

**华夏创业板交易型开放式指数
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：中国银行股份有限公司

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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 8 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	1
§2 基金简介.....	3
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	4
3.1 主要会计数据和财务指标.....	4
3.2 基金净值表现.....	4
§4 管理人报告.....	5
§5 托管人报告.....	10
§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.....	12
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	13
6.4 报表附注.....	14
§7 投资组合报告.....	45
7.1 期末基金资产组合情况.....	45
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	45
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.....	46
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	49
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	51
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.....	51
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.....	51
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.....	51
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.....	51
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	51
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	51
7.12 投资组合报告附注.....	51
§8 基金份额持有人信息.....	52
§9 开放式基金份额变动.....	53
§10 重大事件揭示.....	53
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	56
§12 备查文件目录.....	56

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华夏创业板交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	华夏创业板 ETF
场内简称	创业板 ETF 华夏
基金主代码	159957
交易代码	159957
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2017 年 12 月 8 日
基金管理人	华夏基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	332,784,560.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2018 年 1 月 4 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	主要投资策略包括组合复制策略、替代性策略、存托凭证投资策略、股指期货投资策略、股票期权投资策略等。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为创业板指数。
风险收益特征	本基金属于股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股，在股票基金中属于较高风险、较高收益的产品。

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	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李彬	许俊
	联系电话	400-818-6666	010-66596688
	电子邮箱	service@ChinaAMC.com	fxjd_hq@bank-of-china.com
客户服务电话		400-818-6666	95566
传真		010-63136700	010-66594942
注册地址		北京市顺义区安庆大街甲3号院	北京市西城区复兴门内大街1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	北京市西城区复兴门内大街1号
邮政编码		100033	100818
法定代表人		杨明辉	葛海蛟

2.5 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
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	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号
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）
本期已实现收益	-22,778,345.93
本期利润	-24,625,713.74
加权平均基金份额本期利润	-0.0881
本期加权平均净值利润率	-5.90%
本期基金份额净值增长率	-5.04%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023年6月30日)
期末可供分配利润	137,811,952.91
期末可供分配基金份额利润	0.4141
期末基金资产净值	470,596,512.91
期末基金份额净值	1.4141
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023年6月30日)
基金份额累计净值增长率	41.41%

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

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	1.22%	1.37%	0.98%	1.37%	0.24%	0.00%

月						
过去三个月	-7.08%	1.12%	-7.69%	1.12%	0.61%	0.00%
过去六个月	-5.04%	1.08%	-5.61%	1.08%	0.57%	0.00%
过去一年	-20.39%	1.29%	-21.19%	1.30%	0.80%	-0.01%
过去三年	-2.64%	1.68%	-9.15%	1.69%	6.51%	-0.01%
自基金合同生效起至今	41.41%	1.70%	24.65%	1.72%	16.76%	-0.02%

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

华夏创业板交易型开放式指数证券投资基金

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

(2017 年 12 月 8 日至 2023 年 6 月 30 日)



§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		
严筱娴	本基金的 基金经理	2021-07-19	-	8 年	硕士。2015 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创业板指数，创业板指数是深交所多层次资本市场的核心指数之一，成份股由最具代表性的 100 家创业板上市企业股票组成，反映了创业板在市场层面的运行情况。创业板公司集中分布于电子信息、环保、新材料、新能源、高端制造、生物医药等战略性新兴产业。本基金主要采用完全复制策略及适当的替代性策略以更好地跟踪标的指数，实现基金投资目标。

上半年，海外方面，美国市场受到通胀、银行风险、债务上限等多重扰动，货币政策经历了从

停止加息到加速加息再到预期降息的摇摆。国内方面，年初经济经历了一段强劲复苏，二季度经济修复的斜率有所放缓，整体企稳回升的势头仍在继续。经济数据方面，经济增长整体回升，结构上看服务业修复好于制造业，消费有所企稳，基建投资和制造业投资维持韧性，地产投资仍有待恢复。

市场方面，美股纳斯达克在加息、通胀、银行风险和债务上限等诸多扰动下仍创出新高，而国内方面，在宽松、政策支持、疫情政策优化后修复等预期中，A 股和港股市场却连续下探，创出年内新低。A 股市场多数指数呈 M 形走势，风格上小盘相对占优。行业方面，人工智能产业趋势催化下的通信、传媒板块领涨市场；旅游、地产等板块领跌市场。

基金投资运作方面，报告期内，本基金在做好跟踪标的指数的基础上，认真应对投资者日常申购、赎回、成份股调整和转融通证券出借等工作。

为促进本基金的市场流动性提高和平稳运行，经深圳证券交易所同意，部分证券公司被确认为本基金的流动性服务商。目前，本基金的流动性服务商为海通证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、光大证券股份有限公司等。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2023 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.4141 元，本报告期份额净值增长率为-5.04%，同期业绩比较基准增长率-5.61%。本基金本报告期跟踪偏离度为+0.57%，与业绩比较基准产生偏离的主要原因为成份股分红、日常运作费用、指数结构调整、申购赎回等产生的差异。

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，国际方面，美国通胀粘性仍然突出，预计美联储可能会维持紧缩，年内降息概率较低。国内方面，尽管外部环境更趋复杂严峻，国内经济发展也面临压力，但我国经济长期向好的基本面没有改变。随着促进发展的积极因素累积增多，稳增长、稳就业、稳物价等政策效应逐步显现，经济有望继续恢复向好。

市场方面，随着政策效果逐步显现，经济基本面改善将推动企业盈利的改善。当前 A 股、港股估值水平仍然具备长期吸引力，股市虽短期有所调整，但经济持续复苏将为市场信心修复提供有力支撑，对下半年仍可以乐观多一点。继续看好前期受疫情负面影响较大、后续需求修复空间较为确定的旅游等消费类行业；持续关注高景气、有政策支持的制造成长赛道，包括高端制造、低碳经济等。

本基金将会根据基金合同要求，在紧密跟踪标的指数的基础上，做好相关投资工作。

珍惜基金份额持有人的每一份投资和每一份信任，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遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在华夏创业板交易型开放式指数证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§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：华夏创业板交易型开放式指数证券投资基金

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	1,673,981.49	2,919,232.10
结算备付金		89,477.44	12,821.35
存出保证金		8,572.86	2,655.45
交易性金融资产	6.4.7.2	469,254,828.73	330,764,903.01
其中：股票投资		469,254,828.73	330,764,903.01
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		493.30	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	4,034.29	4,509.35
资产总计		471,031,388.11	333,704,121.26
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		7,099.63	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		192,159.59	140,949.05
应付托管费		38,431.94	28,189.81
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-

