
华夏国证 2000 指数增强型发起式证券投资基金

2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 日

基金管理人：华夏基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

送出日期：二〇二四年三月二十八日

§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。本年度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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 3 月 26 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。

本报告中的财务资料经审计，普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2023 年 5 月 23 日起至 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况	4
3.1 主要会计数据和财务指标	4
3.2 基金净值表现	5
3.3 过去三年基金的利润分配情况	7
§4 管理人报告	8
§5 托管人报告	13
§6 审计报告	14
§7 年度财务报表	16
7.1 资产负债表	16
7.2 利润表	17
7.3 净资产变动表	18
7.4 报表附注	19
§8 投资组合报告	40
8.1 期末基金资产组合情况	40
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	41
8.3 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
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	56
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	58
8.6 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	58
8.7 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	58
8.8 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	58
8.9 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	58
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	58
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	59
8.12 投资组合报告附注	59
§9 基金份额持有人信息	59
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	60
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	60
9.3 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	60
§10 开放式基金份额变动	61
§11 重大事件揭示	61
§12 影响投资者决策的其他重要信息	63
§13 备查文件目录	64

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华夏国证 2000 指数增强型发起式证券投资基金	
基金简称	华夏国证 2000 指数增强发起式	
基金主代码	018292	
交易代码	018292	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2023 年 5 月 23 日	
基金管理人	华夏基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	21,403,896.84 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华夏国证 2000 指数增强发起式 A	华夏国证 2000 指数增强发起式 C
下属分级基金的交易代码	018292	018293
报告期末下属分级基金的份额总额	13,483,818.23 份	7,920,078.61 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	国证 2000 指数收益率 $\times 95\%$ + 银行活期存款利率（税后） $\times 5\%$
风险收益特征	本基金为股票指数增强型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种，其预期风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

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	交通银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李彬	陆志俊
	联系电话	400-818-6666	95559
	电子邮箱	service@ChinaAMC.com	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		400-818-6666	95559
传真		010-63136700	021-62701216
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188号
办公地址		北京市西城区金融大街33号通	中国（上海）长宁区仙霞路18号

	泰大厦B座8层	
邮政编码	100033	200336
法定代表人	张佑君	任德奇

2.4 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》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.ChinaAMC.com
基金年度报告备置地点	基金管理人和/或基金托管人的住所/办公地址

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼
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、基金净值表现及利润分配情况

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	2023 年 5 月 23 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日	
	华夏国证 2000 指数增强发起式 A	华夏国证 2000 指数增强发起式 C
本期已实现收益	-129,740.39	-43,693.67
本期利润	-143,872.53	-11,379.66
加权平均基金份额本期利润	-0.0114	-0.0016
本期加权平均净值利润率	-1.15%	-0.16%
本期基金份额净值增长率	-1.20%	-1.44%
3.1.2 期末数据和指标	2023 年末	
	华夏国证 2000 指数增强发起式 A	华夏国证 2000 指数增强发起式 C
期末可供分配利润	-161,485.26	-113,982.78
期末可供分配基金份额利润	-0.0120	-0.0144
期末基金资产净值	13,322,332.97	7,806,095.83
期末基金份额净值	0.9880	0.9856
3.1.3 累计期末指标	2023 年末	
	华夏国证 2000 指数增强发起式 A	华夏国证 2000 指数增强发起式 C

基金份额累计净值增长率	-1.20%	-1.44%
-------------	--------	--------

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 5 月 23 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

华夏国证 2000 指数增强发起式 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
过去三个月	0.87%	0.96%	-1.03%	1.02%	1.90%	-0.06%
过去六个月	-3.39%	0.94%	-7.29%	0.98%	3.90%	-0.04%
自基金合同生效起至今	-1.20%	0.92%	-6.33%	0.97%	5.13%	-0.05%

华夏国证 2000 指数增强发起式 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
过去三个月	0.77%	0.96%	-1.03%	1.02%	1.80%	-0.06%
过去六个月	-3.59%	0.94%	-7.29%	0.98%	3.70%	-0.04%
自基金合同生效起至今	-1.44%	0.92%	-6.33%	0.97%	4.89%	-0.05%

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

华夏国证 2000 指数增强型发起式证券投资基金

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 5 月 23 日至 2023 年 12 月 31 日)

华夏国证 2000 指数增强发起式 A



华夏国证 2000 指数增强发起式 C



注：①本基金合同于 2023 年 5 月 23 日生效。

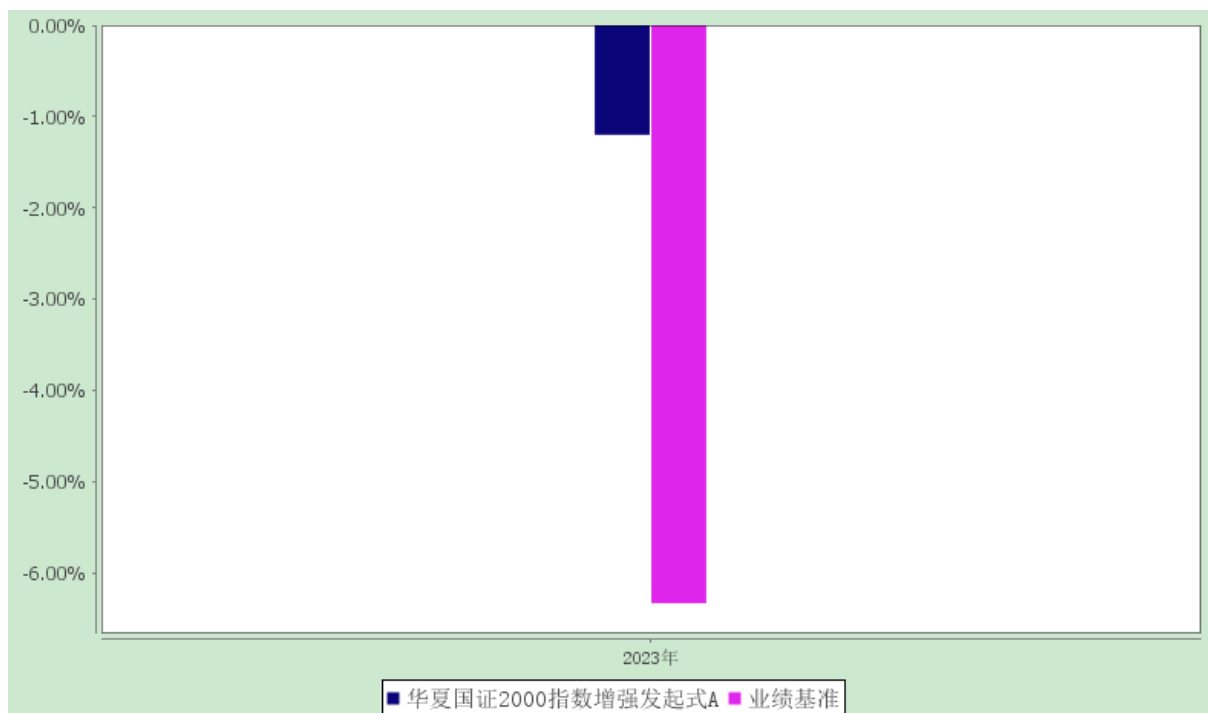
②根据本基金的基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同中投资范围、投资限制的有关约定。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

