

# 华夏中证 800 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：上海银行股份有限公司

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。

基金托管人上海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 3 月 30 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）.....	12
6.1 资产负债表.....	12
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.....	40
7.1 期末基金资产组合情况.....	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	41
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.....	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	70
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	71
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.....	71
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.....	72
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.....	72
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.....	72
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	72
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	72
7.12 投资组合报告附注.....	72
§8 基金份额持有人信息.....	73
§9 开放式基金份额变动.....	74
§10 重大事件揭示.....	74
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	76
§12 备查文件目录.....	76

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华夏中证 800 指数增强型证券投资基金	
基金简称	华夏中证 800 指数增强	
基金主代码	017985	
交易代码	017985	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2023 年 3 月 30 日	
基金管理人	华夏基金管理有限公司	
基金托管人	上海银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	208,082,269.64 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 800 指数增强 A	华夏中证 800 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	017985	017986
报告期末下属分级基金的份额总额	88,510,776.87 份	119,571,492.77 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 800 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	上海银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李彬	周直毅
	联系电话	400-818-6666	021-68475608
	电子邮箱	service@ChinaAMC.com	custody@boscn.cn
客户服务电话		400-818-6666	95594
传真		010-63136700	021-68476901

注册地址	北京市顺义区安庆大街甲3号院	中国（上海）自由贸易试验区银城中路168号
办公地址	北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座8层	中国（上海）自由贸易试验区银城中路168号27层
邮政编码	100033	200120
法定代表人	杨明辉	金煜

### 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 3 月 30 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日）	
	华夏中证 800 指数增强 A	华夏中证 800 指数增强 C
本期已实现收益	-3,562,267.95	-5,158,566.88
本期利润	-5,089,298.49	-7,277,625.19
加权平均基金份额本期利润	-0.0518	-0.0525
本期加权平均净值利润率	-5.37%	-5.45%
本期基金份额净值增长率	-5.20%	-5.30%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)	
	华夏中证 800 指数增强 A	华夏中证 800 指数增强 C
期末可供分配利润	-4,606,024.10	-6,336,256.59
期末可供分配基金份额利润	-0.0520	-0.0530
期末基金资产净值	83,904,752.77	113,235,236.18
期末基金份额净值	0.9480	0.9470
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)	

	华夏中证 800 指数增强 A	华夏中证 800 指数增强 C
基金份额累计净值增长率	-5.20%	-5.30%

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。

④本基金合同于 2023 年 3 月 30 日生效。

### 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 800 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	1.50%	0.76%	0.61%	0.82%	0.89%	-0.06%
过去三个月	-5.20%	0.70%	-4.94%	0.76%	-0.26%	-0.06%
自基金合同生效起至今	-5.20%	0.69%	-3.90%	0.76%	-1.30%	-0.07%

##### 华夏中证 800 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	1.47%	0.75%	0.61%	0.82%	0.86%	-0.07%
过去三个月	-5.30%	0.70%	-4.94%	0.76%	-0.36%	-0.06%
自基金合同生效起至今	-5.30%	0.69%	-3.90%	0.76%	-1.40%	-0.07%

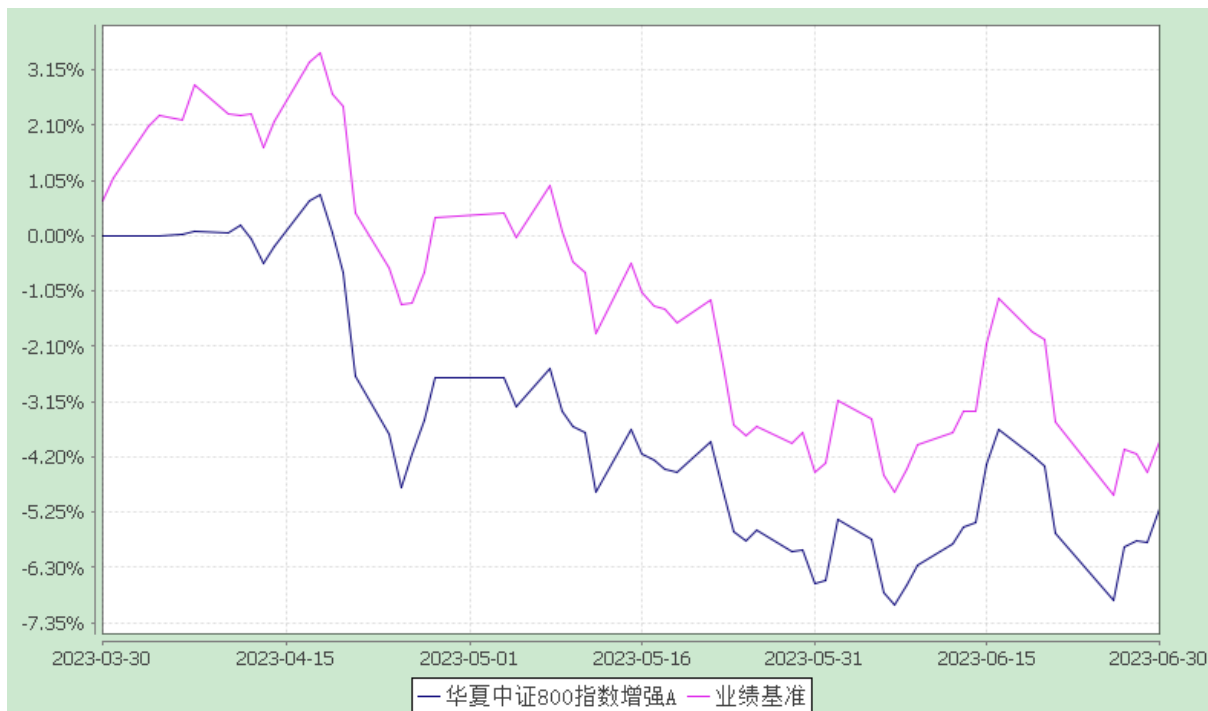
#### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

##### 华夏中证 800 指数增强型证券投资基金

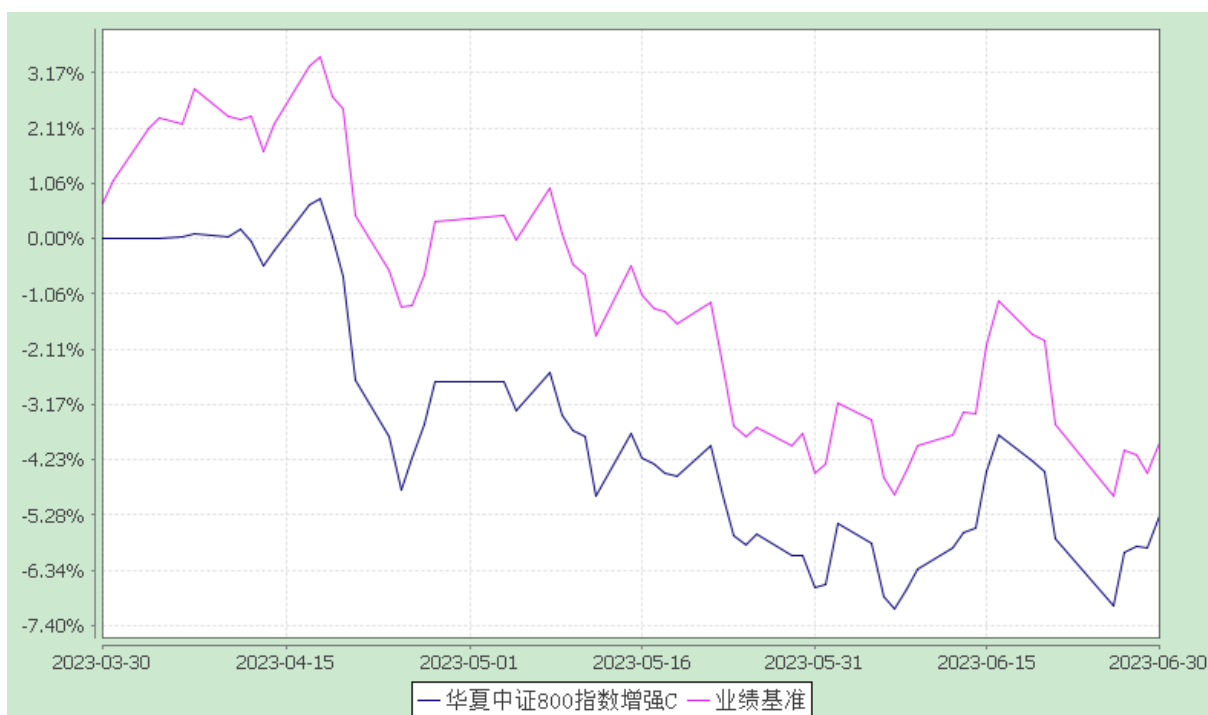
##### 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2023 年 3 月 30 日至 2023 年 6 月 30 日)

##### 华夏中证 800 指数增强 A



华夏中证 800 指数增强 C



注：①本基金合同于 2023 年 3 月 30 日生效。

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

## §4 管理人报告

## 4.1 基金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		
陈国峰	本基金的 基金经理	2023-03-30	-	8 年	硕士。曾任世坤投资咨询有限公司（WorldQuant）中国区研究总监等。2020 年加入华夏基金管理有限公司。历任数量投资部研究员、投资经理助理。

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

②证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

#### 4.3 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 800 指数，业绩比较基准为：中证 800 指数收益率 $\times$ 95%+银行活期存款利率(税后) $\times$ 5%。中证 800 指数由中证 500 和沪深 300 指数成份股组成，综合反映中国 A 股市场大中小市值公司的股票价格表现。作为指数增强型基金，本基金股票投资方面主要采用指数增强量化投资策略，在跟踪误差控制在目标范围内的基础上，力求获得超越标的指数的超额收益。

上半年，A 股市场上涨后震荡整理，结构性行情明显。行业间分化较大：通信、传媒、计算机、家电等行业表现较好，而农林牧渔、消费者服务、综合、房地产等行业表现较差。宽基指数也有所分化，其中中证 800 指数上涨 0.02%，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%。

本基金建仓初期仓位低，市场连续上涨，错失部分上涨机会，基金高仓位运行以来，获得了超越标的指数的超额收益，量化策略整体表现正常。

基金投资运作方面，报告期内本基金以多层次、多驱动、高度分散化的量化投资策略为主，投资策略完全基于计算机模型，全流程高度自动化。投资策略基于多维度海量数据，开发大量有预测能力的信号，在控制基金与标的指数跟踪误差的基础上，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 800 指数增强 A 基金份额净值为 0.9480 元，本报告期份额净值增长率为-5.20%；华夏中证 800 指数增强 C 基金份额净值为 0.9470 元，本报告期份额净值增长率为-5.30%，同期业绩比较基准增长率为-3.90%。本基金本报告期 A 类份额跟踪偏离度为-1.30%，C 类份额跟踪偏离度为-1.40%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，发展经济仍然是政府工作重心，货币政策将继续保持宽松，财政政策将处于积极状态，各种产业政策陆续出台，产业结构不断优化。受经济复苏的影响，整体 A 股上市公司盈利增速方向向上，但是增速幅度存在不确定。展望下半年，市场预计震荡上行，行业或者风格板块呈现轮动特征，我们将均衡配置。

基金投资运作方面，下半年本基金会在量化投资和研究的各个层次持续迭代、持续更新，提升主动量化策略能力。不断开发更多的策略与组合，在不同维度、不同频段持续优化，适应不断变化的市场环境，努力提高超额收益的稳定性。具体来讲，数据、因子、模型下半年均进行持续开发和迭代，不断完善策略，丰富超额收益来源。

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遵规守信情况声明

本报告期，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同以及托管协议的有关约定，诚实、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害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遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金的利润分配情况符合有关法律法规和基金合同的相关约定。

### 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

本托管人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，认为复核内容真实、准确、完整，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 800 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 2023 年 3 月 29 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	19,102,987.63	-
结算备付金		1,000,375.52	-
存出保证金		557,892.00	-
交易性金融资产	6.4.7.2	179,916,415.17	-
其中：股票投资		179,880,601.95	-
基金投资		-	-
债券投资		35,813.22	-
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		518,145.99	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		201,095,816.31	-
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2023 年 3 月 29 日</b>
<b>负债：</b>			
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		-	-
应付赎回款		3,643,664.25	-
应付管理人报酬		143,139.56	-
应付托管费		26,838.68	-
应付销售服务费		41,722.61	-
应付投资顾问费		-	-

应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	100,462.26	-
负债合计		3,955,827.36	-
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	208,082,269.64	-
未分配利润	6.4.7.8	-10,942,280.69	-
净资产合计		197,139,988.95	-
负债和净资产总计		201,095,816.31	-

注：①报告截止日 2023 年 6 月 30 日，华夏中证 800 指数增强 A 基金份额净值 0.9480 元，华夏中证 800 指数增强 C 基金份额净值 0.9470 元；华夏中证 800 指数增强基金份额总额 208,082,269.64 份（其中 A 类 88,510,776.87 份，C 类 119,571,492.77 份）。

②本基金合同于 2023 年 3 月 30 日生效，本报告期自 2023 年 3 月 30 日至 2023 年 6 月 30 日。

## 6.2 利润表

会计主体：华夏中证 800 指数增强型证券投资基金

本报告期：2023 年 3 月 30 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	
		2023 年 3 月 30 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日	
<b>一、营业总收入</b>			-11,635,495.01
1.利息收入			68,269.37
其中：存款利息收入	6.4.7.9		68,269.37
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）			-8,057,675.53
其中：股票投资收益	6.4.7.10		-10,248,544.35
基金投资收益			-
债券投资收益	6.4.7.11		4.30
资产支持证券投资	6.4.7.12		-
贵金属投资收益			-