应交税费		369.00	663.54
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	196,815.04	296,458.56
负债合计		434,875.20	466,260.96
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	332,784,560.00	223,784,560.00
未分配利润	6.4.7.8	137,811,952.91	109,453,300.30
净资产合计		470,596,512.91	333,237,860.30
负债和净资产总计		471,031,388.11	333,704,121.26

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.4141 元，基金份额总额 332,784,560.00 份。

6.2 利润表

会计主体：华夏创业板交易型开放式指数证券投资基金

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		-23,231,310.87	-37,932,738.73
1.利息收入		65,410.22	35,264.11
其中：存款利息收入	6.4.7.9	6,587.83	5,059.23
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		58,822.39	30,204.88
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-21,455,638.56	-6,272,288.19
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-24,371,827.02	-7,549,067.79
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	11,423.75	38,802.78
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	-	-
股利收益	6.4.7.14	2,904,764.71	1,237,976.82
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	-1,847,367.81	-31,692,970.60
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	6,285.28	-2,744.05
减：二、营业总支出		1,394,402.87	1,067,047.87
1.管理人报酬		1,031,875.84	759,401.60

2.托管费		206,375.16	151,880.40
3.销售服务费		-	-
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		211.94	108.82
8.其他费用	6.4.7.18	155,939.93	155,657.05
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-24,625,713.74	-38,999,786.60
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-24,625,713.74	-38,999,786.60
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-24,625,713.74	-38,999,786.60

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：华夏创业板交易型开放式指数证券投资基金

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）	223,784,560.00	-	109,453,300.30	333,237,860.30
二、本期期初净资产（基金净值）	223,784,560.00	-	109,453,300.30	333,237,860.30
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	109,000,000.00	-	28,358,652.61	137,358,652.61
（一）、综合收益总额	-	-	-24,625,713.74	-24,625,713.74
（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）	109,000,000.00	-	52,984,366.35	161,984,366.35
其中：1.基金申购款	533,000,000.00	-	272,014,681.71	805,014,681.71
2.基金赎回	-424,000,000.00	-	-219,030,315.36	-643,030,315.36

款				
(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)	332,784,560.00	-	137,811,952.91	470,596,512.91
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)	132,784,560.00	-	144,466,147.59	277,250,707.59
二、本期期初净资产(基金净值)	132,784,560.00	-	144,466,147.59	277,250,707.59
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	64,000,000.00	-	8,296,925.51	72,296,925.51
(一)、综合收益总额	-	-	-38,999,786.60	-38,999,786.60
(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)	64,000,000.00	-	47,296,712.11	111,296,712.11
其中: 1.基金申购款	118,000,000.00	-	80,043,123.86	198,043,123.86
2.基金赎回款	-54,000,000.00	-	-32,746,411.75	-86,746,411.75
(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)	196,784,560.00	-	152,763,073.10	349,547,633.10

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

华夏创业板交易型开放式指数证券投资基金（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[2016]1414 号《关于准予华夏创业板交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》及机构部函[2017]1940 号《关于华夏创业板交易型开放式指数证券投资基金延期募集备案的回函》，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》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《华夏创业板交易型开放式指数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。本基金为交易型开放式，存续期限为不定期。本基金自 2017 年 11 月 3 日至 2017 年 11 月 30 日共募集 247,733,980.00 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（2017）验字第 60739337_A32 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华夏创业板交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2017 年 12 月 8 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 247,784,560.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 50,580.00 份基金份额。本基金的基金管理人为华夏基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

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，本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股、替代性股票。为更好地实现投资目标，基金还可投资于非成份股、债券（含中小企业私募债券）、股指期货、股票期权、权证、货币市场工具、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。本基金投资范围中的股票包含存托凭证。

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	1,673,981.49
等于：本金	1,673,835.71
加：应计利息	145.78
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	1,673,981.49

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		502,086,880.03	-	469,254,828.73	-32,832,051.30
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		502,086,880.03	-	469,254,828.73	-32,832,051.30

注：股票投资的估值增值和股票投资的公允价值均包含可退替代款的估值增值。

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

无。

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

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
应收利息	-
其他应收款	4,034.29
待摊费用	-
合计	4,034.29

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	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	42,512.48
其中：交易所市场	42,512.48
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	84,302.56
应付指数使用费	70,000.00
合计	196,815.04

6.4.7.7 实收基金

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（份）	账面金额
上年度末	223,784,560.00	223,784,560.00
本期申购	533,000,000.00	533,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-424,000,000.00	-424,000,000.00
本期末	332,784,560.00	332,784,560.00

6.4.7.8 未分配利润

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	210,432,066.50	-100,978,766.20	109,453,300.30
本期利润	-22,778,345.93	-1,847,367.81	-24,625,713.74
本期基金份额交易产生的变动数	100,211,413.44	-47,227,047.09	52,984,366.35
其中：基金申购款	485,287,537.78	-213,272,856.07	272,014,681.71
基金赎回款	-385,076,124.34	166,045,808.98	-219,030,315.36
本期已分配利润	-	-	-
本期末	287,865,134.01	-150,053,181.10	137,811,952.91

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	3,660.19
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	2,888.18

其他	39.46
合计	6,587.83

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-5,517,309.04
股票投资收益——赎回差价收入	-18,854,517.98
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-24,371,827.02

6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	49,622,220.24
减：卖出股票成本总额	55,035,228.36
减：交易费用	104,300.92
买卖股票差价收入	-5,517,309.04

6.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	643,030,315.36
减：现金支付赎回款总额	38,508,902.20
减：赎回股票成本总额	623,375,931.14
减：交易费用	-
赎回差价收入	-18,854,517.98

6.4.7.10.4 股票投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.10.5 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

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	7.38
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	11,416.37
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	11,423.75

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	50,826.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	39,400.00
减：应计利息总额	7.60
减：交易费用	2.03
买卖债券差价收入	11,416.37

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

无。

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	2,904,764.71
其中：证券出借权益补偿收入	18,194.30
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,904,764.71

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	-1,847,367.81
——股票投资	-1,847,367.81
——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	-
——权证投资	-
3.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	-1,847,367.81

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	-
替代损益	6,285.28
合计	6,285.28

6.4.7.17 信用减值损失

无。

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
审计费用	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	1,637.37
指数使用费	70,000.00
合计	155,939.93

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
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人
华夏创业板交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（“华夏创业板 ETF 联接”）	该基金是本基金的联接基金
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

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	-	-	113,172.76	0.20%

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

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

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	48.81	0.20%	-	-

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	1,031,875.84	759,401.60

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 0.50%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×0.50%/当年天数。