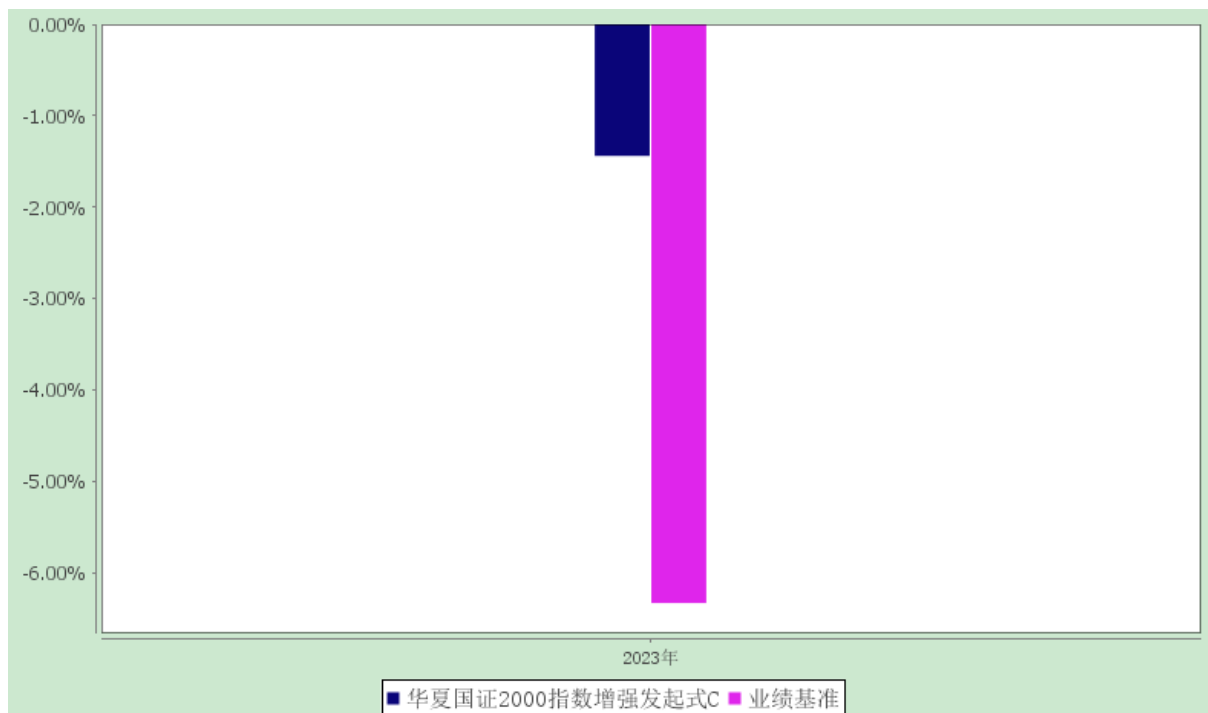
华夏国证 2000 指数增强型发起式证券投资基金

自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图

华夏国证 2000 指数增强发起式 A



华夏国证 2000 指数增强发起式 C



注：本基金合同于 2023 年 5 月 23 日生效，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自基金合同生效以来无利润分配事项。

§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、武汉及沈阳设有分公司,在香港、深圳、上海、北京设有子公司。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。

华夏基金是境内权益 ETF 管理规模最大的基金管理公司之一,在指数基金管理方面积累了丰富的经验,形成了覆盖宽基、港股、行业主题、策略、跨境、商品等较为完整的指数产品线。

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 12 月 31 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:在北交所主题偏股型基金(A 类)中华夏北交所创新中小企业精选两年定开混合发起式排名第 1/10;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 2/68、华夏消费升级混合(A 类)排名第 11/68、华夏消费龙头混合(A 类)排名第 13/68、华夏新兴消费混合(A 类)排名第 21/68;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 3/10;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 3/145、华夏中证 500 指数智选增强(A 类)排名第 4/145、华夏中证 1000 指数增强(A 类)排名第 20/145;在 TMT 与信息技术行业偏股型基金(A 类)中华夏数字经济龙头混合发起式(A 类)排名第 4/30;在新能源主题股票型基金(A 类)中华夏能源革新股票(A 类)排名第 4/14;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 4/13;在灵活配置型基金(基准股票比例 30%-60%)(A 类)中华夏新锦绣混合(A 类)排名第 4/421、华夏稳增

混合排名第 10/421; 在偏股型基金(股票上限 95%)(A 类)中华夏磐锐一年定开混合(A 类)排名第 4/216、华夏磐利一年定开混合(A 类)排名第 21/216、华夏新兴经济一年持有混合(A 类)排名第 33/216; 在标准股票型基金(A 类)中华夏智胜先锋股票 (LOF) (A 类)排名第 8/326、华夏智胜价值成长股票(A 类)排名第 15/326。

固收与固收+产品: 在普通偏债型基金(股票上限不高于 30%)(A 类)中华夏磐泰混合 (LOF) (A 类)排名第 1/349、华夏稳福六个月持有混合(A 类)排名第 17/349、华夏睿磐泰兴混合(A 类)排名第 28/349; 在长期纯债债券型基金(A 类)中华夏鼎成一年定开债券排名第 12/1340、华夏鼎航债券(A 类)排名第 14/1340; 在普通债券型基金(二级)(A 类)中华夏稳享增利 6 个月债券(A 类)排名第 13/402、华夏鼎源债券(A 类)排名第 14/402、华夏卓信一年定开债券发起式排名第 25/402、华夏希望债券(A 类)排名第 32/402、华夏鼎泓债券(A 类)排名第 34/402、华夏卓享债券(A 类)排名第 38/402; 在中短期纯债债券型基金(A 类)中华夏中短债债券(A 类)排名第 34/137。

指数产品: 在主题指数股票 ETF 基金中华夏中证动漫游戏 ETF 排名第 2/343、华夏中证 5G 通信主题 ETF 排名第 10/343、华夏中证云计算与大数据主题 ETF 排名第 16/343、华夏中证人工智能主题 ETF 排名第 20/343、华夏国证消费电子主题 ETF 排名第 24/343、华夏中证智能汽车主题 ETF 排名第 25/343、华夏中证金融科技主题 ETF 排名第 28/343、华夏中证文娱传媒 ETF 排名第 31/343、华夏中证机器人 ETF 排名第 39/343; 在策略指数股票 ETF 基金中华夏中证智选 500 价值稳健策略 ETF 排名第 6/37、华夏中证智选 1000 价值稳健策略 ETF 排名第 10/37; 在行业指数股票 ETF 基金中华夏中证全指证券公司 ETF 排名第 10/66; 在规模指数股票 ETF 基金中华夏中证 1000ETF 排名第 17/146、华夏中证 500ETF 排名第 26/146; 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 2/125、华夏中证 5G 通信主题 ETF 联接(A 类)排名第 6/125、华夏中证人工智能主题 ETF 联接(A 类)排名第 9/125、华夏中证央企 ETF 联接(A 类)排名第 25/125; 在行业指数股票 ETF 联接基金(A 类)中华夏中证全指证券公司 ETF 联接(A 类)排名第 6/36; 在规模指数股票 ETF 联接基金(A 类)中华夏中证 1000ETF 发起式联接(A 类)排名第 11/106、华夏中证 500ETF 联接(A 类)排名第 19/106; 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 5/16; 在利率债指数债券型基金(A 类)中华夏彭博政金债 1-5 年(A 类)排名第 13/115。

在《证券时报》主办的第十八届中国基金业“明星基金奖”评选活动上, 华夏基金将两大奖项收入囊中: 公司层面, 华夏基金荣获“三年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》主办的第二十届“金基金”奖评选活动上, 华夏基金荣膺三项大奖, 公司层面获得“被动投资基金管理公司奖”, 产品层面华夏创新前沿股票和华夏行业景气混合分别荣获股票型基金五年期奖和偏股混合型基金五年期奖。

在客户服务方面，2023 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，让客户操作更加便利；（2）华夏基金管家客户端优化“忘记密码”功能及定投模块，上线亲子账户、资产诊断等功能，贴合客户投资需求，进一步提升使用体验；（3）与华润银行、贵州银行、武汉农商行等代销机构合作，拓展更加丰富的客户理财渠道；（4）开展“帮你问了 ChatGPT”、“指数攻防值来啦！”、“华夏基金模拟投基大赛”、“煎熬的磨底期里找机会”等活动，为客户提供了多样化的投资者教育和关怀服务。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
孙然晔	本基金的基金经理	2023-05-23	-	9 年	博士。曾任美国银行企业投资部资深量化研究员，美国 AQR 资本管理公司量化研究员。2019 年 8 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《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.1.3 基金经理薪酬机制

