	中国国贸	1,800.00	33,336.00	0.00
153	603766	隆鑫通用	6,200.00	32,736.00	0.00
154	001287	中电港	1,386.00	29,133.72	0.00
155	688576	西山科技	240.00	28,898.40	0.00
156	301246	宏源药业	931.00	28,591.01	0.00
157	688352	颀中科技	2,361.00	28,497.27	0.00
158	688507	索辰科技	222.00	27,108.42	0.00
159	301310	鑫宏业	409.00	26,760.87	0.00
160	688582	芯动联科	648.00	26,360.64	0.00
161	603416	信捷电气	600.00	24,786.00	0.00
162	301293	三博脑科	333.00	23,782.86	0.00
163	301303	真兰仪表	1,058.00	23,614.56	0.00
164	603878	武进不锈	2,700.00	22,815.00	0.00
165	688552	航天南湖	956.00	22,466.00	0.00
166	688570	天玛智控	884.00	22,391.72	0.00
167	301307	美利信	687.00	21,887.82	0.00
168	688543	国科军工	410.00	21,750.50	0.00
169	301322	绿通科技	391.00	20,816.84	0.00
170	688458	美芯晟	221.00	20,057.96	0.00
171	688581	安杰思	163.00	19,238.89	0.00
172	601169	北京银行	4,000.00	18,520.00	0.00
173	301317	鑫磊股份	694.00	18,161.98	0.00
174	301262	海看股份	692.00	17,646.00	0.00
175	301383	天键股份	493.00	17,609.96	0.00
176	688562	航天软件	726.00	16,197.06	0.00
177	301439	泓淋电力	949.00	16,038.10	0.00
178	688623	双元科技	178.00	15,448.62	0.00
179	301332	德尔玛	1,122.00	15,405.06	0.00
180	301399	英特科技	293.00	15,110.01	0.00

181	301305	朗坤环境	753.00	14,826.57	0.00
182	301387	光大同创	307.00	13,925.52	0.00
183	688512	慧智微	721.00	13,814.36	0.00
184	301382	蜂助手	408.00	13,398.72	0.00
185	688433	华曙高科	418.00	13,167.00	0.00
186	301360	荣旗科技	134.00	12,408.40	0.00
187	301345	涛涛车业	266.00	12,406.24	0.00
188	688523	航天环宇	472.00	11,257.20	0.00
189	603135	中重科技	628.00	11,234.92	0.00
190	301141	中科磁业	262.00	11,184.78	0.00
191	301225	恒勃股份	333.00	11,075.58	0.00
192	301429	森泰股份	499.00	10,488.98	0.00
193	601065	江盐集团	875.00	10,360.00	0.00
194	688631	莱斯信息	336.00	10,036.32	0.00
195	688479	友车科技	332.00	9,790.68	0.00
196	301232	飞沃科技	165.00	9,639.30	0.00
197	301376	致欧科技	420.00	9,454.20	0.00
198	301355	南王科技	563.00	9,430.25	0.00
199	301357	北方长龙	190.00	9,194.10	0.00
200	301386	未来电器	378.00	8,992.62	0.00
201	301323	新莱福	228.00	8,974.08	0.00
202	688429	时创能源	346.00	8,833.38	0.00
203	301170	锡南科技	250.00	8,732.50	0.00
204	301281	科源制药	337.00	8,458.70	0.00
205	688535	华海诚科	161.00	8,248.03	0.00
206	601133	柏诚股份	664.00	8,140.64	0.00
207	301157	华塑科技	150.00	7,939.50	0.00
208	301295	美硕科技	215.00	7,755.05	0.00
209	301203	国泰环保	225.00	7,740.00	0.00
210	301337	亚华电子	232.00	7,045.84	0.00
211	301428	世纪恒通	229.00	7,007.40	0.00
212	001380	华纬科技	170.00	5,232.60	0.00
213	603125	常青科技	160.00	3,924.80	0.00
214	001328	登康口腔	145.00	3,696.05	0.00
215	001282	三联锻造	105.00	3,468.15	0.00
216	001360	南矿集团	177.00	2,631.99	0.00
217	001324	长青科技	114.00	2,234.40	0.00
218	001367	海森药业	55.00	2,171.40	0.00
219	603172	万丰股份	122.00	1,967.86	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	601077	渝农商行	45,585,691.00	1.79
2	603444	吉比特	40,888,755.72	1.60
3	002595	豪迈科技	39,222,508.00	1.54
4	002690	美亚光电	37,693,841.98	1.48
5	688063	派能科技	37,539,912.44	1.47
6	688009	中国通号	37,157,264.76	1.46
7	000785	居然之家	36,725,736.00	1.44
8	600131	国网信通	36,717,944.00	1.44
9	600582	天地科技	36,586,612.00	1.43
10	600879	航天电子	36,126,926.00	1.42
11	600167	联美控股	35,459,809.00	1.39
12	601577	长沙银行	34,779,100.85	1.36
13	000559	万向钱潮	33,829,092.00	1.33
14	688390	固德威	33,285,012.14	1.30
15	603605	珀莱雅	32,741,485.08	1.28
16	002065	东华软件	32,219,162.00	1.26
17	002925	盈趣科技	31,848,863.61	1.25
18	600398	海澜之家	31,504,782.00	1.23
19	002019	亿帆医药	30,978,725.00	1.21
20	300003	乐普医疗	30,854,696.87	1.21