衍生工具收益	6.4.7.13	-116.88
股利收益	6.4.7.14	2,190,981.40
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	-3,646,088.85
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	-
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>731,428.67</b>
1.管理人报酬		459,902.35
2.托管费		86,231.69
3.销售服务费		134,497.27
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		-
8.其他费用	6.4.7.18	50,797.36
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-12,366,923.68</b>
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-12,366,923.68</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		<b>-</b>
<b>六、综合收益总额</b>		<b>-12,366,923.68</b>

注：本基金合同于 2023 年 3 月 30 日生效，本报告期自 2023 年 3 月 30 日至 2023 年 6 月 30 日。

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：华夏中证 800 指数增强型证券投资基金

本报告期：2023 年 3 月 30 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 3 月 30 日（基金合同生效日）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）	-	-	-	-
二、本期期初净资产	239,308,115.94	-	-	239,308,115.94

产（基金净值）				
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-31,225,846.30	-	-10,942,280.69	-42,168,126.99
（一）、综合收益总额	-	-	-12,366,923.68	-12,366,923.68
（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）	-31,225,846.30	-	1,424,642.99	-29,801,203.31
其中：1.基金申购款	4,752,633.61	-	-275,004.34	4,477,629.27
2.基金赎回款	-35,978,479.91	-	1,699,647.33	-34,278,832.58
（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）	208,082,269.64	-	-10,942,280.69	197,139,988.95

注：本基金合同于 2023 年 3 月 30 日生效，本报告期自 2023 年 3 月 30 日至 2023 年 6 月 30 日。

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 800 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[2023]257 号文《关于准予华夏中证 800 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 800 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 2023 年 3 月 15 日至 2023 年 3 月 27 日共募集 239,256,168.07 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（2023）验字第 60739337\_A17 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华夏中证 800 指数增强型证券投资基金基金合同》于 2023 年 3 月 30 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 239,308,115.94 份基金份额，其中认购资



金利息折合 51,947.87 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，基金托管人为上海银行股份有限公司。

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 800 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（含科创板、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%-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 重要会计政策和会计估计

##### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本会计报表的实际编制期间为 2023 年 3 月 30 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日。

##### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

##### 1、金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

##### (1) 债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的商业模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益。基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资、资产支持证券投资 and 基金投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

##### (2) 权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

##### 2、金融负债的分类

本基金的金融负债于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

### 3、衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

#### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，其公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益。

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益。

本基金对以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础，进行减值处理并确认损失准备。本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况。

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产。当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

1、存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

2、当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

3、如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。对于曾经实施份额拆分或折算的基金，由于基金份额拆分或折算引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日

或基金份额折算日根据拆分前或折算前的基金份额数及确定的拆分或折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。对于已开放转换业务的基金，上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/（累计亏损）。

#### 6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

境内基金投资在持有期间应取得的现金红利于除息日确认为投资收益；境外基金投资在持有期间应取得的基金分红收益扣除基金交易所在地适用的预缴所得税后的净额确认为投资收益。境内股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益；境外股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除股票交易所在地适用的预缴所得税后的净额确认为投资收益。境内债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。境外债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在交易所在地适用的预缴所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；处置时其公允价值与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的按直线法近似计算。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

针对基金合同约定费率和计算方法的费用，本基金在费用涵盖期间按合同约定进行确认。

其他以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的按直线法近似计算。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

同一类别内的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红权益再投资日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。期末可供分配利润指期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

由于本基金各基金份额类别在费用收取上不同，其对应的可分配收益可能有所不同。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

#### 6.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，与所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

#### 6.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：（1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；（2）本基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；（3）本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个经营分部运作。

#### 6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

1、对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况参考《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》对重大影响基金资产净值的特殊事项停牌股票进行估值。

2、对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》进行估值。

3、对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交

易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场交易的固定收益品种，按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

4、本基金作为境外投资者在各个国家和地区证券市场的投资所得的相关税负是基于其现行的税法法规。各个国家和地区的税收规定可能发生变化，或者实施具有追溯力的修订，从而导致本基金在正常的经营活动中，部分交易和事项的最终税务处理存在不确定性。在计提和处理税收费用时，本基金需要作出相关会计估计。

#### 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	12,554,846.73
等于：本金	12,550,625.14	
加：应计利息	4,221.59	
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	6,548,140.90	
等于：本金	6,547,610.28	
加：应计利息	530.62	
合计	19,102,987.63	

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	183,281,839.72	-	179,880,601.95	-3,401,237.77	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	35,000.00	4.30	35,813.22	808.92
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	35,000.00	4.30	35,813.22	808.92
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	183,316,839.72	4.30	179,916,415.17	-3,400,428.85	

#### 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			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	

利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	4,894,760.00	-	-	-
其中：股指期货	4,894,760.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	4,894,760.00	-	-	-

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
IF2309	沪深 300 期货 IF2309 合约	3	3,455,100.00	-188,220.00
IC2309	中证 500 期货 IC2309 合约	1	1,194,000.00	-57,440.00
合计	-	-	-	-245,660.00
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	-245,660.00
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	-
应付证劵出借违约金	-

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	50,361.36
其他	50,100.90
合计	100,462.26

#### 6.4.7.7 实收基金

华夏中证 800 指数增强 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年3月30日（基金合同生效日）至2023年6月30日	
	基金份额	账面金额
基金合同生效日	99,110,008.26	99,110,008.26
本期申购	235,340.86	235,340.86
本期赎回（以“-”号填列）	-10,834,572.25	-10,834,572.25
本期末	88,510,776.87	88,510,776.87

华夏中证 800 指数增强 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年3月30日（基金合同生效日）至2023年6月30日	
	基金份额	账面金额
基金合同生效日	140,198,107.68	140,198,107.68
本期申购	4,517,292.75	4,517,292.75
本期赎回（以“-”号填列）	-25,143,907.66	-25,143,907.66
本期末	119,571,492.77	119,571,492.77

注：本基金在募集期间共募集有效净认购资金 239,256,168.07 元，根据本基金招募说明书的规定，认购资金在募集期间产生的利息 51,947.87 元在本基金合同生效后折算为 51,947.87 份基金份额，计入基金份额持有人账户。

#### 6.4.7.8 未分配利润

华夏中证 800 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
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-3,562,267.95	-1,527,030.54	-5,089,298.49
本期基金份额交易产生的变动数	355,632.89	127,641.50	483,274.39
其中：基金申购款	-7,952.59	-3,962.22	-11,914.81

基金赎回款	363,585.48	131,603.72	495,189.20
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-3,206,635.06	-1,399,389.04	-4,606,024.10

华夏中证 800 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
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-5,158,566.88	-2,119,058.31	-7,277,625.19
本期基金份额交易产生的变动数	713,385.46	227,983.14	941,368.60
其中：基金申购款	-159,132.82	-103,956.71	-263,089.53
基金赎回款	872,518.28	331,939.85	1,204,458.13
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-4,445,181.42	-1,891,075.17	-6,336,256.59

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 3 月 30 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	50,737.79
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	13,487.18
结算备付金利息收入	4,044.40
其他	-
合计	68,269.37

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 3 月 30 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	586,019,341.98
减：卖出股票成本总额	595,123,940.18
减：交易费用	1,143,946.15
买卖股票差价收入	-10,248,544.35

#### 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3月30日（基金合同生效日）至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	4.30
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-
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	4.30

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

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3月30日（基金合同生效日）至2023年6月30日
股指期货投资收益	-116.88

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023年3月30日（基金合同生效日）至2023年6月30日
股票投资产生的股利收益	2,190,981.40
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	2,190,981.40

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3月30日（基金合同生效日）至2023年6月30日
1.交易性金融资产	-3,400,428.85

——股票投资	-3,401,237.77
——债券投资	808.92
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-245,660.00
——权证投资	-
——期货投资	-245,660.00
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	-3,646,088.85

#### 6.4.7.16 其他收入

无。

#### 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3月30日（基金合同生效日）至2023年6月30日
审计费用	16,787.43
信息披露费	33,573.93
证券出借违约金	-
银行费用	36.00
其他	400.00
合计	50,797.36

#### 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
上海银行股份有限公司（“上海银行”）	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

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3月30日（基金合同生效日）至2023年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	459,902.35
其中：支付销售机构的客户维护费	3,128.88

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3月30日（基金合同生效日）至2023年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	86,231.69

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

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2023年3月30日（基金合同生效日）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 800 指数增强 A	华夏中证 800 指数增强 C	合计
华夏基金管理有限公司	-	-1.33	-1.33
中信证券	-	155.54	155.54
合计	-	154.21	154.21

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3月30日（基金合同生效日）至2023年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
上海银行活期存款	12,554,846.73	50,737.79

注：本基金的活期银行存款由基金托管人上海银行保管，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3月30日（基金合同生效日）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	601916	浙商银行	配股发行	62,670	126,593.40
中信证券	688523	航天环宇	新股发行	3,284	71,788.24
中信证券	301323	新莱福	新股发行	1,480	57,808.80
中信证券	301170	锡南科技	新股发行	1,591	54,094.00
中信证券	301261	恒工精密	新股发行	1,381	50,958.90
中信证券	688631	莱斯信息	新股发行	1,937	48,967.36

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)	新发流通受限	57.66	57.66	1,379	79,513.14	79,513.14	-
301395	仁信	2023-06-21	1个月	新发	26.68	26.68	2,805	74,837.40	74,837.40	-

	新材		内(含)	流通受限						
301292	海科新源	2023-06-29	1 个月内(含)	新发流通受限	19.99	19.99	3,668	73,323.32	73,323.32	-
301488	豪恩汽电	2023-06-26	1 个月内(含)	新发流通受限	39.78	39.78	1,683	66,949.74	66,949.74	-
688603	天承科技	2023-06-30	1 个月内(含)	新发流通受限	55.00	55.00	1,063	58,465.00	58,465.00	-
301202	朗威股份	2023-06-28	1 个月内(含)	新发流通受限	25.82	25.82	1,916	49,471.12	49,471.12	-
301261	恒工精密	2023-06-29	1 个月内(含)	新发流通受限	36.90	36.90	1,242	45,829.80	45,829.80	-
688472	阿特斯	2023-06-02	6 个月	新发流通受限	11.10	17.04	1,009	11,199.90	17,193.36	-
688361	中科飞测	2023-05-12	6 个月	新发流通受限	23.60	64.67	263	6,206.80	17,008.21	-
688562	航天软件	2023-05-15	6 个月	新发流通受限	12.68	22.31	511	6,479.48	11,400.41	-
301310	鑫宏业	2023-05-26	6 个月	新发流通受限	67.28	65.43	167	11,235.76	10,926.81	-
688582	芯动联科	2023-06-21	6 个月	新发流通受限	26.74	40.68	266	7,112.84	10,820.88	-
301399	英特科技	2023-05-16	6 个月	新发流通受限	43.99	51.57	193	8,490.07	9,953.01	-
688543	国科军工	2023-06-14	6 个月	新发流通受限	43.67	53.05	171	7,467.57	9,071.55	-
301486	致尚科技	2023-06-30	6 个月	新发流通受限	57.66	57.66	154	8,879.64	8,879.64	-
301291	明阳电气	2023-06-21	6 个月	新发流通受限	38.13	31.03	282	10,752.66	8,750.46	-

688458	美芯晟	2023-05-15	6 个月	新发 流通 受限	75.00	90.76	94	7,050.00	8,531.44	-
301395	仁信新材	2023-06-21	6 个月	新发 流通 受限	26.68	26.68	312	8,324.16	8,324.16	-
301292	海科新源	2023-06-29	6 个月	新发 流通 受限	19.99	19.99	408	8,155.92	8,155.92	-
301383	天键股份	2023-05-31	6 个月	新发 流通 受限	46.16	35.72	226	10,432.16	8,072.72	-
301225	恒勃股份	2023-06-08	6 个月	新发 流通 受限	35.66	33.26	240	8,558.40	7,982.40	-
301262	海看股份	2023-06-13	6 个月	新发 流通 受限	30.22	25.50	309	9,337.98	7,879.50	-
688523	航天环宇	2023-05-26	6 个月	新发 流通 受限	21.86	23.85	329	7,191.94	7,846.65	-
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	-
301488	豪恩汽电	2023-06-26	6 个月	新发 流通 受限	39.78	39.78	187	7,438.86	7,438.86	-
688429	时创能源	2023-06-20	6 个月	新发 流通 受限	19.20	25.53	289	5,548.80	7,378.17	-
301355	南王科技	2023-06-02	6 个月	新发 流通 受限	17.55	16.75	438	7,686.90	7,336.50	-
301332	德尔玛	2023-05-09	6 个月	新发 流通 受限	14.81	13.73	527	7,804.87	7,235.71	-
301210	金杨股份	2023-06-21	6 个月	新发 流通 受限	57.88	49.17	145	8,392.60	7,129.65	-
301428	世纪恒通	2023-05-10	6 个月	新发 流通 受限	26.35	30.60	224	5,902.40	6,854.40	-
301305	朗坤环境	2023-05-15	6 个月	新发 流通	25.25	19.69	339	8,559.75	6,674.91	-