本基金管理人旗下基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的，公司对其进行年度综合考核，考核结果作为确定其薪酬激励的重要参考因素之一。因此，基金经理个人薪酬激励与其管理的私募资产管理计划浮动管理费或产品业绩表现不直接挂钩。

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 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规制定了《华夏基金管理有限公司公平交易制度》。公司通过科学、制衡的投资决策体系,加强交易分配环节的内部控制,并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时,通过监察稽核、事后分析和信息披露来保证公平交易过程和结果的监督。

4.3.2 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。

4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

本基金管理人一贯严格执行公平交易原则,对兼任基金经理的交易情况进行持续监测。本年度所有相关组合的交易行为均符合法规、制度和流程要求,未发现违反公平交易原则的情况。本年度同一基金经理管理的不同组合在邻近交易日的同向和反向交易,交易时机和交易价差均可合理解释,未发现异常。

本基金管理人根据《基金经理兼任私募资产管理计划投资经理工作指引(试行)》要求,针对同经理管理多个组合间的收益率差异进行归因分析,本年度各组合间收益率差异均属正常情况,主要原因为业绩基准不同、投资策略不同,收益率差异可以合理解释。

4.3.3 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 255 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国证 2000 指数,业绩比较基准为:国证 2000 指数收益率 \times 95%+银行活期存款利率(税后) \times 5%。国证 2000 指数成份股由全部 A 股扣除国证 1000 指数样本股后,市值大、流动性好的 2000 只 A 股组成,反映 A 股市场小微盘股票的价格变动趋势。本基金作为增强型的指数基金,一方面采用指数化被动投资以追求有效跟踪标的指数,另一方面采用量化模型调整投资组合力求超越标的指数表现。

2023 年,A 股市场震荡整理,结构性行情明显。行业间分化较大:通信、传媒、煤炭等行业表现较好,而消费者服务、地产、电力设备及新能源等行业表现较差。风格方面,小市值风格表现较

为突出。基金以国证 2000 指数为基准，保持均衡风格运行，量化策略表现正常。

基金自 2023 年 5 月开始运作，在基金投资运作方面，本基金以多因子量化投资策略为主，在依据量化模型进行股票投资决策之外，还积极参与了科创板、创业板新股申购，以获取收益增厚的机会。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 12 月 31 日，华夏国证 2000 指数增强发起式 A 基金份额净值为 0.9880 元，本报告期份额净值增长率为-1.20%；华夏国证 2000 指数增强发起式 C 基金份额净值为 0.9856 元，本报告期份额净值增长率为-1.44%，同期业绩比较基准增长率为-6.33%。本基金本报告期 A 类份额跟踪偏离度为+5.13%，C 类份额跟踪偏离度为+4.89%。

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 2024 年，发展经济成为政府工作重心，政府可能出台更多稳增长政策，货币政策将继续保持宽松，预计中国经济复苏有望加强。市场预计以震荡为主，行业或者风格板块可能持续保持轮动特征，建议均衡配置。

珍惜基金份额持有人的每一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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人持续加强合规管理、风险控制和监察稽核工作。

在合规管理方面，公司通过合规审核、合规检查、合规咨询、合规宣传与合规培训等对合规风险进行管理，确保公司合规体系高效运行，合规风险有效控制。报告期内，公司不断加强合规制度建设，结合法律法规和业务实际，在信息披露、洗钱风险管理、关联交易管理等方面新增和修订多项管理制度，制度化水平显著提高。持续开展合规培训，在全员覆盖的基础上，着重加强投资研究和基金销售等重点业务领域的合规督导培训，强化员工主动合规意识。积极优化合规管理的机制化和系统化，完善合规考核评价机制、子公司管理机制，大力推进合规管理综合服务、制度管理、知识搜索等系统化建设，提高合规管理效能。持续做好信息披露业务，通过流程优化、系统优化及强化培训持续保障信息披露的完整性、准确性、及时性。持续规范基金销售业务，通过严格审查宣传推介材料，认真开展投资者适当性管理工作等，确保基金销售业务依法合规。公司高度重视洗钱风险管理，深入实践风险为本方法，认真贯彻落实各项反洗钱监管要求，持续加强“风险评估+合规检查”双支柱管理框架，深入推进洗钱风险管理数智化转型，持续提升洗钱风险管理水平。

在风险控制方面，公司秉承数字化管理理念，持续完善内部风险管理系统建设，稳步夯实投资

风险管理基础。在严格管控基金日常投资运作风险的同时，持续完善风险管理制度建设，提升基金流动性风险、市场风险、合规风险、操作风险等关键风险的管控水平，努力保障各项风险管理措施落实到位。

在监察稽核方面，公司按照法规要求，做好日常合规监控，定期及不定期开展内部检查，排查业务风险隐患，促进公司整体业务合规运作、稳健经营。

报告期内，本基金管理人所管理的基金整体运作合法合规。本基金管理人将继续以风险控制为核心，坚持基金份额持有人利益优先的原则，提高监察稽核工作的科学性和有效性，切实保障基金合规稳健运作。

4.7 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。

4.8 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。

§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，基金托管人在华夏国证 2000 指数增强型发起式证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

本报告期内，华夏基金管理有限公司在华夏国证 2000 指数增强型发起式证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由华夏基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关华夏国证 2000 指数增强

型发起式证券投资基金的年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§6 审计报告

普华永道中天审字（2024）第 21504 号

华夏国证 2000 指数增强型发起式证券投资基金全体基金份额持有人：

6.1 审计意见

（一）我们审计的内容

我们审计了华夏国证 2000 指数增强型发起式证券投资基金(以下简称“华夏国证 2000 指数增强发起式”)的财务报表，包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表，2023 年 5 月 23 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日止期间的利润表和净资产变动表以及财务报表附注。

（二）我们的意见

我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了华夏国证 2000 指数增强发起式 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年 5 月 23 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

6.2 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于华夏国证 2000 指数增强发起式，并履行了职业道德方面的其他责任。

6.3 管理层和治理层对财务报表的责任

华夏国证 2000 指数增强发起式的基金管理人华夏基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估华夏国证 2000 指数增强发起式的持续经营能

力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算华夏国证 2000 指数增强发起式、终止运营或别无其他现实的选择。

基金管理人治理层负责监督华夏国证 2000 指数增强发起式的财务报告过程。

6.4 注册会计师对财务报表审计的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对华夏国证 2000 指数增强发起式持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致华夏国证 2000 指数增强发起式不能持续经营。

(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

中国注册会计师

朱宏宇 朱寅婷

上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼

2024 年 3 月 26 日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：华夏国证 2000 指数增强型发起式证券投资基金

报告截止日：2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日
资产：		
货币资金	7.4.7.1	1,996,835.41
结算备付金		246,458.25
存出保证金		8,216.38
交易性金融资产	7.4.7.2	19,413,839.84
其中：股票投资		19,396,775.90
基金投资		-
债券投资		17,063.94
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
其他投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
应收清算款		-
应收股利		-
应收申购款		551,434.57
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.5	-
资产总计		22,216,784.45
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日
负债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付清算款		245,570.60
应付赎回款		749,193.74
应付管理人报酬		14,846.81

应付托管费		2,783.77
应付销售服务费		2,751.74
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	7.4.7.6	73,208.99
负债合计		1,088,355.65
净资产：		
实收基金	7.4.7.7	21,403,896.84
未分配利润	7.4.7.8	-275,468.04
净资产合计		21,128,428.80
负债和净资产总计		22,216,784.45