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	688390	固德威	57,344,245.19	2.25
2	688063	派能科技	54,515,421.67	2.14
3	002422	科伦药业	45,592,097.00	1.79
4	601128	常熟银行	44,783,322.00	1.75
5	600398	海澜之家	43,263,100.00	1.69
6	603605	珀莱雅	42,526,997.40	1.67
7	601098	中南传媒	39,503,751.20	1.55
8	002384	东山精密	39,406,551.51	1.54
9	688655	迅捷兴	39,380,363.13	1.54
10	600998	九州通	38,852,097.00	1.52
11	600060	海信视像	38,158,443.13	1.49
12	601577	长沙银行	37,192,650.00	1.46
13	300017	网宿科技	36,410,997.12	1.43
14	002372	伟星新材	34,980,211.82	1.37
15	000563	陕国投 A	34,831,179.00	1.36

16	688777	中控技术	34,543,343.29	1.35
17	600160	巨化股份	33,376,396.70	1.31
18	603225	新凤鸣	32,291,247.88	1.26
19	603228	景旺电子	32,093,544.20	1.26
20	688116	天奈科技	31,929,316.49	1.25

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	6,558,459,006.51
卖出股票收入（成交）总额	6,597,186,581.41

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	3,719,090.94
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	6,229,870.93
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,948,961.87

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

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。

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	持有份额	占总份	

				额比例		额比例
华夏中证 500 指数智选增强 A	48,510	43,289.97	56,875,700.15	2.71%	2,043,120,980.06	97.29%
华夏中证 500 指数智选增强 C	11,344	58,690.34	225,878,169.60	33.93%	439,905,097.68	66.07%
合计	59,854	46,208.77	282,753,869.75	10.22%	2,483,026,077.74	89.78%

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 500 指数智选增强 A	344,545.35	0.02%
	华夏中证 500 指数智选增强 C	57,148.75	0.01%
	合计	401,694.10	0.01%

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、基金投资和相关部门负责人持有本开放式基金	华夏中证 500 指数智选增强 A	0
	华夏中证 500 指数智选增强 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	华夏中证 500 指数智选增强 A	0
	华夏中证 500 指数智选增强 C	0
	合计	0

§9 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
基金合同生效日（2021 年 8 月 11 日）基金份额总额	3,428,954,171.77	519,197,284.25
本报告期期初基金份额总额	2,348,402,096.87	464,378,246.44
本报告期基金总申购份额	162,966,255.43	371,895,538.09

减：本报告期基金总赎回份额	411,371,672.09	170,490,517.25
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	2,099,996,680.21	665,783,267.28

§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、公募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未受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	
国泰君安证券	2	7,723,440,302.66	58.80%	1,786,368.13	52.11%	-
财通证券	1	2,653,375,421.29	20.20%	1,003,820.38	29.28%	-

广发证券	2	2,322,968,702.00	17.69%	537,288.56	15.67%	-
申万宏源证券	1	435,102,245.07	3.31%	100,642.32	2.94%	-

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，本基金还选择了华泰证券、平安证券、中信证券的交易单元作为本基金交易单元，本报告期无股票交易及应付佣金。

④在上述租用的券商交易单元中，广发证券的部分交易单元为本基金本期新增的交易单元。本期没有剔除的券商交易单元。

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
国泰君安证券	2,928,900.68	91.56%	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	270,024.07	8.44%	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-	-	-

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	2023-02-04
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	2023-02-11
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	2023-02-18
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	2023-02-24
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	2023-03-03
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	2023-03-11
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	2023-03-16
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	2023-03-23
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	2023-03-30
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	2023-03-31
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	2023-04-01
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	2023-04-13
15	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
16	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
17	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
18	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	2023-05-17
19	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
20	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

21	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	2023-06-28
----	------------------------------	--------------	------------

§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

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。

§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 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。

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