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	206,375.16	151,880.40

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。

6.4.10.3 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

因 2023 年注册制全面改革，自实施起没有与关联方通过约定方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务。

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

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	合约编号	证券名称	成交时间	交易金额	交易数量（单位：股）	出借期限（单位：天）	费率（%）	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
中信证券	2023010300039957	碧水源	2023-01-03	144,900.00	30,000.00	14	3.00	169.05	-	-
中信证券	2023010400020826	乐普医疗	2023-01-04	457,000.00	20,000.00	14	3.20	568.71	-	-
中信证券	2023011200014079	欣旺达	2023-01-12	44,300.00	2,000.00	28	3.20	110.26	-	-
中信证券	2023011300008026	乐普医疗	2023-01-13	115,700.00	5,000.00	14	1.80	98.35	-	-
中信证券	2023011700001189	星源材质	2023-01-17	88,578.00	3,800.00	14	1.80	62.00	-	-
中信证券	2023011700001190	怡合达	2023-01-17	63,670.00	1,000.00	14	1.80	44.57	-	-
中信证券	2023011700001192	捷佳伟创	2023-01-17	180,450.00	1,500.00	14	1.80	126.32	-	-
中信证券	2023011800016793	乐普医疗	2023-01-18	471,000.00	20,000.00	14	3.30	604.45	-	-

中信证券	202301300008 1017	乐普医疗	2023-01 -30	110,900.0 0	5,000.00	14	1.80	77.63	-	-
中信证券	202302010001 5314	乐普医疗	2023-02 -01	453,000.0 0	20,000.0 0	14	5.80	1,021. 77	-	-
中信证券	202302130006 6096	乐普医疗	2023-02 -13	120,300.0 0	5,000.00	14	1.80	84.21	-	-
中信证券	202302150001 7266	乐普医疗	2023-02 -15	481,200.0 0	20,000.0 0	14	3.10	580.11	-	-
中信证券	202302230000 1177	东方财富	2023-02 -23	4,360,000 .00	200,000. 00	14	1.80	3,052. 00	-	-
中信证券	202302270007 5400	乐普医疗	2023-02 -27	116,150.0 0	5,000.00	14	1.80	81.31	-	-
中信证券	202302280000 1289	东方日升	2023-02 -28	160,140.0 0	5,100.00	14	3.70	230.4 2	-	-
中信证券	202303020000 1432	昆仑万维	2023-03 -02	228,420.0 0	9,000.00	14	4.10	364.2 0	-	-
中信证券	202303070000 1820	朗新科技	2023-03 -07	116,512.0 0	4,400.00	28	5.10	462.1 6	-	-
中信证券	202303080000 1194	东方日升	2023-03 -08	185,378.0 0	5,900.00	14	3.60	259.5 3	-	-
中信证券	202303090000 6824	东方财富	2023-03 -09	4,000,000 .00	200,000. 00	14	1.80	2,800. 00	-	-

中信证券	202303130004 9688	乐普医疗	2023-03 -13	112,050.0 0	5,000.00	14	1.80	78.44	-	-
中信证券	202303140002 2330	东方日升	2023-03 -14	150,960.0 0	5,100.00	14	3.60	211.34	-	-
中信证券	202303150000 2003	光环新网	2023-03 -15	220,688.0 0	20,800.0 0	14	3.00	257.4 7	-	-
中信证券	202303210000 1797	昆仑万维	2023-03 -21	30,100.00	1,000.00	14	3.80	44.48	-	-
中信证券	202303220000 8627	东方日升	2023-03 -22	164,020.0 0	5,900.00	14	3.70	252.8 6	-	-
中信证券	202303230000 5828	东方财富	2023-03 -23	3,910,000 .00	200,000. 00	14	1.80	2,737. 00	-	-
中信证券	202303280002 3459	东方日升	2023-03 -28	141,015.0 0	5,100.00	14	3.50	191.9 4	-	-
中信证券	202303290000 0917	金力永磁	2023-03 -29	45,232.00	1,600.00	14	2.60	45.73	-	-
中信证券	202303290000 0920	东岳硅材	2023-03 -29	15,379.00	1,300.00	14	2.10	12.56	-	-
中信证券	202303290001 8736	光环新网	2023-03 -29	263,744.0 0	20,800.0 0	14	3.40	348.7 3	-	-
中信证券	202303300000 2489	卫宁健康	2023-03 -30	149,124.0 0	12,900.0 0	14	2.50	144.9 8	-	-

中信证券	202304040000 1823	博腾股份	2023-04 -04	36,950.00	1,000.00	14	3.00	43.11	-	-
中信证券	202304040001 1123	朗新科技	2023-04 -04	115,280.0 0	4,400.00	28	3.50	336.2 3	-	-
中信证券	202304040001 1137	昆仑万维	2023-04 -04	49,500.00	1,000.00	14	3.90	75.08	-	-
中信证券	202304060001 6626	东方财富	2023-04 -06	4,406,000 .00	200,000. 00	14	1.80	3,084. 20	-	-
中信证券	202304060001 6640	东方日升	2023-04 -06	160,893.0 0	5,900.00	14	3.50	218.9 9	-	-
中信证券	202304110000 4771	卫宁健康	2023-04 -11	178,490.0 0	13,000.0 0	14	3.40	236.0 0	-	-
中信证券	202304110002 2094	东方日升	2023-04 -11	137,496.0 0	5,100.00	14	3.10	165.7 6	-	-
中信证券	202304120001 1306	卫宁健康	2023-04 -12	191,700.0 0	13,500.0 0	14	3.40	253.4 7	-	-
中信证券	202304120002 6774	光环新网	2023-04 -12	281,632.0 0	20,800.0 0	14	3.30	361.4 3	-	-
中信证券	202304120003 0832	东岳硅材	2023-04 -12	16,666.00	1,300.00	14	2.60	16.85	-	-
中信证券	202304130001 7455	卫宁健康	2023-04 -13	177,246.0 0	12,900.0 0	14	3.20	220.5 7	-	-