				受限						
688603	天承科技	2023-06-30	6 个月	新发 流通 受限	55.00	55.00	119	6,545.00	6,545.00	-
688570	天玛智控	2023-05-29	6 个月	新发 流通 受限	30.26	25.33	254	7,686.04	6,433.82	-
300804	广康生化	2023-06-15	6 个月	新发 流通 受限	42.45	32.97	193	8,192.85	6,363.21	-
301376	致欧科技	2023-06-14	6 个月	新发 流通 受限	24.66	22.51	280	6,904.80	6,302.80	-
301232	飞沃科技	2023-06-08	6 个月	新发 流通 受限	72.50	58.42	107	7,757.50	6,250.94	-
301397	溯联股份	2023-06-15	6 个月	新发 流通 受限	53.27	40.20	153	8,150.31	6,150.60	-
301323	新莱福	2023-05-29	6 个月	新发 流通 受限	39.06	39.36	148	5,780.88	5,825.28	-
688631	莱斯信息	2023-06-19	6 个月	新发 流通 受限	25.28	29.87	194	4,904.32	5,794.78	-
301170	锡南科技	2023-06-16	6 个月	新发 流通 受限	34.00	34.93	160	5,440.00	5,588.80	-
301337	亚华电子	2023-05-16	6 个月	新发 流通 受限	32.60	30.37	183	5,965.80	5,557.71	-
301202	朗威股份	2023-06-28	6 个月	新发 流通 受限	25.82	25.82	213	5,499.66	5,499.66	-
301261	恒工精密	2023-06-29	6 个月	新发 流通 受限	36.90	36.90	139	5,129.10	5,129.10	-
001282	三联锻造	2023-05-15	6 个月	新发 流通 受限	27.93	33.03	82	2,290.26	2,708.46	-
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
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(张)	期末 成本总额	期末 估值总额	备注

127086	恒邦转债	2023-06-12	1 个月内(含)	新发流通受限	100.00	100.01	311	31,100.00	31,102.59	期末估值单价为含息价格
127087	星帅转 2	2023-06-14	6 个月内(含)	新发流通受限	100.00	100.01	15	1,500.00	1,500.17	期末估值单价为含息价格

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	重大事	6.97	2023-0	7.40	11,000	78,817.58	76,670.00	-

		-28	项		7-03					
000561	烽火电 子	2023-06 -30	重大事 项	11.57	2023-0 7-14	12.73	2,500	25,577.00	28,925.00	-

#### 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之内。

##### 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 800 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	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	179,880,601.95	91.25
交易性金融资产—基金投资	-	-
交易性金融资产—债券投资	35,813.22	0.02
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	179,916,415.17	91.26

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 800 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
	-5%	-8,429,542.46
	+5%	8,429,542.46

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	179,037,077.36
第二层次	636,559.62
第三层次	242,778.19



合计	179,916,415.17
----	----------------

#### 6.4.14.2 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	179,880,601.95	89.45
	其中：股票	179,880,601.95	89.45
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	35,813.22	0.02
	其中：债券	35,813.22	0.02
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	20,103,363.15	10.00
8	其他各项资产	1,076,037.99	0.54

9	合计	201,095,816.31	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	787,773.00	0.40
B	采矿业	3,886,840.50	1.97
C	制造业	90,985,365.55	46.15
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,112,995.60	2.09
E	建筑业	3,209,302.40	1.63
F	批发和零售业	1,479,568.76	0.75
G	交通运输、仓储和邮政业	2,176,797.70	1.10
H	住宿和餐饮业	510,364.00	0.26
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,764,285.82	4.45
J	金融业	30,300,562.00	15.37
K	房地产业	1,682,043.00	0.85
L	租赁和商务服务业	1,582,626.00	0.80
M	科学研究和技术服务业	672,609.00	0.34
N	水利、环境和公共设施管理业	23,132.00	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,116,215.55	0.57
R	文化、体育和娱乐业	2,299,334.00	1.17
S	综合	47,730.00	0.02
	合计	153,637,544.88	77.93

## 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	156,813.00	0.08
B	采矿业	747,781.60	0.38
C	制造业	16,319,088.36	8.28
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	173,693.00	0.09
E	建筑业	386,438.00	0.20
F	批发和零售业	652,172.50	0.33

G	交通运输、仓储和邮政业	885,137.20	0.45
H	住宿和餐饮业	9,228.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,825,076.40	1.43
J	金融业	1,917,792.80	0.97
K	房地产业	310,656.00	0.16
L	租赁和商务服务业	222,881.30	0.11
M	科学研究和技术服务业	748,204.00	0.38
N	水利、环境和公共设施管理业	197,399.91	0.10
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	4,333.00	0.00
Q	卫生和社会工作	206,420.00	0.10
R	文化、体育和娱乐业	447,926.00	0.23
S	综合	32,016.00	0.02
	合计	26,243,057.07	13.31

### 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	600519	贵州茅台	4,700	7,947,700.00	4.03
2	300750	宁德时代	12,840	2,937,663.60	1.49
3	688599	天合光能	62,700	2,671,647.00	1.36
4	601318	中国平安	50,600	2,347,840.00	1.19
5	000596	古井贡酒	8,600	2,127,468.00	1.08
6	603288	海天味业	41,480	1,943,338.00	0.99
7	600436	片仔癀	5,900	1,689,524.00	0.86
8	000333	美的集团	28,000	1,649,760.00	0.84
9	600406	国电南瑞	64,820	1,497,342.00	0.76
10	600276	恒瑞医药	30,800	1,475,320.00	0.75
11	600031	三一重工	86,900	1,445,147.00	0.73
12	300896	爱美客	3,200	1,423,840.00	0.72
13	002371	北方华创	4,300	1,365,895.00	0.69
14	601077	渝农商行	380,100	1,364,559.00	0.69
15	603688	石英股份	11,800	1,343,312.00	0.68
16	600036	招商银行	36,900	1,208,844.00	0.61
17	300142	沃森生物	44,500	1,177,025.00	0.60
18	601128	常熟银行	170,700	1,164,174.00	0.59
19	000338	潍柴动力	92,900	1,157,534.00	0.59
20	300316	晶盛机电	16,200	1,148,580.00	0.58
21	600015	华夏银行	209,300	1,132,313.00	0.57
22	002027	分众传媒	161,200	1,097,772.00	0.56

23	601169	北京银行	234,700	1,086,661.00	0.55
24	300413	芒果超媒	30,600	1,046,826.00	0.53
25	601658	邮储银行	212,100	1,037,169.00	0.53
26	000623	吉林敖东	63,400	1,016,936.00	0.52
27	600900	长江电力	44,700	986,082.00	0.50
28	300015	爱尔眼科	52,341	970,925.55	0.49
29	600109	国金证券	109,900	952,833.00	0.48
30	300433	蓝思科技	79,900	939,624.00	0.48
31	002271	东方雨虹	34,300	935,018.00	0.47
32	000895	双汇发展	37,000	906,130.00	0.46
33	002415	海康威视	27,000	893,970.00	0.45
34	300760	迈瑞医疗	2,900	869,420.00	0.44
35	002459	晶澳科技	20,360	849,012.00	0.43
36	688012	中微公司	5,400	844,830.00	0.43
37	603501	韦尔股份	8,500	833,340.00	0.42
38	601166	兴业银行	52,800	826,320.00	0.42
39	000157	中联重科	118,600	800,550.00	0.41
40	600989	宝丰能源	62,600	789,386.00	0.40
41	000166	申万宏源	166,600	769,692.00	0.39
42	688126	沪硅产业	36,700	767,030.00	0.39
43	603589	口子窖	15,321	756,091.35	0.38
44	002916	深南电路	10,000	753,700.00	0.38
45	603369	今世缘	14,200	749,760.00	0.38
46	002568	百润股份	20,500	745,175.00	0.38
47	002736	国信证券	84,800	740,304.00	0.38
48	300763	锦浪科技	7,100	739,110.00	0.37
49	603290	斯达半导	3,400	731,680.00	0.37
50	002304	洋河股份	5,500	722,425.00	0.37
51	300408	三环集团	24,600	722,010.00	0.37
52	002600	领益智造	104,400	721,404.00	0.37
53	600909	华安证券	154,000	719,180.00	0.36
54	002518	科士达	17,900	716,179.00	0.36
55	002797	第一创业	124,500	712,140.00	0.36
56	600588	用友网络	34,600	709,300.00	0.36
57	601336	新华保险	18,900	694,953.00	0.35
58	600309	万华化学	7,900	693,936.00	0.35
59	600155	华创云信	111,200	691,664.00	0.35
60	300999	金龙鱼	17,200	687,828.00	0.35
61	000858	五粮液	4,200	686,994.00	0.35
62	601800	中国交建	62,700	684,057.00	0.35
63	002966	苏州银行	103,200	675,960.00	0.34
64	600837	海通证券	72,800	671,216.00	0.34
65	000651	格力电器	18,000	657,180.00	0.33

66	000728	国元证券	99,200	646,784.00	0.33
67	688390	固德威	3,856	643,412.16	0.33
68	600999	招商证券	47,300	641,861.00	0.33
69	002352	顺丰控股	14,200	640,278.00	0.32
70	000708	中信特钢	40,200	636,768.00	0.32
71	002056	横店东磁	34,900	635,529.00	0.32
72	300454	深信服	5,600	634,200.00	0.32
73	600516	方大炭素	102,100	633,020.00	0.32
74	002007	华兰生物	28,200	631,962.00	0.32
75	000750	国海证券	187,900	629,465.00	0.32
76	600390	五矿资本	116,100	624,618.00	0.32
77	002500	山西证券	111,900	624,402.00	0.32
78	600498	烽火通信	30,500	621,285.00	0.32
79	002594	比亚迪	2,400	619,848.00	0.31
80	601997	贵阳银行	120,000	619,200.00	0.31
81	002429	兆驰股份	111,900	615,450.00	0.31
82	000568	泸州老窖	2,900	607,753.00	0.31
83	002531	天顺风能	39,600	603,108.00	0.31
84	300628	亿联网络	17,000	596,190.00	0.30
85	601766	中国中车	91,700	596,050.00	0.30
86	002465	海格通信	57,400	593,516.00	0.30
87	600919	江苏银行	79,200	582,120.00	0.30
88	002739	万达电影	46,400	581,856.00	0.30
89	000786	北新建材	23,400	573,534.00	0.29
90	300438	鹏辉能源	11,800	566,872.00	0.29
91	002439	启明星辰	18,900	562,464.00	0.29
92	601877	正泰电器	20,300	561,295.00	0.28
93	000739	普洛药业	31,500	558,810.00	0.28
94	600958	东方证券	57,300	555,810.00	0.28
95	601618	中国中冶	139,000	551,830.00	0.28
96	601728	中国电信	96,800	544,984.00	0.28
97	600048	保利发展	41,800	544,654.00	0.28
98	601577	长沙银行	67,800	526,128.00	0.27
99	600941	中国移动	5,600	522,480.00	0.27
100	000783	长江证券	89,900	521,420.00	0.26
101	600918	中泰证券	75,200	519,632.00	0.26
102	600271	航天信息	37,900	518,851.00	0.26
103	000878	云南铜业	46,500	513,825.00	0.26
104	603927	中科软	13,000	501,280.00	0.25
105	002142	宁波银行	19,800	500,940.00	0.25
106	002673	西部证券	78,600	499,110.00	0.25
107	600585	海螺水泥	20,915	496,522.10	0.25
108	300383	光环新网	46,100	495,575.00	0.25

109	601600	中国铝业	89,800	493,002.00	0.25
110	600905	三峡能源	89,500	480,615.00	0.24
111	601601	中国太保	17,900	465,042.00	0.24
112	000027	深圳能源	69,400	457,346.00	0.23
113	688002	睿创微纳	10,100	452,480.00	0.23
114	001979	招商蛇口	34,600	450,838.00	0.23
115	003816	中国广核	144,700	450,017.00	0.23
116	601117	中国化学	54,000	447,120.00	0.23
117	002926	华西证券	53,700	446,247.00	0.23
118	002299	圣农发展	23,300	446,195.00	0.23
119	002028	思源电气	9,100	425,152.00	0.22
120	603650	彤程新材	12,800	419,840.00	0.21
121	600863	内蒙华电	100,804	418,336.60	0.21
122	002273	水晶光电	34,800	415,512.00	0.21
123	002373	千方科技	30,300	413,292.00	0.21
124	603127	昭衍新药	10,020	409,818.00	0.21
125	600096	云天化	23,900	407,973.00	0.21
126	601225	陕西煤业	22,400	407,456.00	0.21
127	002065	东华软件	57,400	405,244.00	0.21
128	601958	金铂股份	36,200	403,630.00	0.20
129	603883	老百姓	13,400	399,990.00	0.20
130	600027	华电国际	59,700	399,393.00	0.20
131	002311	海大集团	8,500	398,140.00	0.20
132	000301	东方盛虹	33,500	395,970.00	0.20
133	601699	潞安环能	23,900	390,048.00	0.20
134	600754	锦江酒店	9,100	385,294.00	0.20
135	002078	太阳纸业	35,800	382,702.00	0.19
136	601100	恒立液压	5,900	379,547.00	0.19
137	601211	国泰君安	27,100	379,129.00	0.19
138	601717	郑煤机	30,400	378,480.00	0.19
139	600690	海尔智家	15,700	368,636.00	0.19
140	601021	春秋航空	6,400	367,808.00	0.19
141	300003	乐普医疗	16,100	364,021.00	0.18
142	600362	江西铜业	19,000	360,620.00	0.18
143	601939	建设银行	56,800	355,568.00	0.18
144	600884	杉杉股份	23,200	351,248.00	0.18
145	002025	航天电器	5,500	350,900.00	0.18
146	600369	西南证券	94,500	344,925.00	0.17
147	002508	老板电器	13,600	343,944.00	0.17
148	603444	吉比特	697	342,303.67	0.17
149	601236	红塔证券	45,700	340,465.00	0.17
150	601818	光大银行	107,200	329,104.00	0.17
151	600418	江淮汽车	26,000	327,340.00	0.17