注：①报告截止日 2023 年 12 月 31 日，华夏国证 2000 指数增强发起式 A 基金份额净值 0.9880 元，华夏国证 2000 指数增强发起式 C 基金份额净值 0.9856 元；华夏国证 2000 指数增强发起式基金份额总额 21,403,896.84 份（其中 A 类 13,483,818.23 份，C 类 7,920,078.61 份）。

②本基金合同于 2023 年 5 月 23 日生效，本报告期自 2023 年 5 月 23 日至 2023 年 12 月 31 日。

7.2 利润表

会计主体：华夏国证 2000 指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：2023 年 5 月 23 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 5 月 23 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
一、营业总收入		6,067.29
1.利息收入		3,637.13
其中：存款利息收入	7.4.7.9	3,637.13
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		-
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-17,311.06
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-160,630.13
基金投资收益	7.4.7.11	-
债券投资收益	7.4.7.12	9,593.45
资产支持证券投资收益	7.4.7.13	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-
股利收益	7.4.7.16	133,725.62
其他投资收益		-

3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	18,181.87
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	1,559.35
减：二、营业总支出		161,319.48
1.管理人报酬		95,137.75
2.托管费		17,838.27
3.销售服务费		17,123.60
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	7.4.7.20	-
7.税金及附加		-
8.其他费用	7.4.7.21	31,219.86
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-155,252.19
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-155,252.19
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		-155,252.19

注：本基金合同于 2023 年 5 月 23 日生效，本报告期自 2023 年 5 月 23 日至 2023 年 12 月 31 日。

7.3 净资产变动表

会计主体：华夏国证 2000 指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：2023 年 5 月 23 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 5 月 23 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-
二、本期期初净资产	19,019,828.28	-	19,019,828.28
三、本期增减变动额 （减少以“-”号填列）	2,384,068.56	-275,468.04	2,108,600.52
（一）、综合收益总额	-	-155,252.19	-155,252.19
（二）、本期基金份额 交易产生的净资产变 动数（净资产减少以 “-”号填列）	2,384,068.56	-120,215.85	2,263,852.71
其中：1.基金申购款	25,972,178.60	-235,576.85	25,736,601.75
2.基金赎回款	-23,588,110.04	115,361.00	-23,472,749.04

（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	21,403,896.84	-275,468.04	21,128,428.80

注：本基金合同于 2023 年 5 月 23 日生效，本报告期自 2023 年 5 月 23 日至 2023 年 12 月 31 日。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：张佑君，主管会计工作负责人：朱威，会计机构负责人：朱威

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

华夏国证 2000 指数增强型发起式证券投资基金（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]693 号文《关于准予华夏国证 2000 指数增强型发起式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》、《华夏国证 2000 指数增强型发起式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 4 月 24 日至 2023 年 5 月 19 日共募集 19,009,464.80 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_A24 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华夏国证 2000 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》于 2023 年 5 月 23 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 19,019,828.28 份基金份额，其中认购资金利息折合 10,363.48 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，基金托管人为交通银行股份有限公司。

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国证 2000 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）、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%，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。

7.4.2 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(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 7.4.4 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。

7.4.3 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。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 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 5 月 23 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 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业务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。

7.4.4.4 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。

7.4.4.5 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。

7.4.4.6 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。

7.4.4.7 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。

7.4.4.8 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）。

7.4.4.9 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。

7.4.4.10 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。

7.4.4.11 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。

7.4.4.12 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(包括涨跌停时的交易不活跃)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》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收

益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

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》及中国基金业协会中基协字[2022]566 号《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》之附件《关于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。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 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。

7.4.6 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》、财税[2023]39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》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。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日
活期存款	1,996,835.41
等于：本金	1,996,733.07
加：应计利息	102.34
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	1,996,835.41

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	19,379,056.02	-	19,396,775.90	17,719.88	
贵金属投资- 金交所黄金 合约	-	-	-	-	
债券	交易所 市场	16,600.00	1.95	17,063.94	461.99
	银行间 市场	-	-	-	-
	合计	16,600.00	1.95	17,063.94	461.99
资产支持证 券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	19,395,656.02	1.95	19,413,839.84	18,181.87	

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

7.4.7.5 其他资产

无。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 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	43,208.99
其中：交易所市场	43,208.99
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	30,000.00
合计	73,208.99

7.4.7.7 实收基金

华夏国证 2000 指数增强发起式 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年5月23日（基金合同生效日）至2023年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	12,140,412.47	12,140,412.47
本期申购	4,685,226.36	4,685,226.36
本期赎回（以“-”号填列）	-3,341,820.60	-3,341,820.60
本期末	13,483,818.23	13,483,818.23

华夏国证 2000 指数增强发起式 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年5月23日（基金合同生效日）至2023年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	6,879,415.81	6,879,415.81

本期申购	21,286,952.24	21,286,952.24
本期赎回（以“-”号填列）	-20,246,289.44	-20,246,289.44
本期末	7,920,078.61	7,920,078.61

注：本基金在募集期间共募集有效净认购资金 19,009,464.80 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 10,363.48 元在本基金合同生效后折算为 10,363.48 份基金份额，计入基金份额持有人账户。

7.4.7.8 未分配利润

华夏国证 2000 指数增强发起式 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	-129,740.39	-14,132.14	-143,872.53
本期基金份额交易产生的变动数	-18,280.14	667.41	-17,612.73
其中：基金申购款	21,544.16	-14,011.18	7,532.98
基金赎回款	-39,824.30	14,678.59	-25,145.71
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-148,020.53	-13,464.73	-161,485.26

华夏国证 2000 指数增强发起式 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	-43,693.67	32,314.01	-11,379.66
本期基金份额交易产生的变动数	-62,194.70	-40,408.42	-102,603.12
其中：基金申购款	-5,703.83	-237,406.00	-243,109.83
基金赎回款	-56,490.87	196,997.58	140,506.71
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-105,888.37	-8,094.41	-113,982.78

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 5 月 23 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	2,131.07
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	1,440.93
其他	65.13
合计	3,637.13

7.4.7.10 股票投资收益

7.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 5 月 23 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-160,630.13
股票投资收益——赎回差价收入	-
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	-160,630.13

7.4.7.10.2 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 5 月 23 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	154,814,099.65
减：卖出股票成本总额	154,699,206.66
减：交易费用	275,523.12
买卖股票差价收入	-160,630.13

7.4.7.11 基金投资收益

无。

7.4.7.12 债券投资收益

7.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年5月23日（基金合同生效日）至2023年12 月31日
债券投资收益——利息收入	7.96
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期 兑付）差价收入	9,585.49
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	9,593.45

7.4.7.12.2 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5月23日（基金合同生效日）至2023年12 月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	44,193.28

减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	34,600.00
减：应计利息总额	6.01
减：交易费用	1.78
买卖债券差价收入	9,585.49

7.4.7.13 资产支持证券投资收益

无。

7.4.7.14 贵金属投资收益

无。

7.4.7.15 衍生工具收益

7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年5月23日（基金合同生效日）至2023年12月31日
股票投资产生的股利收益	133,725.62
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	133,725.62

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年5月23日（基金合同生效日）至2023年12月31日
1.交易性金融资产	18,181.87
——股票投资	17,719.88
——债券投资	461.99
——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	18,181.87

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年5月23日（基金合同生效日）至2023年12月31日
基金赎回费收入	1,559.35
合计	1,559.35

7.4.7.19 持有基金产生的费用

无。

7.4.7.20 信用减值损失

无。

7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2023年5月23日（基金合同生效日）至2023年12月31日
审计费用	30,000.00
信息披露费	-
证券出借违约金	-
银行费用	819.86
其他	400.00
合计	31,219.86