中信证券	202304180001 1409	昆仑万维	2023-04 -18	51,050.00	1,000.00	14	3.50	79.41	-	-
中信证券	202304200000 5561	东方财富	2023-04 -20	3,594,000 .00	200,000. 00	14	1.80	2,515. 80	-	-
中信证券	202304200000 5825	东方日升	2023-04 -20	150,745.0 0	5,900.00	14	3.40	199.3 2	-	-
中信证券	202304250006 3369	卫宁健康	2023-04 -25	151,060.0 0	13,000.0 0	14	3.10	182.11	-	-
中信证券	202304250006 6061	东方日升	2023-04 -25	123,420.0 0	5,100.00	14	3.40	163.1 9	-	-
中信证券	202304260000 4963	长信科技	2023-04 -26	6,010.00	1,000.00	14	2.60	6.08	-	-
中信证券	202304260002 6076	卫宁健康	2023-04 -26	150,525.0 0	13,500.0 0	14	1.80	105.3 7	-	-
中信证券	202304260002 6610	光环新网	2023-04 -26	265,824.0 0	20,800.0 0	14	2.50	258.4 4	-	-
中信证券	202304270000 6084	易事特	2023-04 -27	72,498.00	8,600.00	14	3.10	87.40	-	-
中信证券	202304270000 6099	东富龙	2023-04 -27	29,592.00	1,200.00	14	4.00	46.03	-	-
中信证券	202304270000 6108	东岳硅材	2023-04 -27	16,240.00	1,600.00	14	3.50	22.10	-	-

中信证券	202305040001 7525	昆仑万维	2023-05 -04	66,400.00	1,000.00	14	4.70	121.3 6	-	-
中信证券	202305040002 4255	东方日升	2023-05 -04	145,022.0 0	5,900.00	14	3.50	197.3 9	-	-
中信证券	202305090002 3453	东方日升	2023-05 -09	118,575.0 0	5,100.00	14	3.50	161.3 9	-	-
中信证券	202305100000 8644	长信科技	2023-05 -10	6,170.00	1,000.00	14	2.60	6.24	-	-
中信证券	202305100001 1194	光环新网	2023-05 -10	245,232.0 0	20,800.0 0	14	2.50	238.4 2	-	-
中信证券	202305100002 5130	卫宁健康	2023-05 -10	153,630.0 0	13,500.0 0	14	1.80	107.5 4	-	-
中信证券	202305110001 3645	东富龙	2023-05 -11	27,756.00	1,200.00	14	4.00	43.18	-	-
中信证券	202305160000 2829	鹏辉能源	2023-05 -16	100,149.0 0	1,900.00	14	3.40	132.4 2	-	-
中信证券	202305170000 3464	昆仑万维	2023-05 -17	199,985.0 0	3,700.00	14	4.40	342.2 0	-	-
中信证券	202305180000 3846	易事特	2023-05 -18	61,920.00	8,600.00	14	3.50	84.28	-	-
中信证券	202305180001 8240	昆仑万维	2023-05 -18	58,700.00	1,000.00	14	4.60	105.0 1	-	-

中信证券	202305180002 6024	东方日升	2023-05 -18	140,774.0 0	5,900.00	14	3.70	202.5 6	-	-
中信证券	202305230000 5154	东方日升	2023-05 -23	33,474.00	1,400.00	14	3.80	49.47	-	-
中信证券	202305230000 9622	东方日升	2023-05 -23	121,941.0 0	5,100.00	14	3.50	165.9 8	-	-
中信证券	202305240002 2496	光环新网	2023-05 -24	226,928.0 0	20,800.0 0	14	3.10	273.5 7	-	-
中信证券	202305240002 2712	卫宁健康	2023-05 -24	127,440.0 0	13,500.0 0	14	2.50	123.9 0	-	-
中信证券	202305240002 4954	长信科技	2023-05 -24	6,160.00	1,000.00	14	2.70	6.47	-	-
中信证券	202305250000 4729	易事特	2023-05 -25	61,146.00	8,600.00	14	3.50	83.23	-	-
中信证券	202305250000 4767	中际旭创	2023-05 -25	326,130.0 0	3,500.00	14	3.60	456.5 8	-	-
中信证券	202305250001 9912	东富龙	2023-05 -25	27,912.00	1,200.00	14	3.50	37.99	-	-
中信证券	202305300002 0479	鹏辉能源	2023-05 -30	89,946.00	1,900.00	14	3.40	118.93	-	-
中信证券	202306010002 9510	昆仑万维	2023-06 -01	57,400.00	1,000.00	14	3.70	82.59	-	-

中信证券	202306010003 2990	东方 日升	2023-06 -01	136,467.0 0	5,900.00	14	3.80	201.6 7	-	-
中信证券	202306010003 5789	易事特	2023-06 -01	60,200.00	8,600.00	14	3.50	81.94	-	-
中信证券	202306060000 4933	长川科技	2023-06 -06	50,480.00	1,000.00	14	2.70	53.00	-	-
中信证券	202306060001 4734	东方日升	2023-06 -06	123,369.0 0	5,100.00	14	3.50	167.9 2	-	-
中信证券	202306060001 7007	东方日升	2023-06 -06	33,866.00	1,400.00	14	3.50	46.10	-	-
中信证券	202306070000 4917	碧水源	2023-06 -07	5,640.00	1,000.00	14	2.70	5.92	-	-
中信证券	202306070000 4925	长信科技	2023-06 -07	6,776.00	1,100.00	14	2.20	5.80	-	-
中信证券	202306070000 4942	卫宁健康	2023-06 -07	14,350.00	1,400.00	14	2.90	16.18	-	-
中信证券	202306070001 8353	卫宁健康	2023-06 -07	138,375.0 0	13,500.0 0	14	3.20	172.2 0	-	-
中信证券	202306070001 9477	长信科技	2023-06 -07	6,160.00	1,000.00	14	2.90	6.95	-	-
中信证券	202306070002 1857	光环新网	2023-06 -07	250,848.0 0	20,800.0 0	14	3.10	302.4 1	-	-

中信证券	202306080000 4239	易事特	2023-06 -08	40,297.00	5,900.00	14	3.50	70.52	-	-
中信证券	202306080000 4249	鼎龙股份	2023-06 -08	25,850.00	1,000.00	14	2.80	36.19	-	-
中信证券	202306080001 8358	中际旭创	2023-06 -08	373,520.0 0	3,500.00	14	3.70	691.0 1	-	-
中信证券	202306080001 9438	易事特	2023-06 -08	58,738.00	8,600.00	14	3.50	102.7 9	-	-
中信证券	202306080002 0011	东富龙	2023-06 -08	27,144.00	1,200.00	14	4.60	62.43	-	-
中信证券	202306130002 1420	鹏辉能源	2023-06 -13	87,153.00	1,900.00	14	3.50	118.62	-	-
中信证券	202306150002 8975	易事特	2023-06 -15	61,834.00	8,600.00	14	3.50	84.16	-	-
中信证券	202306150003 2320	东方日升	2023-06 -15	139,830.0 0	5,900.00	14	3.50	190.3 2	-	-
中信证券	202306150003 8550	昆仑万维	2023-06 -15	55,680.00	1,000.00	14	3.50	75.79	-	-
中信证券	202306200002 2494	钢研高纳	2023-06 -20	329,295.0 0	8,700.00	14	1.90	173.7 9	329,295.0 0	173.7 9
中信证券	202306200003 1421	长川科技	2023-06 -20	51,640.00	1,000.00	14	2.60	719.2 9	51,640.00	719.2 9