152	002422	科伦药业	10,900	323,512.00	0.16
153	002745	木林森	34,900	321,080.00	0.16
154	600373	中文传媒	24,100	321,012.00	0.16
155	002250	联化科技	30,500	319,030.00	0.16
156	002372	伟星新材	15,500	318,370.00	0.16
157	300124	汇川技术	4,900	314,629.00	0.16
158	688036	传音控股	2,100	308,700.00	0.16
159	601231	环旭电子	20,600	308,176.00	0.16
160	002410	广联达	9,400	305,406.00	0.15
161	000001	平安银行	26,800	300,964.00	0.15
162	600887	伊利股份	10,600	300,192.00	0.15
163	002939	长城证券	36,500	296,745.00	0.15
164	603225	新凤鸣	26,700	295,035.00	0.15
165	601555	东吴证券	42,400	294,256.00	0.15
166	600348	华阳股份	37,150	293,856.50	0.15
167	600782	新钢股份	79,100	293,461.00	0.15
168	600820	隧道股份	48,700	292,687.00	0.15
169	300136	信维通信	14,500	291,160.00	0.15
170	600674	川投能源	19,000	285,950.00	0.15
171	603185	弘元绿能	3,800	283,290.00	0.14
172	000729	燕京啤酒	22,600	281,822.00	0.14
173	600535	天士力	19,400	281,494.00	0.14
174	601006	大秦铁路	37,600	279,368.00	0.14
175	603218	日月股份	14,700	279,153.00	0.14
176	600329	达仁堂	6,200	278,318.00	0.14
177	601233	桐昆股份	21,000	278,250.00	0.14
178	600859	王府井	14,000	277,060.00	0.14
179	600038	中直股份	6,944	276,510.08	0.14
180	601398	工商银行	57,300	276,186.00	0.14
181	600642	申能股份	39,500	276,105.00	0.14
182	600985	淮北矿业	23,800	274,176.00	0.14
183	002152	广电运通	23,100	270,732.00	0.14
184	601888	中国中免	2,400	265,272.00	0.13
185	000998	隆平高科	17,000	260,950.00	0.13
186	600325	华发股份	25,600	252,160.00	0.13
187	600489	中金黄金	24,400	252,052.00	0.13
188	002138	顺络电子	10,500	251,055.00	0.13
189	002128	电投能源	18,800	248,536.00	0.13
190	002938	鹏鼎控股	10,000	242,900.00	0.12
191	002985	北摩高科	5,500	242,660.00	0.12
192	601108	财通证券	33,500	242,540.00	0.12
193	600029	南方航空	40,100	241,803.00	0.12
194	000792	盐湖股份	12,600	241,542.00	0.12

195	600170	上海建工	89,400	240,486.00	0.12
196	600606	绿地控股	87,200	239,800.00	0.12
197	600570	恒生电子	5,400	239,166.00	0.12
198	600259	广晟有色	6,600	238,524.00	0.12
199	601688	华泰证券	17,300	238,221.00	0.12
200	002074	国轩高科	8,600	237,532.00	0.12
201	300724	捷佳伟创	2,100	235,935.00	0.12
202	600755	厦门国贸	30,000	232,200.00	0.12
203	002353	杰瑞股份	9,200	231,196.00	0.12
204	000538	云南白药	4,400	230,912.00	0.12
205	300832	新产业	3,900	230,100.00	0.12
206	600219	南山铝业	75,400	227,708.00	0.12
207	300866	安克创新	2,600	227,500.00	0.12
208	000997	新大陆	12,000	226,800.00	0.12
209	000963	华东医药	5,200	225,524.00	0.11
210	603000	人民网	7,700	224,840.00	0.11
211	000778	新兴铸管	55,100	224,808.00	0.11
212	600143	金发科技	25,600	223,488.00	0.11
213	000012	南玻 A	37,300	222,308.00	0.11
214	000703	恒逸石化	32,600	221,028.00	0.11
215	601668	中国建筑	38,400	220,416.00	0.11
216	601377	兴业证券	36,000	220,320.00	0.11
217	002683	广东宏大	7,400	217,856.00	0.11
218	600104	上汽集团	15,300	216,801.00	0.11
219	600801	华新水泥	17,400	214,890.00	0.11
220	002010	传化智联	40,000	212,800.00	0.11
221	002595	豪迈科技	6,000	210,780.00	0.11
222	600497	驰宏锌锗	41,500	208,330.00	0.11
223	002384	东山精密	8,000	207,200.00	0.11
224	600196	复星医药	6,700	207,030.00	0.11
225	300759	康龙化成	5,400	206,712.00	0.10
226	000776	广发证券	14,000	205,940.00	0.10
227	600871	石化油服	101,100	200,178.00	0.10
228	300009	安科生物	19,600	196,000.00	0.10
229	600563	法拉电子	1,400	192,220.00	0.10
230	601868	中国能建	81,500	190,710.00	0.10
231	300059	东方财富	13,220	187,724.00	0.10
232	600718	东软集团	17,200	183,352.00	0.09
233	300861	美畅股份	4,200	182,154.00	0.09
234	002129	TCL 中环	5,400	179,280.00	0.09
235	600166	福田汽车	50,900	173,060.00	0.09
236	000060	中金岭南	36,100	171,475.00	0.09
237	000738	航发控制	7,000	170,800.00	0.09



238	601966	玲珑轮胎	7,600	168,872.00	0.09
239	603737	三棵树	2,560	167,475.20	0.08
240	000975	银泰黄金	14,300	167,310.00	0.08
241	000537	广宇发展	14,300	166,881.00	0.08
242	002475	立讯精密	5,100	165,495.00	0.08
243	002368	太极股份	4,000	164,680.00	0.08
244	600970	中材国际	12,900	164,475.00	0.08
245	688303	大全能源	4,000	161,800.00	0.08
246	601162	天风证券	53,800	160,324.00	0.08
247	600061	国投资本	22,500	160,200.00	0.08
248	600637	东方明珠	19,700	154,054.00	0.08
249	601898	中煤能源	18,200	153,608.00	0.08
250	002705	新宝股份	8,500	153,255.00	0.08
251	000825	太钢不锈	39,600	153,252.00	0.08
252	002385	大北农	22,900	151,140.00	0.08
253	688516	奥特维	800	150,720.00	0.08
254	000709	河钢股份	65,700	148,482.00	0.08
255	600886	国投电力	11,700	148,005.00	0.08
256	601899	紫金矿业	12,900	146,673.00	0.07
257	688223	晶科能源	10,400	146,224.00	0.07
258	300073	当升科技	2,900	145,957.00	0.07
259	600763	通策医疗	1,500	145,290.00	0.07
260	300146	汤臣倍健	6,000	143,880.00	0.07
261	600398	海澜之家	20,900	143,792.00	0.07
262	600885	宏发股份	4,500	143,325.00	0.07
263	600352	浙江龙盛	15,200	142,120.00	0.07
264	600131	国网信通	7,001	141,350.19	0.07
265	600000	浦发银行	19,500	141,180.00	0.07
266	603338	浙江鼎力	2,500	140,025.00	0.07
267	600316	洪都航空	5,900	138,355.00	0.07
268	300601	康泰生物	5,400	137,106.00	0.07
269	600582	天地科技	23,300	135,839.00	0.07
270	300257	开山股份	8,900	135,013.00	0.07
271	688208	道通科技	4,400	133,364.00	0.07
272	600959	江苏有线	39,400	133,172.00	0.07
273	002244	滨江集团	14,800	130,536.00	0.07
274	600809	山西汾酒	700	129,549.00	0.07
275	300285	国瓷材料	4,700	128,780.00	0.07
276	300487	蓝晓科技	2,050	127,961.00	0.06
277	600741	华域汽车	6,900	127,374.00	0.06
278	601228	广州港	39,390	127,229.70	0.06
279	600546	山煤国际	8,700	125,889.00	0.06
280	000636	风华高科	8,200	125,788.00	0.06

281	688006	杭可科技	4,120	125,536.40	0.06
282	000156	华数传媒	14,400	125,280.00	0.06
283	600258	首旅酒店	6,600	125,070.00	0.06
284	002791	坚朗五金	1,900	122,949.00	0.06
285	601456	国联证券	13,500	122,850.00	0.06
286	600009	上海机场	2,700	122,634.00	0.06
287	600481	双良节能	8,700	121,626.00	0.06
288	300014	亿纬锂能	2,000	121,000.00	0.06
289	002625	光启技术	7,800	119,028.00	0.06
290	000050	深天马 A	12,900	118,422.00	0.06
291	603993	洛阳钼业	22,100	117,793.00	0.06
292	603893	瑞芯微	1,600	116,560.00	0.06
293	601990	南京证券	14,100	115,338.00	0.06
294	000830	鲁西化工	10,900	115,104.00	0.06
295	002648	卫星化学	7,500	112,200.00	0.06
296	600039	四川路桥	11,240	110,264.40	0.06
297	002511	中顺洁柔	9,700	108,155.00	0.05
298	688009	中国通号	18,400	106,720.00	0.05
299	601098	中南传媒	9,100	105,560.00	0.05
300	600566	济川药业	3,600	104,544.00	0.05
301	300677	英科医疗	4,700	103,400.00	0.05
302	600521	华海药业	5,600	103,096.00	0.05
303	002601	龙佰集团	6,200	102,300.00	0.05
304	300357	我武生物	3,000	100,890.00	0.05
305	601009	南京银行	12,600	100,800.00	0.05
306	601816	京沪高铁	18,600	97,836.00	0.05
307	300682	朗新科技	4,200	97,776.00	0.05
308	601985	中国核电	13,700	96,585.00	0.05
309	601872	招商轮船	16,500	95,535.00	0.05
310	600764	中国海防	3,500	95,270.00	0.05
311	601000	唐山港	26,600	93,898.00	0.05
312	688521	芯原股份	1,300	93,496.00	0.05
313	600827	百联股份	6,900	92,253.00	0.05
314	300017	网宿科技	12,900	91,719.00	0.05
315	601808	中海油服	6,600	91,608.00	0.05
316	000423	东阿阿胶	1,700	90,865.00	0.05
317	002080	中材科技	4,400	90,288.00	0.05
318	601989	中国重工	18,600	89,652.00	0.05
319	600879	航天电子	10,400	88,296.00	0.04
320	600208	新湖中宝	35,600	88,288.00	0.04
321	002223	鱼跃医疗	2,400	86,376.00	0.04
322	000725	京东方 A	21,100	86,299.00	0.04
323	600025	华能水电	11,700	83,421.00	0.04

324	300699	光威复材	2,700	83,295.00	0.04
325	000401	冀东水泥	11,300	83,281.00	0.04
326	600016	民生银行	21,600	81,000.00	0.04
327	600549	厦门钨业	4,200	79,926.00	0.04
328	688396	华润微	1,491	78,143.31	0.04
329	601298	青岛港	11,000	76,670.00	0.04
330	688200	华峰测控	500	76,500.00	0.04
331	000630	铜陵有色	26,400	76,296.00	0.04
332	600183	生益科技	5,300	75,260.00	0.04
333	600998	九州通	7,152	74,237.76	0.04
334	601288	农业银行	21,000	74,130.00	0.04
335	000768	中航西飞	2,700	72,225.00	0.04
336	002001	新和成	4,600	70,840.00	0.04
337	600062	华润双鹤	4,000	69,680.00	0.04
338	600598	北大荒	5,100	67,983.00	0.03
339	300296	利亚德	10,000	65,300.00	0.03
340	000887	中鼎股份	4,700	61,523.00	0.03
341	000932	华菱钢铁	12,700	60,579.00	0.03
342	300144	宋城演艺	4,800	59,520.00	0.03
343	601928	凤凰传媒	5,200	59,280.00	0.03
343	600528	中铁工业	6,000	59,280.00	0.03
345	601186	中国铁建	5,900	58,115.00	0.03
346	603259	药明康德	900	56,079.00	0.03
347	002850	科达利	400	52,900.00	0.03
348	600435	北方导航	4,500	51,705.00	0.03
349	601168	西部矿业	4,900	51,499.00	0.03
350	601608	中信重工	12,200	51,362.00	0.03
351	601718	际华集团	17,000	50,490.00	0.03
352	000063	中兴通讯	1,100	50,094.00	0.03
353	600699	均胜电子	2,800	49,392.00	0.03
354	601012	隆基绿能	1,500	43,005.00	0.02
355	600487	亨通光电	2,800	41,048.00	0.02
356	601878	浙商证券	4,000	39,520.00	0.02
357	000400	许继电气	1,700	39,185.00	0.02
358	688188	柏楚电子	200	37,712.00	0.02
359	002444	巨星科技	1,700	37,196.00	0.02
360	300088	长信科技	6,100	36,783.00	0.02
361	688777	中控技术	582	36,537.96	0.02
362	301029	怡合达	800	35,744.00	0.02
363	603899	晨光股份	800	35,712.00	0.02
364	603317	天味食品	2,400	35,064.00	0.02
365	002202	金风科技	3,300	35,046.00	0.02
366	600060	海信视像	1,400	34,650.00	0.02