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无或有事项。

7.4.8.2 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。

7.4.9 关联方关系

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
交通银行股份有限公司（“交通银行”）	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
MACKENZIE FINANCIAL CORPORATION	基金管理人的股东
天津海鹏科技咨询有限公司	基金管理人的股东
华夏股权投资基金管理(北京)有限公司	基金管理人的子公司
上海华夏财富投资管理有限公司 (“华夏财富”)	基金管理人的子公司
华夏资本管理有限公司 (“华夏资本”)	基金管理人的子公司
China Asset Management (Hong Kong) Limited (中文名: 华夏基金(香港)有限公司)	基金管理人的子公司
中信证券(山东)有限责任公司 (“中信证券(山东)”)	基金管理人第一大股东的子公司

注: 下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位: 人民币元

关联方名称	本期 2023年5月23日(基金合同生效日)至2023年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
中信证券	187,977,863.28	57.16%

7.4.10.1.2 权证交易

无。

7.4.10.1.3 债券交易

金额单位: 人民币元

关联方名称	本期 2023年5月23日(基金合同生效日)至2023年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例
中信证券	40,475.68	91.59%

7.4.10.1.4 债券回购交易

无。

7.4.10.1.5 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5月23日(基金合同生效日)至2023年12月31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	82,976.31	54.36%	11,864.72	27.46%

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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2023年5月23日（基金合同生效日）至2023年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	95,137.75
其中：应支付销售机构的客户维护费	19,456.34
应支付基金管理人的净管理费	75,681.41

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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2023年5月23日（基金合同生效日）至2023年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	17,838.27

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。

7.4.10.2.3 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5月23日（基金合同生效日）至2023年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华夏国证 2000 指数增强发起式 A	华夏国证 2000 指数增强发起式 C	合计
交通银行	-	4,356.83	4,356.83
华夏基金管理有 限公司	-	202.42	202.42
华夏财富	-	113.43	113.43
中信证券	-	45.13	45.13

中信证券（山东）	-	0.90	0.90
合计	-	4,718.71	4,718.71

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。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.10.4 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

7.4.10.4.1 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。

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2023年5月23日（基金合同生效日）至2023年12月31日	
	华夏国证2000指数增强发起式 A	华夏国证2000指数增强发起式 C
基金合同生效日（2023年5月23日）持有的基金份额	10,009,800.10	-
期初持有的基金份额	-	-
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	10,009,800.10	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	74.24%	-

注：本基金管理人于 2023 年 4 月 24 日认购本基金，认购费用为 100.00 元。

7.4.10.5.2 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。

7.4.10.6 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5月23日（基金合同生效日）至2023年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
交通银行活期存款	1,996,835.41	2,131.07

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

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

7.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配事项。

7.4.12 期末（2023 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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 (单 位： 股)	期末成 本总额	期末估 值总额	备注
127100	神码 转债	2023- 12-21	1 个月 内 (含)	新发 流通 受限	100.00	100.01	4	400.00	400.03	期末 估值 单价 为含 息价 格
127102	浙建 转债	2023- 12-25	1 个月 内 (含)	新发 流通 受限	100.00	100.00	81	8,100.00	8,100.25	期末 估值 单价 为含 息价 格
113069	博 23 转债	2023- 12-22	1 个月 内 (含)	新发 流通 受限	100.00	100.01	50	5,000.00	5,000.33	期末 估值 单价 为含

										息价格
--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	-----

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的风险管理政策是使基金投资风险可测、可控、可承担。本基金管理人建立了由风险管理委员会、督察长、法律部、合规部、稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的多层次风险管理架构体系。风险管理团队在识别、衡量投资风险后，通过正式报告的方式，将分析结果及时传达给基金经理、投资总监、投资决策委员会和风险管理委员会，协助制定风险控制决策，实现风险管理目标。

本基金管理人主要通过定性分析和定量分析的方法，估测各种金融工具风险可能产生的损失。本基金管理人从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重性；从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用的金融工具特征，通过特定的风险量化指标、模型和日常的量化报告，参考压力测试结果，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时对各种风险进行监督、检查和评估，并制定相应决策，将风险控制在预期可承受的范围内。

7.4.13.2 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。

7.4.13.3 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“7.4.12 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。

7.4.13.3.1 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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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，以国证 2000 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。

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 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	19,396,775.90	91.80
交易性金融资产—基金投资	-	-
交易性金融资产—债券投资	17,063.94	0.08
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	19,413,839.84	91.88

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。

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除国证 2000 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 12 月 31 日
	-5%	-1,040,750.63
	+5%	1,040,750.63

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 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 12 月 31 日	
	第一层次	19,400,339.23
第二层次	13,500.61	

第三层次	-
合计	19,413,839.84

7.4.14.2.2 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。

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

截至 2023 年 12 月 31 日止，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

7.4.14.4 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。

7.4.15 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。

§8 投资组合报告

8.1 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	19,396,775.90	87.31
	其中：股票	19,396,775.90	87.31
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	17,063.94	0.08
	其中：债券	17,063.94	0.08
	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	2,243,293.66	10.10

8	其他各项资产	559,650.95	2.52
9	合计	22,216,784.45	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	115,822.00	0.55
B	采矿业	57,370.00	0.27
C	制造业	10,768,509.90	50.97
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	316,644.00	1.50
E	建筑业	382,995.00	1.81
F	批发和零售业	198,464.00	0.94
G	交通运输、仓储和邮政业	357,655.00	1.69
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,093,070.00	9.91
J	金融业	83,464.00	0.40
K	房地产业	58,639.00	0.28
L	租赁和商务服务业	155,830.00	0.74
M	科学研究和技术服务业	597,416.00	2.83
N	水利、环境和公共设施管理业	233,736.00	1.11
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	116,706.00	0.55
R	文化、体育和娱乐业	423,384.00	2.00
S	综合	86,480.00	0.41
	合计	16,046,184.90	75.95

8.2.2 积极投资期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	5,085.00	0.02
C	制造业	2,245,460.00	10.63
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	26,544.00	0.13
E	建筑业	98,092.00	0.46

F	批发和零售业	86,274.00	0.41
G	交通运输、仓储和邮政业	5,788.00	0.03
H	住宿和餐饮业	1,562.00	0.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	264,458.00	1.25
J	金融业	96,596.00	0.46
K	房地产业	34,473.00	0.16
L	租赁和商务服务业	69,678.00	0.33
M	科学研究和技术服务业	44,450.00	0.21
N	水利、环境和公共设施管理业	332,243.00	1.57
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	39,888.00	0.19
S	综合	-	-
	合计	3,350,591.00	15.86

8.3 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

8.3.1 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	001339	智微智能	3,100	106,578.00	0.50
2	300505	川金诺	6,300	105,525.00	0.50
3	603396	金辰股份	1,900	103,835.00	0.49
4	000766	通化金马	5,200	103,688.00	0.49
5	688311	盟升电子	2,000	102,020.00	0.48
6	688213	思特威	1,800	100,008.00	0.47
7	300083	创世纪	15,700	99,381.00	0.47
8	300451	创业慧康	15,100	98,905.00	0.47
9	300687	赛意信息	4,500	98,010.00	0.46
10	300596	利安隆	3,300	97,548.00	0.46
11	301312	智立方	900	97,506.00	0.46
12	300358	楚天科技	9,100	97,370.00	0.46
13	300332	天壕能源	12,100	96,195.00	0.46
14	002238	天威视讯	6,100	94,733.00	0.45
15	002761	浙江建投	9,200	94,392.00	0.45
16	300725	药石科技	2,400	94,248.00	0.45
17	300443	金雷股份	3,400	93,806.00	0.44
18	300287	飞利信	23,300	93,666.00	0.44
19	300352	北信源	19,700	93,575.00	0.44
20	301162	国能日新	1,800	93,384.00	0.44
21	300613	富瀚微	2,200	93,368.00	0.44