中信证券	202306200003 1927	东方日升	2023-06 -20	33,404.00	1,400.00	14	3.50	32.48	33,404.00	32.48
中信证券	202306200003 2279	东方日升	2023-06 -20	121,686.0 0	5,100.00	14	3.50	118.31	121,686.0 0	118.31
中信证券	202306210000 6089	中际旭创	2023-06 -21	2,238,600 .00	14,000.0 0	14	3.80	2,126. 67	2,238,600 .00	2,126. 67
中信证券	202306210001 4855	长信科技	2023-06 -21	6,010.00	1,000.00	14	2.30	3.46	6,010.00	3.46
中信证券	202306210001 5553	碧水源	2023-06 -21	5,300.00	1,000.00	14	2.20	2.91	5,300.00	2.91
中信证券	202306210001 5554	卫宁健康	2023-06 -21	16,100.00	1,400.00	14	2.90	11.67	16,100.00	11.67
中信证券	202306210001 7103	卫宁健康	2023-06 -21	155,250.0 0	13,500.0 0	14	2.90	112.56	155,250.0 0	112.56
中信证券	202306210001 7643	长信科技	2023-06 -21	6,611.00	1,100.00	14	2.30	3.80	6,611.00	3.80
中信证券	202306260003 4530	易事特	2023-06 -26	39,707.00	5,900.00	14	3.50	15.44	39,707.00	15.44
中信证券	202306260003 6524	东富龙	2023-06 -26	26,652.00	1,200.00	14	3.60	403.9 6	26,652.00	403.9 6
中信证券	202306260003 8506	鼎龙股份	2023-06 -26	24,730.00	1,000.00	14	2.90	7.97	24,730.00	7.97

中信证券	202306260003 8578	中际旭创	2023-06 -26	518,000.0 0	3,500.00	14	4.50	259.0 0	518,000.0 0	259.0 0
中信证券	202306260004 1490	易事特	2023-06 -26	57,878.00	8,600.00	14	3.50	22.51	57,878.00	22.51
中信证券	202306270000 8688	宏达电子	2023-06 -27	120,764.0 0	2,800.00	14	2.60	26.17	120,764.0 0	26.17
中信证券	202306270001 7516	鹏辉能源	2023-06 -27	88,312.00	1,900.00	14	5.40	39.74	88,312.00	39.74
中信证券	202306280000 9757	铭利达	2023-06 -28	164,560.0 0	4,000.00	14	2.20	20.11	164,560.0 0	20.11
中信证券	202306280000 9759	华兰疫苗	2023-06 -28	64,000.00	2,000.00	14	3.60	12.80	64,000.00	12.80
中信证券	202306290003 6748	昆仑万维	2023-06 -29	40,500.00	1,000.00	14	2.70	3.04	40,500.00	3.04
中信证券	202306290003 9618	易事特	2023-06 -29	55,814.00	8,600.00	14	3.40	5.27	55,814.00	5.27
中信证券	202306290004 3034	东方日升	2023-06 -29	151,453.0 0	5,900.00	14	3.00	12.62	151,453.0 0	12.62
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	合约编号	证券名称	成交时间	交易金额	交易数量(单位:股)	出借期限(单)	费率(%)	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额

						位： 天)					
中信 证券	202205100000 1040	光线 传媒	2022-05 -10	196,554.0 0	28,200.0 0	14	3.40	259.8 9	-	-	
中信 证券	202205240000 8460	光线 传媒	2022-05 -24	199,092.0 0	28,200.0 0	14	3.40	263.2 4	-	-	
中信 证券	202206010000 8528	光线 传媒	2022-05 -24	5,640.00	-	14	3.40	-	-	-	
中信 证券	202206070000 8118	光线 传媒	2022-06 -07	238,290.0 0	28,200.0 0	14	3.20	296.5 4	-	-	
中信 证券	202206080000 1127	特 锐 德	2022-06 -08	165,800.0 0	10,000.0 0	14	2.10	135.4 0	-	-	
中信 证券	202206160000 1368	宁 德 时 代	2022-06 -16	4,603,000 .00	10,000.0 0	28	1.80	3,222. 10	5,340,000 .00	3,222. 10	
中信 证券	202206210000 9710	光线 传媒	2022-06 -21	248,160.0 0	28,200.0 0	14	3.00	186.1 2	267,054.0 0	186.1 2	
中信 证券	202206220001 3677	特 锐 德	2022-06 -22	170,100.0 0	10,000.0 0	14	2.10	79.38	173,100.0 0	79.38	

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自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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
-------	---------------------	-----------------------

	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
华夏创业板 ETF 联接	271,578,400.00	81.61%	193,624,700.00	86.52%
中信证券	1,431,960.00	0.43%	944,049.00	0.42%

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的相关费用符合基金招募说明书、交易所、登记结算机构的有关规定。

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		上年度可比期间	
	2023年1月1日至2023年6月30日		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
中国银行活期存款	1,673,981.49	3,660.19	2,113,754.49	4,578.68

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

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期					
2023年1月1日至2023年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
中信证券	001286	陕西能源	新股发行	37,667	361,603.20
中信证券	301293	三博脑科	新股发行	3,324	98,390.40
中信证券	301439	泓淋电力	新股发行	4,901	97,970.99
中信证券	301157	华塑科技	新股发行	1,498	84,637.00
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
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	301302	华如科技	新股发行	2,959	153,956.77
中信证券	301200	大族数控	新股发行	1,770	135,511.20
中信证券	301109	军信股份	新股发行	3,858	134,296.98

中信证券	001266	宏英智能	新股发行	247	9,536.67
------	--------	------	------	-----	----------

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
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	-
301325	曼恩斯特	2023-05-04	6个月	新发流通受限	76.80	107.95	246	18,892.80	26,555.70	-
301293	三博脑科	2023-04-25	6个月	新发流通受限	29.60	71.42	333	9,856.80	23,782.86	-
301358	湖南裕能	2023-02-01	6个月	新发流通受限	23.77	42.89	493	11,718.61	21,144.77	-
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	-
301307	美利信	2023-04-14	6个月	新发流通受限	32.34	31.86	481	15,555.54	15,324.66	-
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	-
301303	真兰仪表	2023-02-13	6个月	新发流通受限	26.80	22.32	651	17,446.80	14,530.32	-
301332	德尔玛	2023-05-09	6个月	新发流通受限	14.81	13.73	989	14,647.09	13,578.97	-