367	600085	同仁堂	600	34,536.00	0.02
368	000800	一汽解放	4,100	34,317.00	0.02
369	000987	越秀资本	5,300	33,655.00	0.02
370	688029	南微医学	400	32,624.00	0.02
371	000009	中国宝安	2,700	32,589.00	0.02
372	600315	上海家化	1,100	31,911.00	0.02
373	601838	成都银行	2,600	31,746.00	0.02
374	601615	明阳智能	1,800	30,384.00	0.02
375	000581	威孚高科	1,900	29,925.00	0.02
376	600500	中化国际	5,100	28,356.00	0.01
377	603939	益丰药房	720	26,640.00	0.01
378	688008	澜起科技	453	26,011.26	0.01
379	603379	三美股份	1,100	25,861.00	0.01
380	002179	中航光电	530	24,035.50	0.01
381	688116	天奈科技	500	22,875.00	0.01
382	600499	科达制造	2,000	22,720.00	0.01
383	002019	亿帆医药	1,500	21,900.00	0.01
384	002414	高德红外	2,800	21,756.00	0.01
385	002468	申通快递	2,000	21,640.00	0.01
386	601216	君正集团	5,100	20,910.00	0.01
387	600066	宇通客车	1,400	20,636.00	0.01
388	600873	梅花生物	2,200	19,646.00	0.01
389	300115	长盈精密	1,600	19,056.00	0.01
390	601155	新城控股	1,300	18,733.00	0.01
391	688363	华熙生物	200	17,832.00	0.01
392	688567	孚能科技	800	17,272.00	0.01
393	600760	中航沈飞	340	15,300.00	0.01
393	600399	抚顺特钢	1,500	15,300.00	0.01
395	600673	东阳光	2,100	15,141.00	0.01
396	002032	苏泊尔	300	15,000.00	0.01
397	002266	浙富控股	3,400	14,042.00	0.01
398	603160	汇顶科技	288	13,320.00	0.01
399	601969	海南矿业	2,000	13,160.00	0.01
400	688981	中芯国际	255	12,882.60	0.01
401	002714	牧原股份	300	12,645.00	0.01
402	002399	海普瑞	1,100	12,617.00	0.01
403	300207	欣旺达	700	11,424.00	0.01
404	603707	健友股份	800	10,800.00	0.01
405	001914	招商积余	700	10,535.00	0.01
406	603228	景旺电子	400	10,260.00	0.01
407	601568	北元集团	1,900	10,013.00	0.01
408	600623	华谊集团	1,600	9,968.00	0.01
409	600153	建发股份	900	9,819.00	0.00

410	600171	上海贝岭	500	9,125.00	0.00
411	000967	盈峰环境	1,800	9,090.00	0.00
412	000402	金融街	1,900	8,588.00	0.00
413	600893	航发动力	200	8,452.00	0.00
414	603456	九洲药业	300	8,214.00	0.00
415	601187	厦门银行	1,600	8,032.00	0.00
416	601139	深圳燃气	1,100	8,019.00	0.00
417	600511	国药股份	200	7,770.00	0.00
418	600350	山东高速	1,200	7,644.00	0.00
419	002110	三钢闽光	1,800	7,596.00	0.00
420	600848	上海临港	600	7,170.00	0.00
421	002653	海思科	300	7,080.00	0.00
422	601778	晶科科技	1,400	6,916.00	0.00
423	600655	豫园股份	1,000	6,860.00	0.00
424	603267	鸿远电子	100	6,530.00	0.00
425	600517	国网英大	1,100	6,270.00	0.00
426	000425	徐工机械	900	6,093.00	0.00
427	601666	平煤股份	800	6,032.00	0.00
428	002203	海亮股份	500	6,005.00	0.00
429	600409	三友化工	1,100	5,995.00	0.00
430	000598	兴蓉环境	1,100	5,973.00	0.00
431	600926	杭州银行	500	5,875.00	0.00
432	600050	中国联通	1,200	5,760.00	0.00
433	600167	联美控股	800	5,576.00	0.00
434	300482	万孚生物	200	5,326.00	0.00
435	300568	星源材质	300	5,157.00	0.00
436	002690	美亚光电	200	5,150.00	0.00
437	002738	中矿资源	100	5,094.00	0.00
438	688289	圣湘生物	300	5,052.00	0.00
439	603826	坤彩科技	100	5,000.00	0.00
440	603156	养元饮品	200	4,940.00	0.00
441	300395	菲利华	100	4,920.00	0.00
442	000559	万向钱潮	900	4,905.00	0.00
443	600299	安迪苏	600	4,782.00	0.00
444	600282	南钢股份	1,400	4,718.00	0.00
445	603799	华友钴业	100	4,591.00	0.00
446	002081	金螳螂	1,000	4,510.00	0.00
447	600867	通化东宝	400	4,176.00	0.00
448	600160	巨化股份	300	4,134.00	0.00
449	600378	昊华科技	100	3,764.00	0.00
450	002563	森马服饰	600	3,732.00	0.00
451	000031	大悦城	1,000	3,660.00	0.00
452	600298	安琪酵母	100	3,621.00	0.00

453	300450	先导智能	100	3,617.00	0.00
454	600808	马钢股份	1,400	3,598.00	0.00
455	601628	中国人寿	100	3,496.00	0.00
456	000785	居然之家	900	3,429.00	0.00
457	601611	中国核建	400	3,380.00	0.00
458	601828	美凯龙	700	3,353.00	0.00
459	000869	张裕 A	100	3,066.00	0.00
460	600126	杭钢股份	700	3,038.00	0.00
461	600967	内蒙一机	300	3,030.00	0.00
462	603712	七一二	100	3,021.00	0.00
463	601319	中国人保	500	2,920.00	0.00
464	600233	圆通速递	200	2,912.00	0.00
465	002507	涪陵榨菜	129	2,361.99	0.00
466	601016	节能风电	600	2,202.00	0.00
467	600416	湘电股份	100	1,909.00	0.00
468	600803	新奥股份	100	1,898.00	0.00
469	000959	首钢股份	500	1,750.00	0.00
470	603056	德邦股份	100	1,542.00	0.00
471	600667	太极实业	200	1,452.00	0.00
472	000937	冀中能源	200	1,276.00	0.00
473	600028	中国石化	200	1,272.00	0.00
474	002155	湖南黄金	100	1,220.00	0.00
474	000563	陕国投 A	400	1,220.00	0.00
476	600019	宝钢股份	200	1,124.00	0.00
477	002958	青农商行	400	1,088.00	0.00
478	002185	华天科技	100	920.00	0.00
479	601005	重庆钢铁	600	840.00	0.00
480	600297	广汇汽车	400	832.00	0.00
481	601857	中国石油	100	747.00	0.00
482	002249	大洋电机	100	570.00	0.00
483	601158	重庆水务	100	556.00	0.00
484	600704	物产中大	100	494.00	0.00
485	600507	方大特钢	100	463.00	0.00
486	601992	金隅集团	200	436.00	0.00
487	002936	郑州银行	100	230.00	0.00
488	600022	山东钢铁	100	142.00	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	301043	绿岛风	24,300.00	776,871.00	0.39
2	002839	张家港行	180,500.00	763,515.00	0.39

3	300634	彩讯股份	28,400.00	749,760.00	0.38
4	300908	仲景食品	11,400.00	516,990.00	0.26
5	300844	山水比德	15,700.00	457,498.00	0.23
6	301097	天益医疗	8,500.00	406,555.00	0.21
7	603345	安井食品	2,700.00	396,360.00	0.20
8	603323	苏农银行	90,700.00	381,847.00	0.19
9	301106	骏成科技	10,500.00	374,010.00	0.19
10	002991	甘源食品	3,700.00	283,790.00	0.14
11	002807	江阴银行	74,100.00	273,429.00	0.14
12	600026	中远海能	21,200.00	267,968.00	0.14
13	600073	上海梅林	36,500.00	266,450.00	0.14
14	300767	震安科技	8,900.00	225,704.00	0.11
15	600573	惠泉啤酒	17,900.00	212,115.00	0.11
16	601916	浙商银行	78,970.00	208,480.80	0.11
17	002541	鸿路钢构	7,200.00	207,432.00	0.11
18	000999	华润三九	3,400.00	206,244.00	0.10
19	301239	普瑞眼科	2,100.00	205,968.00	0.10
20	301086	鸿富瀚	3,550.00	179,985.00	0.09
21	301008	宏昌科技	6,200.00	174,406.00	0.09
22	002603	以岭药业	6,300.00	161,847.00	0.08
23	600583	海油工程	27,100.00	158,535.00	0.08
24	605300	佳禾食品	7,200.00	156,528.00	0.08
25	600248	陕建股份	32,600.00	155,502.00	0.08
26	300997	欢乐家	10,500.00	152,985.00	0.08
27	601311	骆驼股份	16,400.00	152,192.00	0.08
28	603198	迎驾贡酒	2,200.00	140,360.00	0.07
29	688037	芯源微	788.00	134,708.60	0.07
30	603871	嘉友国际	8,120.00	127,565.20	0.06
31	300294	博雅生物	3,400.00	123,352.00	0.06
32	300783	三只松鼠	6,300.00	123,102.00	0.06
33	600971	恒源煤电	15,700.00	122,303.00	0.06
34	688063	派能科技	600.00	118,950.00	0.06
35	301113	雅艺科技	4,000.00	115,240.00	0.06
36	002626	金达威	6,000.00	112,740.00	0.06
37	603855	华荣股份	4,200.00	111,720.00	0.06
38	002169	智光电气	13,400.00	111,086.00	0.06
39	601375	中原证券	28,400.00	105,364.00	0.05
40	600864	哈投股份	20,600.00	105,266.00	0.05
41	600651	飞乐音响	24,300.00	101,574.00	0.05
42	603979	金诚信	3,200.00	99,520.00	0.05
43	600897	厦门空港	4,800.00	99,312.00	0.05
44	002918	蒙娜丽莎	6,400.00	98,816.00	0.05
45	000028	国药一致	2,170.00	94,633.70	0.05

46	603950	长源东谷	6,300.00	94,248.00	0.05
47	688508	芯朋微	1,600.00	92,784.00	0.05
48	300745	欣锐科技	2,100.00	92,757.00	0.05
49	301291	明阳电气	2,820.00	91,489.26	0.05
50	300899	上海凯鑫	3,700.00	91,279.00	0.05
51	603605	珀莱雅	800.00	89,920.00	0.05
52	301486	致尚科技	1,533.00	88,392.78	0.04
53	002119	康强电子	6,800.00	88,196.00	0.04
54	002035	华帝股份	12,300.00	87,330.00	0.04
55	603197	保隆科技	1,600.00	86,800.00	0.04
56	002215	诺普信	11,400.00	85,614.00	0.04
57	002829	星网宇达	1,900.00	83,467.00	0.04
58	603179	新泉股份	1,900.00	83,391.00	0.04
59	301395	仁信新材	3,117.00	83,161.56	0.04
60	300153	科泰电源	9,900.00	82,962.00	0.04
61	301292	海科新源	4,076.00	81,479.24	0.04
62	300884	狄耐克	6,100.00	80,764.00	0.04
63	300354	东华测试	1,800.00	80,460.00	0.04
64	603505	金石资源	3,420.00	79,857.00	0.04
65	600459	贵研铂业	5,200.00	79,560.00	0.04
66	601595	上海电影	2,800.00	79,128.00	0.04
67	002351	漫步者	3,800.00	78,584.00	0.04
68	000426	兴业银锡	8,800.00	78,144.00	0.04
69	600420	国药现代	6,900.00	77,901.00	0.04
70	002320	海峡股份	12,800.00	77,312.00	0.04
71	002335	科华数据	2,100.00	75,495.00	0.04
72	301488	豪恩汽电	1,870.00	74,388.60	0.04
73	301210	金杨股份	1,447.00	73,961.31	0.04
74	002782	可立克	4,800.00	73,392.00	0.04
75	300452	山河药辅	4,100.00	71,504.00	0.04
76	600882	妙可蓝多	3,200.00	71,296.00	0.04
77	603515	欧普照明	3,500.00	71,050.00	0.04
78	600986	浙文互联	11,000.00	70,400.00	0.04
79	300693	盛弘股份	1,900.00	70,148.00	0.04
80	002446	盛路通信	7,300.00	68,985.00	0.03
81	600531	豫光金铅	10,900.00	68,670.00	0.03
82	002737	葵花药业	2,800.00	68,152.00	0.03
83	300286	安科瑞	1,800.00	68,148.00	0.03
84	600305	恒顺醋业	6,200.00	67,332.00	0.03
85	600688	上海石化	21,600.00	67,176.00	0.03
86	603283	赛腾股份	1,500.00	66,750.00	0.03
87	603306	华懋科技	2,300.00	66,746.00	0.03
88	301302	华如科技	1,800.00	66,240.00	0.03



89	000923	河钢资源	4,900.00	66,150.00	0.03
90	300804	广康生化	1,928.00	65,891.06	0.03
91	600129	太极集团	1,100.00	65,439.00	0.03
92	601811	新华文轩	4,600.00	65,136.00	0.03
93	688603	天承科技	1,182.00	65,010.00	0.03
94	301397	溯联股份	1,525.00	64,323.40	0.03
95	002580	圣阳股份	6,700.00	62,913.00	0.03
96	301099	雅创电子	1,200.00	62,472.00	0.03
97	002649	博彦科技	4,400.00	62,172.00	0.03
98	600478	科力远	8,700.00	62,118.00	0.03
99	603368	柳药集团	2,500.00	61,775.00	0.03
100	000603	盛达资源	5,100.00	61,659.00	0.03
101	002258	利尔化学	4,700.00	60,677.00	0.03
102	688608	恒玄科技	500.00	60,515.00	0.03
103	300740	水羊股份	3,900.00	60,450.00	0.03
104	000818	航锦科技	1,800.00	60,066.00	0.03
105	603997	继峰股份	4,200.00	60,060.00	0.03
106	002772	众兴菌业	5,300.00	59,890.00	0.03
107	603439	贵州三力	3,500.00	59,710.00	0.03
108	002847	盐津铺子	700.00	59,535.00	0.03
109	300915	海融科技	1,600.00	59,408.00	0.03
110	603126	中材节能	7,600.00	58,824.00	0.03
111	002660	茂硕电源	6,100.00	58,743.00	0.03
112	300852	四会富仕	1,400.00	58,044.00	0.03
113	601975	招商南油	20,200.00	57,772.00	0.03
114	000860	顺鑫农业	1,700.00	57,273.00	0.03
115	300567	精测电子	600.00	57,090.00	0.03
116	600216	浙江医药	5,200.00	56,940.00	0.03
117	600288	大恒科技	4,700.00	56,729.00	0.03
118	003013	地铁设计	3,100.00	56,575.00	0.03
119	603050	科林电气	3,500.00	56,385.00	0.03
120	600055	万东医疗	2,700.00	56,241.00	0.03
121	300484	蓝海华腾	4,000.00	56,240.00	0.03
122	301257	普蕊斯	1,000.00	56,200.00	0.03
123	300131	英唐智控	10,700.00	56,175.00	0.03
124	300881	盛德鑫泰	1,700.00	56,015.00	0.03
125	600933	爱柯迪	2,400.00	55,896.00	0.03
126	688266	泽璟制药	1,200.00	55,860.00	0.03
127	301202	朗威股份	2,129.00	54,970.78	0.03
128	603027	千禾味业	2,600.00	54,912.00	0.03
129	300833	浩洋股份	500.00	54,715.00	0.03
130	600559	老白干酒	2,200.00	53,922.00	0.03
131	002350	北京科锐	7,400.00	53,724.00	0.03