22	300772	运达股份	8,700	92,568.00	0.44
23	002550	千红制药	15,700	92,316.00	0.44
24	300532	今天国际	5,600	91,952.00	0.44
25	300355	蒙草生态	24,500	91,875.00	0.43
26	002476	宝莫股份	14,300	91,806.00	0.43
27	300415	伊之密	5,200	91,676.00	0.43
28	300712	永福股份	3,400	91,120.00	0.43
29	300790	宇瞳光学	5,600	91,112.00	0.43
30	300894	火星人	5,600	90,944.00	0.43
31	300286	安科瑞	3,500	90,755.00	0.43
32	300490	华自科技	7,800	90,558.00	0.43
33	300437	清水源	7,200	90,504.00	0.43
34	603990	麦迪科技	7,000	90,440.00	0.43
35	301333	诺思格	1,400	90,272.00	0.43
36	300806	斯迪克	6,400	90,048.00	0.43
37	300005	探路者	13,600	90,032.00	0.43
38	300969	恒帅股份	1,000	89,870.00	0.43
39	300545	联得装备	2,600	89,830.00	0.43
40	002445	中南文化	37,900	89,823.00	0.43
41	300158	振东制药	13,300	89,775.00	0.42
42	688277	天智航	6,800	89,624.00	0.42
43	600108	亚盛集团	32,200	89,516.00	0.42
44	688560	明冠新材	4,800	89,376.00	0.42
45	300326	凯利泰	14,100	89,253.00	0.42
46	300990	同飞股份	2,000	89,020.00	0.42
47	300586	美联新材	11,000	88,990.00	0.42
48	300582	英飞特	7,400	88,874.00	0.42
49	300982	苏文电能	2,700	88,668.00	0.42
50	300681	英搏尔	4,600	88,642.00	0.42
51	300227	光韵达	11,300	88,592.00	0.42
52	688508	芯朋微	1,800	88,578.00	0.42
53	300119	瑞普生物	5,400	88,506.00	0.42
54	002546	新联电子	17,700	88,500.00	0.42
55	002646	天佑德酒	6,500	88,465.00	0.42
56	001338	永顺泰	7,300	88,038.00	0.42
57	300043	星辉娱乐	23,700	87,927.00	0.42
58	300680	隆盛科技	4,700	87,890.00	0.42
59	300787	海能实业	5,200	87,464.00	0.41
60	301117	佳缘科技	1,600	87,216.00	0.41
61	600125	铁龙物流	14,400	87,120.00	0.41
62	301103	何氏眼科	2,900	86,942.00	0.41
63	301046	能辉科技	3,200	86,784.00	0.41
64	002277	友阿股份	21,500	86,645.00	0.41
65	688299	长阳科技	6,200	86,490.00	0.41

66	600620	天宸股份	9,200	86,480.00	0.41
67	301150	中一科技	2,600	86,476.00	0.41
68	000557	西部创业	17,900	86,457.00	0.41
69	603330	天洋新材	11,400	86,412.00	0.41
70	603803	瑞斯康达	10,600	86,390.00	0.41
71	000510	新金路	15,200	86,184.00	0.41
72	301207	华兰疫苗	3,100	86,180.00	0.41
73	605300	佳禾食品	5,500	86,130.00	0.41
74	605060	联德股份	4,600	86,020.00	0.41
75	688089	嘉必优	4,800	85,920.00	0.41
75	300404	博济医药	9,600	85,920.00	0.41
75	300085	银之杰	6,000	85,920.00	0.41
78	002213	大为股份	6,100	85,827.00	0.41
79	603759	海天股份	10,300	85,593.00	0.41
80	300575	中旗股份	11,200	85,568.00	0.40
81	001323	慕思股份	2,800	85,400.00	0.40
82	003043	华亚智能	1,700	85,357.00	0.40
83	300249	依米康	9,900	85,338.00	0.40
84	301026	浩通科技	2,800	85,260.00	0.40
85	603167	渤海轮渡	9,600	85,248.00	0.40
86	603070	万控智造	5,300	85,118.00	0.40
87	000717	中南股份	33,500	85,090.00	0.40
88	603324	盛剑环境	2,800	85,036.00	0.40
89	603639	海利尔	5,400	84,780.00	0.40
90	300925	法本信息	7,200	84,600.00	0.40
91	300881	盛德鑫泰	3,300	84,414.00	0.40
92	300391	长药控股	10,900	84,366.00	0.40
93	300636	同和药业	8,000	84,320.00	0.40
94	688317	之江生物	4,000	83,920.00	0.40
95	600897	厦门空港	6,700	83,683.00	0.40
96	300645	正元智慧	4,600	83,674.00	0.40
97	002510	天汽模	17,200	83,592.00	0.40
98	301120	新特电气	7,200	83,448.00	0.39
99	002380	科远智慧	4,900	83,447.00	0.39
100	301439	泓淋电力	5,700	83,334.00	0.39
101	301246	宏源药业	3,200	83,136.00	0.39
102	600278	东方创业	11,900	83,062.00	0.39
103	000601	韶能股份	19,400	83,032.00	0.39
104	300732	设研院	9,400	83,002.00	0.39
105	688569	铁科轨道	3,000	82,830.00	0.39
106	603662	柯力传感	2,300	82,777.00	0.39
107	300887	谱尼测试	7,000	82,670.00	0.39
108	301129	瑞纳智能	3,100	82,553.00	0.39
109	300871	回盛生物	5,700	82,422.00	0.39

110	301322	绿通科技	2,000	82,320.00	0.39
111	301109	军信股份	5,200	82,160.00	0.39
112	603908	牧高笛	2,200	81,862.00	0.39
113	605577	龙版传媒	3,500	81,655.00	0.39
114	300757	罗博特科	1,000	81,390.00	0.39
115	301122	采纳股份	2,400	81,264.00	0.38
116	300795	米奥会展	2,200	81,114.00	0.38
117	300997	欢乐家	5,800	81,026.00	0.38
118	301058	中粮科工	7,400	80,882.00	0.38
119	688075	安旭生物	2,000	80,560.00	0.38
120	002232	启明信息	4,700	79,665.00	0.38
121	301345	涛涛车业	1,300	79,170.00	0.37
122	688372	伟测科技	1,000	78,400.00	0.37
123	300727	润禾材料	2,700	77,733.00	0.37
124	688533	上声电子	2,000	76,240.00	0.36
125	301025	读客文化	6,700	76,045.00	0.36
126	688182	灿勤科技	4,000	71,120.00	0.34
127	300062	中能电气	11,400	71,022.00	0.34
128	688371	菲沃泰	3,800	66,918.00	0.32
129	300228	富瑞特装	8,500	60,350.00	0.29
130	603153	上海建科	2,800	59,164.00	0.28
131	001223	欧克科技	900	55,395.00	0.26
132	603222	济民医疗	6,800	54,468.00	0.26
133	688103	国力股份	1,000	49,380.00	0.23
134	300250	初灵信息	2,600	45,318.00	0.21
135	003026	中晶科技	1,000	35,800.00	0.17
136	600312	平高电气	2,800	35,532.00	0.17
137	002878	元隆雅图	1,900	35,359.00	0.17
138	300232	洲明科技	4,000	35,200.00	0.17
139	300762	上海瀚讯	2,300	34,684.00	0.16
140	600201	生物股份	3,200	34,464.00	0.16
141	300745	欣锐科技	1,200	32,604.00	0.15
142	688575	亚辉龙	1,400	32,018.00	0.15
143	603328	依顿电子	3,900	31,785.00	0.15
144	000737	北方铜业	5,300	30,740.00	0.15
145	300638	广和通	1,600	30,448.00	0.14
146	300662	科锐国际	1,100	30,382.00	0.14
147	600420	国药现代	3,100	30,349.00	0.14
148	603063	禾望电气	1,200	30,000.00	0.14
149	300143	盈康生命	2,800	29,764.00	0.14
150	603969	银龙股份	4,900	29,400.00	0.14
151	002635	安洁科技	1,800	29,394.00	0.14
152	600761	安徽合力	1,600	29,136.00	0.14
153	600285	羚锐制药	1,700	29,087.00	0.14