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	-
301387	光大同创	2023-04-10	6个月	新发 流通 受限	58.32	45.36	291	16,971.12	13,199.76	-
301305	朗坤环境	2023-05-15	6个月	新发 流通 受限	25.25	19.69	636	16,059.00	12,522.84	-
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	-
001287	中电港	2023-03-30	6个月	新发 流通 受限	11.88	21.02	544	6,462.72	11,434.88	-
301141	中科磁业	2023-03-27	6个月	新发 流通 受限	41.20	42.69	262	10,794.40	11,184.78	-
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	-
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	375	11,246.25	8,921.25	-
301439	泓淋电力	2023-03-10	6个月	新发 流通 受限	19.99	16.90	491	9,815.09	8,297.90	-
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	-
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	-
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	28.84	30.78	170	4,902.80	5,232.60	-

				受限						
001328	登康口腔	2023-03-29	6个月	新发 流通 受限	20.68	25.49	145	2,998.60	3,696.05	-
001282	三联锻造	2023-05-15	6个月	新发 流通 受限	27.93	33.03	105	2,932.65	3,468.15	-
001360	南矿集团	2023-03-31	6个月	新发 流通 受限	15.38	14.87	177	2,722.26	2,631.99	-
001324	长青科技	2023-05-12	6个月	新发 流通 受限	18.88	19.60	114	2,152.32	2,234.40	-
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	-

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

无。

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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	出借到期日	期末估值 单价	数量（股）	期末估值总额
1	300308	中际旭创	2023年7月5日 -2023年7月10日	147.45	17,500.00	2,580,375.00
2	300418	昆仑万维	2023年7月5日 -2023年7月13日	40.28	23,000.00	926,440.00
3	300034	钢研高纳	2023年7月4日 -2023年7月4日	39.39	8,700.00	342,693.00
4	300118	东方日升	2023年7月4日 -2023年7月13日	25.63	12,400.00	317,812.00
5	300676	华大基因	2023年7月12日 -2023年7月12日	59.99	4,900.00	293,951.00
6	300748	金力永磁	2023年7月4日 -2023年7月12日	29.92	9,200.00	275,264.00
7	300253	卫宁健康	2023年7月5日 -2023年7月13日	10.82	24,900.00	269,418.00
8	301268	铭利达	2023年7月12日 -2023年7月12日	41.87	4,000.00	167,480.00
9	300376	易事特	2023年7月10日 -2023年7月13日	6.70	23,100.00	154,770.00
10	300677	英科医疗	2023年7月12日 -2023年7月12日	22.00	6,300.00	138,600.00
11	300726	宏达电子	2023年7月11日 -2023年7月11日	44.72	2,800.00	125,216.00
12	300070	碧水源	2023年7月4日 -2023年7月10日	5.36	21,100.00	113,096.00
13	300438	鹏辉能源	2023年7月11日 -2023年7月11日	48.04	1,900.00	91,276.00
14	301207	华兰疫苗	2023年7月12日 -2023年7月12日	33.26	2,000.00	66,520.00
15	300604	长川科技	2023年7月4日 -2023年7月4日	47.49	1,000.00	47,490.00
16	300595	欧普康视	2023年7月5日 -2023年7月5日	30.19	1,000.00	30,190.00
17	300171	东富龙	2023年7月10日 -2023年7月10日	22.75	1,200.00	27,300.00
18	300054	鼎龙股份	2023年7月10日 -2023年7月10日	24.73	1,000.00	24,730.00
19	300088	长信科技	2023年7月3日 -2023年7月5日	6.03	3,700.00	22,311.00
20	300383	光环新网	2023年7月5日 -2023年7月5日	10.75	1,100.00	11,825.00
合计	-	-	-	-	170,800.00	6,026,757.00

注：出借证券中如有其他流通受限的情况详见本报告“本基金持有的流通受限证券”部分内容。

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。

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，本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股，如需对组合进行调整时，由于投资标的流动性较好，市场冲击成本较小，基金投资组合收益偏离投资目标收益的风险较小。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，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。

本基金为指数型基金，采用完全复制策略。本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。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。

本基金为指数型基金，采用完全复制策略。本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。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	469,254,828.73	99.71	330,764,903.01	99.26
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-

交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	469,254,828.73	99.71	330,764,903.01	99.26

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	除创业板价格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%	-24,383,128.47	-16,126,115.55
	+5%	24,383,128.47	16,126,115.55

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	468,910,973.05
第二层次	-
第三层次	343,855.68
合计	469,254,828.73

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	469,254,828.73	99.62
	其中：股票	469,254,828.73	99.62
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	1,763,458.93	0.37
8	其他各项资产	13,100.45	0.00
9	合计	471,031,388.11	100.00

注：①股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值。

②报告期末,本基金参与转融通证券出借业务借出股票的公允价值为 6,026,757.00 元，占本基金期末资产净值的 1.28%。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	14,995,308.05	3.19

B	采矿业	-	-
C	制造业	357,471,979.47	75.96
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	35,447.47	0.01
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	11,434.88	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	24,684,095.26	5.25
J	金融业	34,278,530.00	7.28
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	14,975,323.00	3.18
N	水利、环境和公共设施管理业	1,485,686.84	0.32
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	13,534,662.81	2.88
R	文化、体育和娱乐业	7,782,360.95	1.65
S	综合	-	-
	合计	469,254,828.73	99.71

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

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	300750	宁德时代	383,895	87,831,337.05	18.66
2	300059	东方财富	1,911,515	27,143,513.00	5.77
3	300760	迈瑞医疗	75,200	22,544,960.00	4.79
4	300124	汇川技术	292,977	18,812,053.17	4.00
5	300274	阳光电源	153,800	17,937,694.00	3.81
6	300498	温氏股份	817,183	14,995,308.05	3.19
7	300308	中际旭创	92,540	13,645,023.00	2.90
8	300015	爱尔眼科	628,869	11,665,519.95	2.48
9	300014	亿纬锂能	191,797	11,603,718.50	2.47
10	300122	智飞生物	169,450	7,489,690.00	1.59
11	300316	晶盛机电	94,000	6,664,600.00	1.42
12	300142	沃森生物	250,000	6,612,500.00	1.41
13	300896	爱美客	13,700	6,095,815.00	1.30
14	300408	三环集团	190,100	5,579,435.00	1.19
15	300450	先导智能	152,558	5,518,022.86	1.17
16	300347	泰格医药	82,350	5,314,869.00	1.13
17	300033	同花顺	30,200	5,293,456.00	1.12
18	300496	中科创达	53,300	5,135,455.00	1.09
19	300782	卓胜微	51,660	4,991,905.80	1.06