132	002984	森麒麟	1,700.00	53,482.00	0.03
133	002803	吉宏股份	2,600.00	53,196.00	0.03
134	002533	金杯电工	6,500.00	53,040.00	0.03
135	688589	力合微	1,300.00	52,962.00	0.03
136	002237	恒邦股份	4,800.00	52,272.00	0.03
137	300737	科顺股份	5,700.00	52,212.00	0.03
138	300738	奥飞数据	5,080.00	51,816.00	0.03
139	600138	中青旅	4,100.00	51,291.00	0.03
140	002815	崇达技术	4,100.00	51,045.00	0.03
141	301261	恒工精密	1,381.00	50,958.90	0.03
142	301024	霍普股份	2,000.00	50,900.00	0.03
143	002115	三维通信	7,800.00	50,856.00	0.03
144	002970	锐明技术	1,600.00	50,384.00	0.03
145	002245	蔚蓝锂芯	4,600.00	50,370.00	0.03
146	000862	银星能源	6,500.00	49,790.00	0.03
147	600702	舍得酒业	400.00	49,580.00	0.03
148	000032	深桑达 A	1,500.00	49,350.00	0.03
149	600664	哈药股份	14,900.00	49,021.00	0.02
150	688268	华特气体	600.00	48,438.00	0.02
151	600064	南京高科	7,200.00	47,592.00	0.02
152	600479	千金药业	4,200.00	47,376.00	0.02
153	000951	中国重汽	2,800.00	47,180.00	0.02
154	600267	海正药业	4,100.00	46,658.00	0.02
155	688138	清溢光电	2,200.00	46,442.00	0.02
156	300319	麦捷科技	5,400.00	46,224.00	0.02
157	002017	东信和平	3,500.00	45,885.00	0.02
158	601199	江南水务	6,700.00	45,694.00	0.02
159	000713	丰乐种业	5,200.00	45,656.00	0.02
160	300976	达瑞电子	900.00	45,630.00	0.02
161	600717	天津港	10,300.00	45,629.00	0.02
162	300581	晨曦航空	4,120.00	45,526.00	0.02
163	300041	回天新材	3,850.00	45,430.00	0.02
164	301117	佳缘科技	700.00	45,234.00	0.02
164	300342	天银机电	4,200.00	45,234.00	0.02
166	000848	承德露露	5,000.00	44,250.00	0.02
167	603328	依顿电子	5,300.00	43,884.00	0.02
168	601686	友发集团	6,400.00	43,776.00	0.02
169	300951	博硕科技	800.00	43,704.00	0.02
170	300869	康泰医学	1,900.00	43,624.00	0.02
171	002449	国星光电	4,900.00	43,561.00	0.02
172	002033	丽江股份	4,000.00	43,520.00	0.02
173	603278	大业股份	3,900.00	43,485.00	0.02
174	003026	中晶科技	1,100.00	43,263.00	0.02

175	688019	安集科技	260.00	42,855.80	0.02
176	601333	广深铁路	10,800.00	42,768.00	0.02
177	001209	洪兴股份	2,400.00	42,744.00	0.02
178	603690	至纯科技	1,220.00	42,504.80	0.02
179	300762	上海瀚讯	3,600.00	42,372.00	0.02
180	600562	国睿科技	2,600.00	42,120.00	0.02
180	300853	申昊科技	1,200.00	42,120.00	0.02
182	000627	天茂集团	14,000.00	42,000.00	0.02
183	002248	华东数控	4,300.00	41,925.00	0.02
184	300133	华策影视	5,900.00	41,831.00	0.02
185	000823	超声电子	4,400.00	41,712.00	0.02
186	688233	神工股份	1,300.00	41,054.00	0.02
187	600639	浦东金桥	3,300.00	40,953.00	0.02
188	300785	值得买	1,550.00	40,579.00	0.02
189	000921	海信家电	1,500.00	40,425.00	0.02
190	003000	劲仔食品	3,200.00	40,288.00	0.02
191	603028	赛福天	3,400.00	40,188.00	0.02
192	600850	电科数字	1,700.00	40,103.00	0.02
193	002158	汉钟精机	1,600.00	39,936.00	0.02
194	600748	上实发展	10,100.00	39,895.00	0.02
195	000719	中原传媒	3,400.00	39,780.00	0.02
196	601028	玉龙股份	3,700.00	39,775.00	0.02
197	601566	九牧王	3,300.00	39,666.00	0.02
198	300856	科思股份	500.00	39,385.00	0.02
199	600125	铁龙物流	6,500.00	39,260.00	0.02
200	600360	华微电子	5,700.00	39,216.00	0.02
201	301004	嘉益股份	1,000.00	38,800.00	0.02
202	300773	拉卡拉	2,200.00	38,368.00	0.02
203	002913	奥士康	1,000.00	38,180.00	0.02
204	605388	均瑶健康	3,000.00	38,130.00	0.02
205	600977	中国电影	2,700.00	37,935.00	0.02
206	002190	成飞集成	1,700.00	37,638.00	0.02
207	603919	金徽酒	1,600.00	37,568.00	0.02
208	002402	和而泰	2,200.00	37,356.00	0.02
209	002987	京北方	1,700.00	37,264.00	0.02
210	603068	博通集成	1,300.00	37,206.00	0.02
211	600201	生物股份	3,900.00	37,089.00	0.02
212	300671	富满微	900.00	36,774.00	0.02
213	601908	京运通	6,000.00	36,300.00	0.02
214	300226	上海钢联	1,120.00	36,288.00	0.02
215	300623	捷捷微电	2,000.00	36,240.00	0.02
216	301076	新瀚新材	1,845.00	36,198.90	0.02
217	002612	朗姿股份	1,500.00	35,670.00	0.02

218	301001	凯淳股份	1,300.00	35,581.00	0.02
219	600488	津药药业	6,300.00	35,406.00	0.02
220	300624	万兴科技	300.00	35,145.00	0.02
221	000582	北部湾港	4,600.00	34,960.00	0.02
222	688023	安恒信息	200.00	34,942.00	0.02
223	603551	奥普家居	2,700.00	34,911.00	0.02
224	600312	平高电气	2,800.00	34,692.00	0.02
225	603066	音飞储存	2,900.00	34,539.00	0.02
226	000650	仁和药业	5,600.00	34,384.00	0.02
227	300047	天源迪科	4,200.00	34,188.00	0.02
227	300872	天阳科技	2,200.00	34,188.00	0.02
229	300936	中英科技	1,000.00	33,740.00	0.02
230	600285	羚锐制药	2,100.00	33,726.00	0.02
231	601222	林洋能源	4,100.00	33,579.00	0.02
232	300691	联合光电	1,900.00	33,478.00	0.02
233	002434	万里扬	3,700.00	33,115.00	0.02
234	002093	国脉科技	3,900.00	32,916.00	0.02
235	688686	奥普特	200.00	32,896.00	0.02
236	000913	钱江摩托	1,800.00	32,814.00	0.02
237	002655	共达电声	2,500.00	32,475.00	0.02
238	603129	春风动力	200.00	32,380.00	0.02
239	603636	南威软件	2,200.00	32,274.00	0.02
240	600603	广汇物流	4,600.00	32,016.00	0.02
240	300213	佳讯飞鸿	4,800.00	32,016.00	0.02
242	002698	博实股份	1,800.00	31,482.00	0.02
243	603985	恒润股份	1,500.00	31,455.00	0.02
244	601890	亚星锚链	2,700.00	31,266.00	0.02
245	002212	天融信	3,200.00	31,040.00	0.02
246	002275	桂林三金	1,700.00	30,617.00	0.02
247	600993	马应龙	1,100.00	30,591.00	0.02
248	300659	中孚信息	1,500.00	30,480.00	0.02
249	300982	苏文电能	500.00	30,280.00	0.02
250	300906	日月明	1,200.00	30,144.00	0.02
251	300796	贝斯美	2,500.00	30,075.00	0.02
252	300541	先进数通	2,300.00	29,969.00	0.02
253	300870	欧陆通	500.00	29,965.00	0.02
254	688088	虹软科技	700.00	29,925.00	0.02
255	300465	高伟达	3,000.00	29,790.00	0.02
256	300428	立中集团	1,291.00	29,770.46	0.02
257	002712	思美传媒	4,500.00	29,520.00	0.01
258	000819	岳阳兴长	1,500.00	29,370.00	0.01
259	000561	烽火电子	2,500.00	28,925.00	0.01
260	002148	北纬科技	4,700.00	28,670.00	0.01

261	300766	每日互动	1,700.00	28,492.00	0.01
262	300835	龙磁科技	900.00	28,242.00	0.01
263	688122	西部超导	500.00	27,865.00	0.01
264	002467	二六三	5,600.00	27,832.00	0.01
265	600888	新疆众和	3,500.00	27,720.00	0.01
265	603533	掌阅科技	1,000.00	27,720.00	0.01
267	603063	禾望电气	900.00	27,675.00	0.01
268	600190	锦州港	9,200.00	27,600.00	0.01
269	600633	浙数文化	1,700.00	27,557.00	0.01
270	002559	亚威股份	3,100.00	27,528.00	0.01
271	601019	山东出版	3,000.00	27,510.00	0.01
272	300415	伊之密	1,400.00	26,880.00	0.01
273	300046	台基股份	1,600.00	26,832.00	0.01
274	300779	惠城环保	500.00	26,645.00	0.01
275	600756	浪潮软件	1,600.00	26,592.00	0.01
276	300389	艾比森	1,300.00	26,481.00	0.01
277	605599	菜百股份	2,000.00	26,420.00	0.01
278	002912	中新赛克	600.00	26,406.00	0.01
279	300295	三六五网	2,100.00	25,977.00	0.01
280	300622	博士眼镜	1,100.00	25,960.00	0.01
281	301061	匠心家居	700.00	25,865.00	0.01
282	600320	振华重工	6,900.00	25,737.00	0.01
283	688139	海尔生物	500.00	25,735.00	0.01
284	600054	黄山旅游	2,000.00	25,600.00	0.01
285	603083	剑桥科技	400.00	25,156.00	0.01
286	300672	国科微	300.00	25,005.00	0.01
287	600206	有研新材	1,900.00	24,966.00	0.01
288	600780	通宝能源	2,400.00	24,840.00	0.01
289	600641	万业企业	1,300.00	24,817.00	0.01
290	300674	宇信科技	1,400.00	24,752.00	0.01
291	600123	兰花科创	3,020.00	24,703.60	0.01
292	600237	铜峰电子	3,000.00	24,690.00	0.01
293	300184	力源信息	4,800.00	24,096.00	0.01
294	002400	省广集团	5,000.00	24,050.00	0.01
295	600246	万通发展	4,200.00	24,024.00	0.01
296	600831	广电网络	4,000.00	24,000.00	0.01
297	300655	晶瑞电材	1,200.00	23,892.00	0.01
298	300873	海晨股份	1,200.00	23,868.00	0.01
299	300523	辰安科技	1,000.00	23,860.00	0.01
300	002997	瑞鹤模具	800.00	23,784.00	0.01
301	002727	一心堂	900.00	23,760.00	0.01
302	002234	民和股份	1,300.00	23,673.00	0.01
303	603466	风语筑	1,700.00	23,630.00	0.01