154	600055	万东医疗	1,700	29,036.00	0.14
155	002158	汉钟精机	1,300	28,938.00	0.14
156	688106	金宏气体	1,200	28,908.00	0.14
157	003012	东鹏控股	3,500	28,875.00	0.14
158	600391	航发科技	1,500	28,680.00	0.14
159	688239	航宇科技	600	28,662.00	0.14
160	601137	博威合金	1,800	27,954.00	0.13
161	688127	蓝特光学	1,200	27,948.00	0.13
162	601801	皖新传媒	4,000	27,800.00	0.13
163	000426	兴业银锡	2,900	26,332.00	0.12
164	002126	银轮股份	1,400	26,138.00	0.12
165	300166	东方国信	2,700	25,380.00	0.12
166	002017	东信和平	2,370	24,671.70	0.12
167	300132	青松股份	4,600	24,012.00	0.11
168	600643	爱建集团	4,700	23,970.00	0.11
169	000543	皖能电力	3,800	23,788.00	0.11
170	002100	天康生物	2,700	23,679.00	0.11
171	300369	绿盟科技	2,500	23,575.00	0.11
172	000923	河钢资源	1,400	23,520.00	0.11
173	002130	沃尔核材	3,100	23,405.00	0.11
174	002233	塔牌集团	3,300	23,364.00	0.11
175	002649	博彦科技	1,900	23,313.00	0.11
176	300035	中科电气	2,200	23,188.00	0.11
177	600810	神马股份	3,100	23,064.00	0.11
178	600063	皖维高新	5,200	22,360.00	0.11
179	002283	天润工业	3,800	22,230.00	0.11
180	002832	比音勒芬	700	22,190.00	0.11
181	300768	迪普科技	1,500	22,170.00	0.10
182	002545	东方铁塔	3,100	22,165.00	0.10
183	002218	拓日新能	4,900	22,099.00	0.10
184	300860	锋尚文化	400	21,852.00	0.10
185	688206	概伦电子	1,000	21,800.00	0.10
186	600158	中体产业	2,800	21,784.00	0.10
187	300348	长亮科技	2,100	21,651.00	0.10
188	002641	公元股份	4,300	21,629.00	0.10
189	600255	鑫科材料	9,700	21,437.00	0.10
190	600284	浦东建设	3,400	21,420.00	0.10
191	000065	北方国际	1,900	21,318.00	0.10
192	300738	奥飞数据	2,000	21,180.00	0.10
193	002891	中宠股份	800	21,080.00	0.10
194	002733	雄韬股份	1,400	21,056.00	0.10
195	002583	海能达	3,500	20,825.00	0.10
196	002516	旷达科技	4,200	20,706.00	0.10
197	688007	光峰科技	800	20,704.00	0.10

198	601019	山东出版	2,200	20,636.00	0.10
199	688018	乐鑫科技	200	20,590.00	0.10
200	002204	大连重工	4,500	20,565.00	0.10
201	300133	华策影视	3,500	20,545.00	0.10
202	688128	中国电研	1,000	20,520.00	0.10
203	603208	江山欧派	680	20,189.20	0.10
204	603113	金能科技	2,500	20,175.00	0.10
205	002948	青岛银行	6,600	20,130.00	0.10
206	600618	氯碱化工	2,200	20,020.00	0.09
207	300900	广联航空	800	19,744.00	0.09
208	301219	腾远钴业	500	19,685.00	0.09
209	603301	振德医疗	800	19,600.00	0.09
210	300702	天宇股份	900	19,539.00	0.09
211	002099	海翔药业	2,700	19,413.00	0.09
212	300323	华灿光电	2,600	19,032.00	0.09
213	601890	亚星锚链	1,900	18,810.00	0.09
214	600186	莲花健康	3,100	18,755.00	0.09
215	600488	津药药业	3,800	18,620.00	0.09
215	000517	荣安地产	7,600	18,620.00	0.09
217	300102	乾照光电	2,500	18,375.00	0.09
218	603920	世运电路	1,000	18,280.00	0.09
219	300698	万马科技	500	18,250.00	0.09
220	300758	七彩化学	1,800	18,198.00	0.09
221	300177	中海达	2,500	17,975.00	0.09
222	002578	闽发铝业	4,000	17,920.00	0.08
223	688173	希荻微	1,000	17,590.00	0.08
224	301278	快可电子	300	17,475.00	0.08
225	002367	康力电梯	2,300	17,296.00	0.08
226	002642	荣联科技	2,000	17,160.00	0.08
227	000555	神州信息	1,500	16,935.00	0.08
228	300492	华图山鼎	200	16,934.00	0.08
229	000409	云鼎科技	1,800	16,668.00	0.08
230	603530	神马电力	800	16,592.00	0.08
231	300752	隆利科技	900	16,353.00	0.08
232	002452	长高电新	2,300	16,330.00	0.08
233	300400	劲拓股份	1,000	16,290.00	0.08
234	300091	金通灵	6,100	16,287.00	0.08
235	300040	九洲集团	2,900	16,240.00	0.08
236	300691	联合光电	700	16,233.00	0.08
237	000836	富通信息	6,000	16,080.00	0.08
238	002119	康强电子	1,200	16,044.00	0.08
239	002125	湘潭电化	1,500	16,035.00	0.08
240	300041	回天新材	1,600	16,032.00	0.08
241	603599	广信股份	1,100	15,950.00	0.08

241	002588	史丹利	2,500	15,950.00	0.08
243	300831	派瑞股份	1,300	15,938.00	0.08
244	002590	万安科技	1,400	15,918.00	0.08
245	300850	新强联	500	15,915.00	0.08
246	600360	华微电子	2,200	15,906.00	0.08
247	600601	方正科技	5,500	15,895.00	0.08
248	002577	雷柏科技	900	15,867.00	0.08
249	002440	闰土股份	2,600	15,860.00	0.08
250	601163	三角轮胎	1,100	15,851.00	0.08
251	002681	奋达科技	3,200	15,840.00	0.07
252	600776	东方通信	1,400	15,806.00	0.07
253	002772	众兴菌业	2,000	15,780.00	0.07
254	300032	金龙机电	2,500	15,775.00	0.07
255	603281	江瀚新材	600	15,774.00	0.07
256	002469	三维化学	2,600	15,756.00	0.07
257	603629	利通电子	500	15,730.00	0.07
257	300569	天能重工	2,200	15,730.00	0.07
259	002491	通鼎互联	3,000	15,720.00	0.07
260	300696	爱乐达	900	15,669.00	0.07
261	300066	三川智慧	3,100	15,655.00	0.07
262	603515	欧普照明	900	15,642.00	0.07
263	002941	新疆交建	1,200	15,624.00	0.07
264	600780	通宝能源	1,900	15,580.00	0.07
265	301179	泽宇智能	600	15,570.00	0.07
266	603507	振江股份	600	15,546.00	0.07
267	002096	易普力	1,500	15,540.00	0.07
268	002839	张家港行	4,000	15,520.00	0.07
269	002062	宏润建设	3,500	15,505.00	0.07
270	300291	百纳千成	2,400	15,456.00	0.07
271	300315	掌趣科技	3,000	15,450.00	0.07
272	600318	新力金融	2,200	15,444.00	0.07
273	300426	唐德影视	1,400	15,442.00	0.07
274	002551	尚荣医疗	3,800	15,428.00	0.07
275	603058	永吉股份	1,700	15,419.00	0.07
276	600512	腾达建设	6,200	15,376.00	0.07
276	002611	东方精工	3,100	15,376.00	0.07
278	002582	好想你	2,000	15,340.00	0.07
279	300197	节能铁汉	7,400	15,318.00	0.07
280	300802	矩子科技	800	15,296.00	0.07
281	600658	电子城	3,400	15,198.00	0.07
282	300942	易瑞生物	1,300	15,197.00	0.07
283	605199	葫芦娃	1,000	15,160.00	0.07
284	000755	山西路桥	3,300	15,147.00	0.07
285	600965	福成股份	2,400	15,144.00	0.07