20	300418	昆仑万维	116,300	4,684,564.00	1.00
21	300724	捷佳伟创	38,100	4,280,535.00	0.91
22	300003	乐普医疗	188,100	4,252,941.00	0.90
23	300012	华测检测	215,100	4,194,450.00	0.89
24	300454	深信服	36,000	4,077,000.00	0.87
25	300223	北京君正	44,900	3,965,119.00	0.84
26	300661	圣邦股份	46,245	3,798,101.85	0.81
27	300037	新宙邦	72,993	3,787,606.77	0.80
28	300751	迈为股份	22,234	3,765,994.92	0.80
29	300146	汤臣倍健	151,800	3,640,164.00	0.77
30	300769	德方纳米	31,992	3,526,478.16	0.75
31	300433	蓝思科技	297,998	3,504,456.48	0.74
32	300999	金龙鱼	86,560	3,461,534.40	0.74
33	300207	欣旺达	211,900	3,458,208.00	0.73
34	300759	康龙化成	87,000	3,330,360.00	0.71
35	300285	国瓷材料	119,600	3,277,040.00	0.70
36	300413	芒果超媒	95,140	3,254,739.40	0.69
37	300763	锦浪科技	30,945	3,221,374.50	0.68
38	300395	菲利华	63,600	3,129,120.00	0.66
39	300073	当升科技	61,900	3,115,427.00	0.66
40	300474	景嘉微	34,300	3,086,657.00	0.66
41	300568	星源材质	176,383	3,032,023.77	0.64
42	300253	卫宁健康	269,440	2,915,340.80	0.62
43	300390	天华新能	78,980	2,827,484.00	0.60
44	300144	宋城演艺	223,820	2,775,368.00	0.59
45	300919	中伟股份	45,800	2,759,450.00	0.59
46	300832	新产业	45,700	2,696,300.00	0.57
47	300054	鼎龙股份	105,400	2,606,542.00	0.55
48	300118	东方日升	100,000	2,563,000.00	0.54
49	300604	长川科技	53,500	2,540,715.00	0.54
50	300699	光威复材	81,084	2,501,441.40	0.53
51	300136	信维通信	124,034	2,490,602.72	0.53
52	300628	亿联网络	69,891	2,451,077.37	0.52
53	300777	中简科技	51,500	2,433,890.00	0.52
54	300601	康泰生物	94,540	2,400,370.60	0.51
55	300487	蓝晓科技	37,450	2,337,629.00	0.50
56	300438	鹏辉能源	48,200	2,315,528.00	0.49
57	300595	欧普康视	75,070	2,266,363.30	0.48
58	300383	光环新网	210,500	2,262,875.00	0.48
59	300676	华大基因	35,600	2,135,644.00	0.45
60	300001	特锐德	101,500	2,109,170.00	0.45
61	300866	安克创新	24,100	2,108,750.00	0.45
62	300633	开立医疗	38,200	2,081,900.00	0.44

63	300296	利亚德	306,200	1,999,486.00	0.42
64	300666	江丰电子	29,200	1,984,432.00	0.42
65	300682	朗新科技	83,850	1,952,028.00	0.41
66	300088	长信科技	313,200	1,888,596.00	0.40
67	300558	贝达药业	38,800	1,863,564.00	0.40
68	300244	迪安诊断	72,000	1,845,360.00	0.39
69	300803	指南针	37,900	1,841,561.00	0.39
70	300373	扬杰科技	44,900	1,821,593.00	0.39
71	300251	光线传媒	216,595	1,752,253.55	0.37
72	300957	贝泰妮	19,700	1,750,936.00	0.37
73	300748	金力永磁	58,240	1,742,540.80	0.37
74	300034	钢研高纳	43,700	1,721,343.00	0.37
75	300009	安科生物	162,629	1,626,290.00	0.35
76	300294	博雅生物	43,800	1,589,064.00	0.34
77	301269	华大九天	12,600	1,547,784.00	0.33
78	300529	健帆生物	66,730	1,546,801.40	0.33
79	301236	软通动力	56,150	1,527,841.50	0.32
80	300775	三角防务	44,800	1,513,344.00	0.32
81	300363	博腾股份	51,097	1,511,960.23	0.32
82	300677	英科医疗	66,736	1,468,192.00	0.31
83	300070	碧水源	273,400	1,465,424.00	0.31
84	300357	我武生物	41,700	1,402,371.00	0.30
85	300776	帝尔激光	20,560	1,334,344.00	0.28
86	300432	富临精工	110,400	1,282,848.00	0.27
87	300888	稳健医疗	29,957	1,248,308.19	0.27
88	300979	华利集团	23,300	1,135,642.00	0.24
89	301035	润丰股份	14,100	1,107,837.00	0.24
90	300376	易事特	158,600	1,062,620.00	0.23
91	300861	美畅股份	23,860	1,034,808.20	0.22
92	300850	新强联	27,500	1,027,950.00	0.22
93	301155	海力风电	13,300	1,025,164.00	0.22
94	301268	铭利达	22,900	958,823.00	0.20
95	300726	宏达电子	20,300	907,816.00	0.19
96	300171	东富龙	39,300	894,075.00	0.19
97	301029	怡合达	16,652	744,011.36	0.16
98	301095	广立微	6,700	553,755.00	0.12
99	301308	江波龙	5,400	549,504.00	0.12
100	301207	华兰疫苗	11,500	382,490.00	0.08
101	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.01
102	301325	曼恩斯特	246	26,555.70	0.01
103	301293	三博脑科	333	23,782.86	0.01
104	301358	湖南裕能	493	21,144.77	0.00
105	301317	鑫磊股份	694	18,161.98	0.00