303	300777	中简科技	500.00	23,630.00	0.01
305	000560	我爱我家	8,900.00	23,585.00	0.01
306	605089	味知香	600.00	23,580.00	0.01
307	600728	佳都科技	3,400.00	23,562.00	0.01
308	600658	电子城	4,200.00	23,226.00	0.01
309	300579	数字认证	800.00	23,120.00	0.01
310	002461	珠江啤酒	2,600.00	22,906.00	0.01
311	601208	东材科技	1,800.00	22,860.00	0.01
312	000863	三湘印象	6,300.00	22,743.00	0.01
313	300531	优博讯	1,600.00	22,624.00	0.01
314	603699	纽威股份	1,500.00	22,320.00	0.01
315	603896	寿仙谷	500.00	22,150.00	0.01
316	300245	天玑科技	2,300.00	21,965.00	0.01
317	601069	西部黄金	1,700.00	21,828.00	0.01
318	603232	格尔软件	1,500.00	21,810.00	0.01
319	002941	新疆交建	1,400.00	21,672.00	0.01
320	300360	炬华科技	1,200.00	21,456.00	0.01
321	603123	翠微股份	2,200.00	21,428.00	0.01
322	000049	德赛电池	600.00	21,168.00	0.01
322	000607	华媒控股	4,200.00	21,168.00	0.01
324	688333	铂力特	200.00	21,148.00	0.01
325	300377	赢时胜	2,600.00	21,060.00	0.01
326	605168	三人行	245.00	21,055.30	0.01
327	300857	协创数据	800.00	21,024.00	0.01
328	300571	平治信息	600.00	20,976.00	0.01
329	603566	普莱柯	900.00	20,925.00	0.01
330	000969	安泰科技	2,200.00	20,834.00	0.01
331	300546	雄帝科技	1,130.00	20,825.90	0.01
332	301286	侨源股份	700.00	20,650.00	0.01
333	300772	运达股份	1,600.00	20,608.00	0.01
334	600198	大唐电信	3,000.00	20,550.00	0.01
335	601212	白银有色	7,500.00	20,400.00	0.01
336	300666	江丰电子	300.00	20,388.00	0.01
337	600456	宝钛股份	600.00	20,304.00	0.01
338	002051	中工国际	1,700.00	20,281.00	0.01
339	000403	派林生物	1,000.00	19,960.00	0.01
340	600757	长江传媒	2,300.00	19,780.00	0.01
341	002235	安妮股份	2,900.00	19,517.00	0.01
342	601399	国机重装	6,100.00	19,398.00	0.01
343	688180	君实生物	500.00	19,270.00	0.01
344	300802	矩子科技	800.00	19,256.00	0.01
345	002421	达实智能	5,400.00	19,008.00	0.01
346	002583	海能达	3,200.00	18,592.00	0.01

347	300827	上能电气	515.00	18,565.75	0.01
348	600425	青松建化	4,200.00	18,564.00	0.01
349	002174	游族网络	1,100.00	18,480.00	0.01
350	600872	中炬高新	500.00	18,395.00	0.01
351	603096	新经典	900.00	18,324.00	0.01
352	300616	尚品宅配	900.00	18,252.00	0.01
353	603005	晶方科技	900.00	18,180.00	0.01
354	600116	三峡水利	2,000.00	18,160.00	0.01
355	002820	桂发祥	1,600.00	18,144.00	0.01
356	603757	大元泵业	600.00	17,904.00	0.01
357	300542	新晨科技	1,500.00	17,880.00	0.01
358	300231	银信科技	2,000.00	17,820.00	0.01
359	003021	兆威机电	200.00	17,546.00	0.01
360	600483	福能股份	1,500.00	17,325.00	0.01
361	688472	阿特斯	1,009.00	17,193.36	0.01
362	000530	冰山冷热	3,100.00	17,174.00	0.01
363	688361	中科飞测	263.00	17,008.21	0.01
364	300786	国林科技	900.00	16,911.00	0.01
365	000948	南天信息	1,000.00	16,900.00	0.01
366	600981	汇鸿集团	5,800.00	16,820.00	0.01
367	300768	迪普科技	1,000.00	16,570.00	0.01
368	000065	北方国际	1,100.00	16,522.00	0.01
369	300183	东软载波	1,000.00	16,510.00	0.01
370	600185	格力地产	2,400.00	16,464.00	0.01
371	603888	新华网	500.00	16,410.00	0.01
372	000735	罗牛山	2,500.00	16,350.00	0.01
373	600992	贵绳股份	900.00	16,182.00	0.01
374	300468	四方精创	1,500.00	16,065.00	0.01
375	002858	力盛体育	700.00	16,058.00	0.01
376	002943	宇晶股份	500.00	15,950.00	0.01
377	688556	高测股份	300.00	15,942.00	0.01
378	603518	锦泓集团	1,400.00	15,890.00	0.01
379	600657	信达地产	3,700.00	15,651.00	0.01
380	002611	东方精工	2,700.00	15,498.00	0.01
381	600750	江中药业	700.00	15,351.00	0.01
382	600229	城市传媒	1,800.00	15,336.00	0.01
383	688128	中国电研	600.00	15,300.00	0.01
384	002073	软控股份	2,300.00	15,226.00	0.01
385	300534	陇神戎发	1,500.00	15,180.00	0.01
386	300607	拓斯达	1,000.00	15,030.00	0.01
387	300560	中富通	800.00	14,800.00	0.01
388	600057	厦门象屿	1,700.00	14,790.00	0.01
389	301129	瑞纳智能	200.00	14,734.00	0.01

390	002990	盛视科技	400.00	14,720.00	0.01
391	002675	东诚药业	1,000.00	14,710.00	0.01
392	300702	天宇股份	600.00	14,562.00	0.01
393	300399	天利科技	1,100.00	14,465.00	0.01
394	003008	开普检测	500.00	14,365.00	0.01
395	000779	甘咨询	1,300.00	14,248.00	0.01
396	002866	传艺科技	500.00	14,170.00	0.01
397	600880	博瑞传播	2,500.00	14,000.00	0.01
397	300609	汇纳科技	500.00	14,000.00	0.01
399	002576	通达动力	700.00	13,993.00	0.01
400	603305	旭升集团	500.00	13,935.00	0.01
401	002204	大连重工	2,700.00	13,878.00	0.01
402	603032	德新科技	400.00	13,816.00	0.01
403	300770	新媒股份	300.00	13,758.00	0.01
404	300323	华灿光电	2,000.00	13,700.00	0.01
405	600720	祁连山	1,200.00	13,644.00	0.01
406	603300	华铁应急	2,500.00	13,625.00	0.01
407	603035	常熟汽饰	700.00	13,601.00	0.01
408	002537	海联金汇	2,000.00	13,460.00	0.01
409	603929	亚翔集成	800.00	13,440.00	0.01
410	300993	玉马遮阳	1,170.00	13,396.50	0.01
411	600037	歌华有线	1,600.00	13,296.00	0.01
412	000543	皖能电力	2,000.00	13,200.00	0.01
413	300194	福安药业	3,400.00	13,192.00	0.01
414	600560	金白天正	900.00	13,176.00	0.01
415	000586	汇源通信	900.00	13,167.00	0.01
416	600063	皖维高新	2,600.00	13,130.00	0.01
417	600586	金晶科技	1,700.00	13,124.00	0.01
418	600476	湘邮科技	800.00	13,080.00	0.01
419	002609	捷顺科技	1,100.00	12,826.00	0.01
420	600121	郑州煤电	2,700.00	12,690.00	0.01
421	002057	中钢天源	1,200.00	12,600.00	0.01
422	300863	卡倍亿	200.00	12,582.00	0.01
423	002345	潮宏基	1,600.00	12,576.00	0.01
424	300589	江龙船艇	800.00	12,536.00	0.01
425	300054	鼎龙股份	500.00	12,365.00	0.01
426	300890	翔丰华	300.00	12,330.00	0.01
427	002378	章源钨业	2,100.00	12,222.00	0.01
428	603867	新化股份	300.00	12,150.00	0.01
429	300538	同益股份	700.00	12,145.00	0.01
430	603508	思维列控	700.00	11,935.00	0.01
431	300708	聚灿光电	1,200.00	11,844.00	0.01
432	600552	凯盛科技	1,000.00	11,840.00	0.01



433	300371	汇中股份	900.00	11,790.00	0.01
434	300353	东土科技	900.00	11,709.00	0.01
435	600621	华鑫股份	1,100.00	11,693.00	0.01
436	600572	康恩贝	1,700.00	11,645.00	0.01
437	300129	泰胜风能	1,200.00	11,508.00	0.01
438	688562	航天软件	511.00	11,400.41	0.01
439	600776	东方通信	800.00	11,400.00	0.01
440	601999	出版传媒	1,700.00	11,390.00	0.01
441	300638	广和通	500.00	11,340.00	0.01
442	300809	华辰装备	500.00	11,180.00	0.01
443	603383	顶点软件	200.00	11,084.00	0.01
444	002023	海特高新	1,200.00	11,040.00	0.01
445	300181	佐力药业	900.00	10,989.00	0.01
446	300732	设研院	1,100.00	10,945.00	0.01
447	301310	鑫宏业	167.00	10,926.81	0.01
448	605123	派克新材	100.00	10,865.00	0.01
449	688582	芯动联科	266.00	10,820.88	0.01
450	300712	永福股份	300.00	10,650.00	0.01
451	600502	安徽建工	2,000.00	10,560.00	0.01
452	002117	东港股份	1,000.00	10,540.00	0.01
453	300586	美联新材	800.00	10,328.00	0.01
454	603186	华正新材	300.00	10,320.00	0.01
455	600110	诺德股份	1,400.00	10,136.00	0.01
456	300355	蒙草生态	2,900.00	10,121.00	0.01
457	688699	明微电子	200.00	10,064.00	0.01
458	000534	万泽股份	600.00	10,062.00	0.01
459	601519	大智慧	1,400.00	10,024.00	0.01
460	002163	海南发展	1,000.00	10,000.00	0.01
461	000409	云鼎科技	1,000.00	9,990.00	0.01
462	301399	英特科技	193.00	9,953.01	0.01
463	300925	法本信息	700.00	9,891.00	0.01
464	603606	东方电缆	200.00	9,806.00	0.00
465	600458	时代新材	800.00	9,592.00	0.00
466	002063	远光软件	1,100.00	9,548.00	0.00
467	000811	冰轮环境	600.00	9,456.00	0.00
468	688559	海目星	200.00	9,402.00	0.00
469	000888	峨眉山 A	800.00	9,168.00	0.00
470	688543	国科军工	171.00	9,071.55	0.00
471	600228	返利科技	900.00	9,054.00	0.00
472	002953	日丰股份	700.00	9,037.00	0.00
473	300429	强力新材	900.00	9,018.00	0.00
474	002137	实益达	1,300.00	8,983.00	0.00
475	002170	芭田股份	1,300.00	8,931.00	0.00

476	002929	润建股份	200.00	8,682.00	0.00
477	301213	观想科技	200.00	8,620.00	0.00
478	300527	中船应急	900.00	8,550.00	0.00
479	688458	美芯晟	94.00	8,531.44	0.00
480	300882	万胜智能	300.00	8,514.00	0.00
481	300719	安达维尔	600.00	8,472.00	0.00
481	002205	国统股份	800.00	8,472.00	0.00
483	688418	震有科技	400.00	8,432.00	0.00
484	000836	富通信息	2,800.00	8,344.00	0.00
484	300248	新开普	800.00	8,344.00	0.00
486	600006	东风汽车	1,400.00	8,274.00	0.00
487	002445	中南文化	3,400.00	8,228.00	0.00
488	002272	川润股份	1,100.00	8,074.00	0.00
489	301383	天键股份	226.00	8,072.72	0.00
490	000886	海南高速	1,600.00	8,064.00	0.00
491	301225	恒勃股份	240.00	7,982.40	0.00
492	301262	海看股份	309.00	7,879.50	0.00
493	688523	航天环宇	329.00	7,846.65	0.00
494	300101	振芯科技	400.00	7,756.00	0.00
495	301295	美硕科技	215.00	7,755.05	0.00
496	600515	海南机场	1,900.00	7,714.00	0.00
497	300911	亿田智能	200.00	7,594.00	0.00
498	002091	江苏国泰	1,000.00	7,540.00	0.00
499	000428	华天酒店	1,800.00	7,524.00	0.00
500	300307	慈星股份	1,100.00	7,513.00	0.00
501	002253	川大智胜	500.00	7,510.00	0.00
502	600363	联创光电	200.00	7,420.00	0.00
503	688429	时创能源	289.00	7,378.17	0.00
504	002254	泰和新材	300.00	7,341.00	0.00
505	301355	南王科技	438.00	7,336.50	0.00
506	301332	德尔玛	527.00	7,235.71	0.00
507	000528	柳工	900.00	7,110.00	0.00
508	600587	新华医疗	200.00	7,066.00	0.00
509	600612	老凤祥	100.00	6,988.00	0.00
510	600395	盘江股份	1,000.00	6,950.00	0.00
511	000059	华锦股份	1,100.00	6,919.00	0.00
512	002181	粤传媒	1,400.00	6,916.00	0.00
513	301428	世纪恒通	224.00	6,854.40	0.00
514	300973	立高食品	100.00	6,842.00	0.00
515	600711	盛屯矿业	1,400.00	6,804.00	0.00
516	300582	英飞特	500.00	6,785.00	0.00
517	600846	同济科技	600.00	6,720.00	0.00
518	301305	朗坤环境	339.00	6,674.91	0.00

519	002560	通达股份	700.00	6,664.00	0.00
520	000715	中兴商业	900.00	6,651.00	0.00
521	300679	电连技术	200.00	6,610.00	0.00
522	002869	金溢科技	300.00	6,594.00	0.00
523	600120	浙江东方	1,700.00	6,511.00	0.00
524	003029	吉大正元	200.00	6,490.00	0.00
525	002489	浙江永强	1,600.00	6,480.00	0.00
526	000852	石化机械	900.00	6,471.00	0.00
527	688570	天玛智控	254.00	6,433.82	0.00
528	301376	致欧科技	280.00	6,302.80	0.00
529	301232	飞沃科技	107.00	6,250.94	0.00
530	603200	上海洗霸	300.00	6,249.00	0.00
531	605086	龙高股份	300.00	6,234.00	0.00
532	600059	古越龙山	600.00	6,228.00	0.00
533	601965	中国汽研	300.00	6,195.00	0.00
534	300481	濮阳惠成	300.00	6,168.00	0.00
535	002262	恩华药业	200.00	6,166.00	0.00
536	002469	三维化学	1,000.00	6,150.00	0.00
537	002127	南极电商	1,600.00	6,128.00	0.00
538	600685	中船防务	200.00	5,990.00	0.00
539	002243	力合科创	700.00	5,957.00	0.00
540	002697	红旗连锁	1,000.00	5,840.00	0.00
541	301323	新莱福	148.00	5,825.28	0.00
542	601952	苏垦农发	500.00	5,820.00	0.00
543	688631	莱斯信息	194.00	5,794.78	0.00
544	600738	丽尚国潮	1,100.00	5,742.00	0.00
545	300455	航天智装	500.00	5,725.00	0.00
546	000006	深振业 A	1,300.00	5,681.00	0.00
547	301170	锡南科技	160.00	5,588.80	0.00
548	301337	亚华电子	183.00	5,557.71	0.00
549	300687	赛意信息	200.00	5,556.00	0.00
550	002270	华明装备	500.00	5,475.00	0.00
551	300645	正元智慧	200.00	5,464.00	0.00
552	600605	汇通能源	300.00	5,460.00	0.00
553	688106	金宏气体	200.00	5,440.00	0.00
554	603599	广信股份	200.00	5,416.00	0.00
555	600133	东湖高新	800.00	5,272.00	0.00
556	603357	设计总院	500.00	5,250.00	0.00
557	301006	迈拓股份	200.00	5,230.00	0.00
558	002932	明德生物	200.00	5,178.00	0.00
559	300087	荃银高科	500.00	5,170.00	0.00
560	002903	宇环数控	200.00	5,124.00	0.00
561	603859	能科科技	100.00	5,113.00	0.00