106	301307	美利信	481	15,324.66	0.00
107	301399	英特科技	293	15,110.01	0.00
108	301303	真兰仪表	651	14,530.32	0.00
109	301332	德尔玛	989	13,578.97	0.00
110	301382	蜂助手	408	13,398.72	0.00
111	301387	光大同创	291	13,199.76	0.00
112	301305	朗坤环境	636	12,522.84	0.00
113	301360	荣旗科技	134	12,408.40	0.00
114	001287	中电港	544	11,434.88	0.00
115	301141	中科磁业	262	11,184.78	0.00
116	301429	森泰股份	499	10,488.98	0.00
117	301357	北方长龙	190	9,194.10	0.00
118	301386	未来电器	375	8,921.25	0.00
119	301439	泓淋电力	491	8,297.90	0.00
120	301157	华塑科技	150	7,939.50	0.00
121	301203	国泰环保	225	7,740.00	0.00
122	301337	亚华电子	232	7,045.84	0.00
123	301428	世纪恒通	229	7,007.40	0.00
124	001380	华纬科技	170	5,232.60	0.00
125	001328	登康口腔	145	3,696.05	0.00
126	001282	三联锻造	105	3,468.15	0.00
127	001360	南矿集团	177	2,631.99	0.00
128	001324	长青科技	114	2,234.40	0.00
129	001367	海森药业	55	2,171.40	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	300750	宁德时代	6,431,889.20	1.93
2	300896	爱美客	3,738,836.00	1.12
3	300633	开立医疗	2,336,020.00	0.70
4	300751	迈为股份	2,204,197.00	0.66
5	300666	江丰电子	2,098,883.00	0.63
6	300803	指南针	1,981,071.00	0.59
7	300760	迈瑞医疗	1,778,470.00	0.53
8	301236	软通动力	1,651,464.00	0.50
9	301269	华大九天	1,555,566.00	0.47
10	300782	卓胜微	1,376,364.00	0.41
11	300059	东方财富	1,319,873.20	0.40
12	300124	汇川技术	1,206,543.00	0.36
13	301155	海力风电	1,097,494.30	0.33

14	300919	中伟股份	1,015,146.00	0.30
15	301268	铭利达	1,001,411.00	0.30
16	300496	中科创达	958,316.00	0.29
17	300223	北京君正	826,286.00	0.25
18	300776	帝尔激光	777,611.00	0.23
19	300347	泰格医药	776,035.00	0.23
20	300769	德方纳米	762,770.00	0.23

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	300059	东方财富	2,272,506.40	0.68
2	300750	宁德时代	1,806,129.00	0.54
3	300725	药石科技	1,654,345.30	0.50
4	300274	阳光电源	1,470,919.00	0.44
5	300896	爱美客	1,419,210.00	0.43
6	300769	德方纳米	1,327,653.00	0.40
7	300747	锐科激光	1,327,441.48	0.40
8	300035	中科电气	1,245,966.00	0.37
9	300122	智飞生物	1,229,982.00	0.37
10	300618	寒锐钴业	1,227,987.08	0.37
11	300482	万孚生物	1,215,155.10	0.36
12	300498	温氏股份	1,179,415.00	0.35
13	300457	赢合科技	1,083,879.50	0.33
14	301047	义翘神州	939,649.00	0.28
15	300014	亿纬锂能	932,453.00	0.28
16	300957	贝泰妮	897,245.00	0.27
17	300347	泰格医药	683,440.00	0.21
18	300124	汇川技术	659,298.00	0.20
19	300751	迈为股份	642,972.00	0.19
20	300033	同花顺	616,668.00	0.19

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	60,834,083.62
卖出股票收入（成交）总额	49,622,220.24

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

本基金本报告期末无股指期货投资。

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	8,572.86
2	应收清算款	-
3	应收股利	493.30
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	4,034.29
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	13,100.45
---	----	-----------

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	300308	中际旭创	2,580,375.00	0.55	转融通出借证券受限

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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		华夏创业板 ETF 联接	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
2,913	114,241.18	15,621,862.00	4.69%	45,584,298.00	13.70%	271,578,400.00	81.61%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	中国银河证券股份有限公司	6,373,500.00	1.92%
2	广发证券股份有限公司	4,469,602.00	1.34%
3	海通证券股份有限公司	2,976,700.00	0.89%
4	温锐	2,049,800.00	0.62%
5	殷知渊	1,968,400.00	0.59%
6	中信证券股份有限公司	1,431,960.00	0.43%
7	李春保	753,000.00	0.23%
8	刘广元	634,300.00	0.19%
9	胡庆南	580,000.00	0.17%

10	吴岚	460,543.00	0.14%
11	中国银行股份有限公司— 华夏创业板交易型开放式 指数证券投资基金发起式 联接基金	271,578,400.00	81.61%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	6,000.00	0.00%

8.4 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	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	0
本基金基金经理持有本 开放式基金	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2017年12月8日）基金份额总额	247,784,560.00
本报告期期初基金份额总额	223,784,560.00
本报告期基金总申购份额	533,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	424,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	332,784,560.00

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期未发生影响基金管理人经营或基金运营业务的诉讼。

本报告期无涉及基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金所聘用的会计师事务所未发生改变。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人及其高级管理人员在本报告期内无受稽查或处罚等情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员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	
华泰证券	3	65,083,730.54	60.71%	28,070.71	60.71%	-
长江证券	3	40,422,999.31	37.70%	17,434.62	37.70%	-
中信建投证券	4	1,702,754.43	1.59%	734.35	1.59%	-

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，本基金还选择了北京高华证券、财通证券、东北证券、东方财富证券、东方证券、东海证券、东吴证券、东兴证券、方正证券、高华证券、广发证券、国金证券、国盛证券、国泰君安证券、国信证券、海通证券、华安证券、华西证券、金通证券、南京证券、平安证券、瑞银证券、申万宏源证券、太平洋证券、天风证券、万和证券、五矿证券、西部证券、西南证券、信达证券、兴业证券、野村东方国际、野村东方国际证券、银河证券、招商证券、浙商证券、中国银河证券、中金公司、中信证券、中银国际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，财通证券的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
华泰证券	50,826.00	100.00%	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-	-	-

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	2023-03-03
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	2023-03-11
4	华夏基金管理有限公司关于华夏创业板交易型开放式指数证券投资基金流动性服务商的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-03-28
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	2023-04-01
6	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关	中国证监会指定报刊及	2023-04-27

	关联方承销证券的公告	网站	
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	2023-05-13
8	华夏基金管理有限公司关于华夏创业板交易型开放式指数证券投资基金流动性服务商的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-06-21

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20% 的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
华夏创业板 ETF 联接	1	2023-01-01 至 2023-06-30	193,624,700.00	124,897,300.00	46,943,600.00	271,578,400.00	81.61%

产品特有风险

本基金在报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额20%的情形，在市场流动性不足的情况下，如遇投资者巨额赎回或集中赎回，基金管理人可能无法以合理的价格及时变现基金资产，有可能对基金净值产生一定的影响，甚至可能引发基金的流动性风险。

在特定情况下，若持有基金份额占比较高的投资者大量赎回本基金，可能导致在其赎回后本基金资产规模持续低于正常运作水平，面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。

§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、《华夏创业板交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《华夏创业板交易型开放式指数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