562	600577	精达股份	1,200.00	5,064.00	0.00
563	300306	远方信息	400.00	5,044.00	0.00
564	002534	西子洁能	300.00	5,040.00	0.00
564	600491	龙元建设	1,000.00	5,040.00	0.00
566	300910	瑞丰新材	100.00	5,030.00	0.00
567	300451	创业慧康	600.00	5,028.00	0.00
568	603078	江化微	300.00	4,977.00	0.00
569	000555	神州信息	400.00	4,920.00	0.00
570	300803	指南针	100.00	4,859.00	0.00
571	600683	京投发展	800.00	4,848.00	0.00
572	300725	药石科技	100.00	4,843.00	0.00
573	300965	恒宇信通	100.00	4,734.00	0.00
574	601008	连云港	1,100.00	4,664.00	0.00
575	603399	吉翔股份	400.00	4,628.00	0.00
576	002544	普天科技	200.00	4,580.00	0.00
577	600571	信雅达	500.00	4,570.00	0.00
578	002805	丰元股份	200.00	4,336.00	0.00
579	600730	中国高科	700.00	4,333.00	0.00
580	600713	南京医药	800.00	4,296.00	0.00
581	600853	龙建股份	1,000.00	4,230.00	0.00
582	600629	华建集团	600.00	4,188.00	0.00
583	300379	东方通	200.00	4,114.00	0.00
584	000501	武商集团	400.00	3,956.00	0.00
585	000919	金陵药业	500.00	3,910.00	0.00
586	002344	海宁皮城	800.00	3,784.00	0.00
587	002458	益生股份	300.00	3,705.00	0.00
588	002159	三特索道	200.00	3,638.00	0.00
589	000927	中国铁物	1,300.00	3,614.00	0.00
590	600740	山西焦化	700.00	3,591.00	0.00
591	000899	赣能股份	400.00	3,568.00	0.00
592	300457	赢合科技	200.00	3,532.00	0.00
593	601860	紫金银行	1,400.00	3,514.00	0.00
594	002713	东易日盛	400.00	3,480.00	0.00
595	603683	晶华新材	300.00	3,471.00	0.00
596	002085	万丰奥威	500.00	3,465.00	0.00
597	002296	辉煌科技	400.00	3,440.00	0.00
598	603660	苏州科达	500.00	3,435.00	0.00
599	002819	东方中科	100.00	3,410.00	0.00
600	002318	久立特材	200.00	3,406.00	0.00
601	002993	奥海科技	100.00	3,392.00	0.00
602	300775	三角防务	100.00	3,378.00	0.00
603	601858	中国科传	100.00	3,360.00	0.00
604	002216	三全食品	200.00	3,116.00	0.00

605	300605	恒锋信息	200.00	3,032.00	0.00
606	000682	东方电子	300.00	2,916.00	0.00
607	000928	中钢国际	300.00	2,895.00	0.00
608	688365	光云科技	200.00	2,884.00	0.00
609	600386	北巴传媒	700.00	2,863.00	0.00
610	603860	中公高科	100.00	2,858.00	0.00
611	601801	皖新传媒	300.00	2,817.00	0.00
612	601677	明泰铝业	200.00	2,776.00	0.00
612	300349	金卡智能	200.00	2,776.00	0.00
614	002238	天威视讯	400.00	2,772.00	0.00
615	002011	盾安环境	200.00	2,766.00	0.00
616	000838	财信发展	700.00	2,744.00	0.00
617	001282	三联锻造	82.00	2,708.46	0.00
618	300650	太龙股份	200.00	2,692.00	0.00
619	600151	航天机电	300.00	2,673.00	0.00
620	603018	华设集团	300.00	2,625.00	0.00
621	600280	中央商场	1,000.00	2,580.00	0.00
622	605299	舒华体育	200.00	2,540.00	0.00
623	603131	上海沪工	200.00	2,502.00	0.00
624	002090	金智科技	200.00	2,498.00	0.00
625	603227	雪峰科技	300.00	2,484.00	0.00
626	605068	明新旭腾	100.00	2,446.00	0.00
627	300079	数码视讯	400.00	2,440.00	0.00
628	300448	浩云科技	400.00	2,392.00	0.00
629	301028	东亚机械	200.00	2,230.00	0.00
630	300525	博思软件	140.00	2,147.60	0.00
631	000901	航天科技	200.00	2,140.00	0.00
632	600158	中体产业	200.00	2,032.00	0.00
633	300504	天邑股份	100.00	2,007.00	0.00
634	002895	川恒股份	100.00	1,970.00	0.00
635	000048	京基智农	100.00	1,952.00	0.00
636	300292	吴通控股	500.00	1,950.00	0.00
637	300552	万集科技	100.00	1,946.00	0.00
638	001965	招商公路	200.00	1,920.00	0.00
639	603138	海量数据	100.00	1,904.00	0.00
640	603308	应流股份	100.00	1,830.00	0.00
641	000672	上峰水泥	200.00	1,826.00	0.00
642	300778	新城市	100.00	1,820.00	0.00
643	000906	浙商中拓	200.00	1,784.00	0.00
644	300615	欣天科技	100.00	1,769.00	0.00
645	002189	中光学	100.00	1,753.00	0.00
646	600313	农发种业	200.00	1,722.00	0.00
647	603220	中贝通信	100.00	1,705.00	0.00

648	601007	金陵饭店	200.00	1,704.00	0.00
649	300005	探路者	200.00	1,680.00	0.00
650	300208	青岛中程	200.00	1,656.00	0.00
651	002312	川发龙蟒	200.00	1,626.00	0.00
652	603630	拉芳家化	100.00	1,597.00	0.00
653	002226	江南化工	300.00	1,521.00	0.00
654	002968	新大正	100.00	1,511.00	0.00
655	603567	珍宝岛	100.00	1,496.00	0.00
656	601929	吉视传媒	800.00	1,472.00	0.00
657	600508	上海能源	100.00	1,468.00	0.00
658	600973	宝胜股份	300.00	1,455.00	0.00
659	601702	华峰铝业	100.00	1,368.00	0.00
660	000822	山东海化	200.00	1,362.00	0.00
661	300382	斯莱克	100.00	1,319.00	0.00
662	002139	拓邦股份	100.00	1,305.00	0.00
663	601099	太平洋	500.00	1,290.00	0.00
664	300590	移为通信	100.00	1,222.00	0.00
665	002549	凯美特气	100.00	1,150.00	0.00
666	000014	沙河股份	100.00	1,144.00	0.00
667	000966	长源电力	200.00	1,116.00	0.00
668	002194	武汉凡谷	100.00	1,093.00	0.00
669	600210	紫江企业	200.00	1,064.00	0.00
670	300608	思特奇	100.00	966.00	0.00
671	601001	晋控煤业	100.00	936.00	0.00
672	601678	滨化股份	200.00	928.00	0.00
673	002613	北玻股份	200.00	926.00	0.00
674	002606	大连电瓷	100.00	915.00	0.00
675	002561	徐家汇	100.00	880.00	0.00
676	300063	天龙集团	200.00	866.00	0.00
677	603687	大胜达	100.00	852.00	0.00
678	301119	正强股份	30.00	798.00	0.00
679	002746	仙坛股份	100.00	788.00	0.00
680	600731	湖南海利	100.00	777.00	0.00
681	000521	长虹美菱	100.00	764.00	0.00
681	603528	多伦科技	100.00	764.00	0.00
683	600496	精工钢构	200.00	746.00	0.00
684	300177	中海达	100.00	677.00	0.00
685	600354	敦煌种业	100.00	647.00	0.00
686	000498	山东路桥	100.00	642.00	0.00
687	300284	苏文科	100.00	600.00	0.00
688	002154	报喜鸟	100.00	552.00	0.00
689	000090	天健集团	100.00	504.00	0.00
690	600825	新华传媒	100.00	483.00	0.00

691	002219	新里程	100.00	452.00	0.00
692	300276	三丰智能	100.00	421.00	0.00
693	002342	巨力索具	100.00	410.00	0.00
694	000816	智慧农业	100.00	336.00	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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	600519	贵州茅台	9,004,509.00	4.57
2	688599	天合光能	6,258,411.26	3.17
3	600436	片仔癀	5,690,862.00	2.89
4	000338	潍柴动力	5,456,975.00	2.77
5	600900	长江电力	4,788,415.00	2.43
6	601225	陕西煤业	4,582,460.00	2.32
7	600028	中国石化	4,527,749.00	2.30
8	300316	晶盛机电	4,482,765.00	2.27
9	600309	万华化学	4,444,767.00	2.25
10	001979	招商蛇口	4,322,256.00	2.19
11	002601	龙佰集团	4,200,183.00	2.13
12	002594	比亚迪	4,172,129.00	2.12
13	601398	工商银行	3,975,166.00	2.02
14	600036	招商银行	3,843,056.00	1.95
15	300896	爱美客	3,683,108.00	1.87
16	600276	恒瑞医药	3,559,638.00	1.81
17	002142	宁波银行	3,485,968.00	1.77
18	600196	复星医药	3,485,135.00	1.77
19	002027	分众传媒	3,462,149.00	1.76
20	300782	卓胜微	3,441,529.02	1.75

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	600028	中国石化	4,892,712.80	2.48
2	000338	潍柴动力	4,289,814.00	2.18
3	600436	片仔癀	4,146,528.00	2.10
4	601225	陕西煤业	4,085,717.00	2.07
5	002601	龙佰集团	3,955,888.00	2.01
6	601398	工商银行	3,954,595.00	2.01

7	600900	长江电力	3,935,186.00	2.00
8	600309	万华化学	3,730,985.00	1.89
9	002594	比亚迪	3,618,530.00	1.84
10	001979	招商蛇口	3,591,339.00	1.82
11	688599	天合光能	3,515,656.83	1.78
12	300782	卓胜微	3,325,276.00	1.69
13	300316	晶盛机电	3,243,709.00	1.65
14	600196	复星医药	3,110,206.00	1.58
15	601688	华泰证券	3,041,737.00	1.54
16	002142	宁波银行	2,903,162.59	1.47
17	300124	汇川技术	2,803,358.00	1.42
18	600570	恒生电子	2,686,237.00	1.36
19	600887	伊利股份	2,684,521.00	1.36
20	600926	杭州银行	2,630,355.00	1.33

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	778,405,779.90
卖出股票收入（成交）总额	586,019,341.98

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	35,813.22	0.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	35,813.22	0.02

#### 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

金额单位：人民币元



序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	127086	恒邦转债	311	31,102.59	0.02
2	123195	蓝晓转 02	20	2,771.92	0.00
3	127087	星帅转 2	15	1,500.17	0.00
4	123190	道氏转 02	4	438.54	0.00
5	-	-	-	-	-

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	557,892.00
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-

5	应收申购款	518,145.99
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,076,037.99

#### 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	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
华夏中证 800 指数增强 A	1,391	63,631.04	994,116.35	1.12%	87,516,660.52	98.88%
华夏中证 800 指数增强 C	2,257	52,978.07	5,201,176.11	4.35%	114,370,316.66	95.65%
合计	3,648	57,040.10	6,195,292.46	2.98%	201,886,977.18	97.02%

### 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 800 指数增强 A	-	-
	华夏中证 800 指数增强 C	-	-
	合计	-	-

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 800 指数增强 A	0
	华夏中证 800 指数增强 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	华夏中证 800 指数增强 A	0
	华夏中证 800 指数增强 C	0
	合计	0

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华夏中证 800 指数增强 A	华夏中证 800 指数增强 C
基金合同生效日（2023 年 3 月 30 日）基金份额总额	99,110,008.26	140,198,107.68
基金合同生效日起至报告期末基金总申购份额	235,340.86	4,517,292.75
减：基金合同生效日起至报告期末基金总赎回份额	10,834,572.25	25,143,907.66
基金合同生效日起至报告期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	88,510,776.87	119,571,492.77

注：本基金合同于 2023 年 3 月 30 日生效。

## §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。

2023 年 3 月，项寅同志担任上海银行股份有限公司资产托管部副总经理职务，上述人事变动已进行备案、公告。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期末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	
东海证券	3	1,361,531,037.99	100.00%	450,740.17	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本基金合同于 2023 年 3 月 30 日生效，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。

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
东海证券	-	-	-	-	-	-	-	-

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	华夏中证 800 指数增强型证券投资基金基金合同生效公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-03-31
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	2023-05-27
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	2023-05-31
4	华夏中证 800 指数增强型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换、定期定额申购业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-06-16

## §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 800 指数增强型证券投资基金基金合同》；
- 3、《华夏中证 800 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