286	688358	祥生医疗	400	15,112.00	0.07
287	600133	东湖高新	1,400	15,078.00	0.07
288	301302	华如科技	600	15,066.00	0.07
289	300614	百川畅银	800	14,984.00	0.07
290	603255	鼎际得	400	14,920.00	0.07
291	688185	康希诺	200	14,904.00	0.07
292	603200	上海洗霸	700	14,903.00	0.07
293	600206	有研新材	1,200	14,868.00	0.07
294	002923	润都股份	1,200	14,808.00	0.07
295	688665	四方光电	200	14,752.00	0.07
296	688768	容知日新	400	14,724.00	0.07
297	300813	泰林生物	600	14,712.00	0.07
298	603367	辰欣药业	1,000	14,640.00	0.07
299	300379	东方通	800	14,624.00	0.07
300	300893	松原股份	500	14,615.00	0.07
301	603235	天新药业	600	14,424.00	0.07
302	002991	甘源食品	200	14,292.00	0.07
303	688208	道通科技	600	14,250.00	0.07
304	600986	浙文互联	2,600	14,196.00	0.07
305	002869	金溢科技	700	14,168.00	0.07
306	600088	中视传媒	1,100	14,124.00	0.07
307	002332	仙琚制药	1,100	14,047.00	0.07
308	002467	二六三	3,000	13,920.00	0.07
309	000682	东方电子	1,700	13,685.00	0.06
310	003006	百亚股份	900	13,644.00	0.06
311	603566	普莱柯	600	13,590.00	0.06
312	603220	中贝通信	400	13,584.00	0.06
313	300049	福瑞股份	300	13,077.00	0.06
314	301031	中熔电气	100	13,076.00	0.06
315	603057	紫燕食品	600	12,948.00	0.06
316	603308	应流股份	900	12,897.00	0.06
317	301051	信濠光电	200	12,734.00	0.06
318	002020	京新药业	1,000	12,720.00	0.06
319	002214	大立科技	1,100	12,617.00	0.06
320	001270	铖昌科技	200	12,542.00	0.06
321	002859	洁美科技	500	12,475.00	0.06
322	688212	澳华内镜	200	12,406.00	0.06
323	002913	奥士康	400	12,260.00	0.06
324	002918	蒙娜丽莎	900	12,186.00	0.06
325	600480	凌云股份	1,300	11,843.00	0.06
326	688201	信安世纪	600	11,808.00	0.06
327	301080	百普赛斯	200	11,788.00	0.06
328	002759	天际股份	1,100	11,671.00	0.06
329	301369	联动科技	200	11,574.00	0.05

330	301391	卡莱特	100	11,448.00	0.05
331	688330	宏力达	400	11,364.00	0.05
332	603601	再升科技	2,500	10,750.00	0.05
333	688626	翔宇医疗	200	10,658.00	0.05
334	600572	康恩贝	2,100	10,605.00	0.05
335	688601	力芯微	200	10,478.00	0.05
336	600389	江山股份	600	10,440.00	0.05
337	002840	华统股份	500	10,395.00	0.05
338	002645	华宏科技	900	10,170.00	0.05
339	600888	新疆众和	1,400	10,136.00	0.05
340	002664	信质集团	600	9,978.00	0.05
341	600997	开滦股份	1,300	9,919.00	0.05
342	002139	拓邦股份	1,000	9,760.00	0.05
343	000550	江铃汽车	500	9,515.00	0.05
344	603061	金海通	100	9,498.00	0.04
345	002449	国星光电	1,000	9,470.00	0.04
346	003021	兆威机电	100	9,399.00	0.04
347	002041	登海种业	700	9,261.00	0.04
348	002148	北纬科技	1,500	9,060.00	0.04
349	300708	聚灿光电	800	9,024.00	0.04
350	000600	建投能源	1,800	9,018.00	0.04
351	000034	神州数码	300	8,973.00	0.04
352	300441	鲍斯股份	1,300	8,957.00	0.04
353	002419	天虹股份	1,600	8,848.00	0.04
354	300318	博晖创新	1,400	8,736.00	0.04
355	002765	蓝黛科技	1,300	8,723.00	0.04
356	002815	崇达技术	900	8,622.00	0.04
357	605338	巴比食品	400	8,592.00	0.04
358	600216	浙江医药	800	8,584.00	0.04
359	000589	贵州轮胎	1,400	8,568.00	0.04
360	003000	劲仔食品	700	8,554.00	0.04
361	002073	软控股份	1,300	8,541.00	0.04
362	601126	四方股份	600	8,496.00	0.04
363	002270	华明装备	600	8,472.00	0.04
364	603093	南华期货	700	8,400.00	0.04
365	601388	怡球资源	3,200	8,384.00	0.04
366	002376	新北洋	1,100	8,382.00	0.04
367	300634	彩讯股份	400	8,188.00	0.04
368	600478	科力远	1,600	7,872.00	0.04
369	688499	利元亨	200	7,616.00	0.04
370	603727	博迈科	600	7,518.00	0.04
371	002987	京北方	400	7,432.00	0.04
372	300099	尤洛卡	1,200	7,428.00	0.04
373	002662	京威股份	2,100	7,371.00	0.03

374	603136	天目湖	400	7,348.00	0.03
375	002448	中原内配	1,100	7,304.00	0.03
376	688676	金盘科技	200	7,166.00	0.03
377	603103	横店影视	400	7,112.00	0.03
378	300520	科大国创	300	6,522.00	0.03
379	600855	航天长峰	600	6,432.00	0.03
380	688403	汇成股份	600	6,330.00	0.03
381	000612	焦作万方	1,100	6,325.00	0.03
382	603612	索通发展	400	6,156.00	0.03
383	300739	明阳电路	400	6,124.00	0.03
384	002006	精工科技	400	6,112.00	0.03
385	300463	迈克生物	400	6,028.00	0.03
386	605599	菜百股份	400	5,956.00	0.03
387	002344	海宁皮城	1,400	5,740.00	0.03
388	603197	保隆科技	100	5,640.00	0.03
389	600162	香江控股	3,200	5,568.00	0.03
390	300718	长盛轴承	300	5,565.00	0.03
391	002063	远光软件	900	5,562.00	0.03
392	600458	时代新材	600	5,526.00	0.03
393	300386	飞天诚信	500	5,365.00	0.03
394	002567	唐人神	700	5,250.00	0.02
395	603299	苏盐井神	600	5,112.00	0.02
396	000607	华媒控股	1,100	5,038.00	0.02
397	000913	钱江摩托	400	4,988.00	0.02
398	002697	红旗连锁	1,000	4,980.00	0.02
399	600351	亚宝药业	700	4,830.00	0.02
400	300546	雄帝科技	300	4,731.00	0.02
401	000036	华联控股	1,200	4,668.00	0.02
402	000901	航天科技	500	4,660.00	0.02
403	601330	绿色动力	700	4,648.00	0.02
404	603766	隆鑫通用	900	4,644.00	0.02
405	002435	长江健康	1,100	4,587.00	0.02
406	601921	浙版传媒	600	4,584.00	0.02
407	603187	海容冷链	300	4,548.00	0.02
408	603626	科森科技	500	4,545.00	0.02
409	000680	山推股份	900	4,446.00	0.02
410	605007	五洲特纸	300	4,413.00	0.02
411	002284	亚太股份	500	4,385.00	0.02
412	601038	一拖股份	300	4,371.00	0.02
413	002768	国恩股份	200	4,284.00	0.02
414	002296	辉煌科技	500	4,125.00	0.02
415	000990	诚志股份	500	4,105.00	0.02
416	600557	康缘药业	200	4,104.00	0.02
417	603348	文灿股份	100	3,880.00	0.02

418	605222	起帆电缆	200	3,856.00	0.02
419	600223	福瑞达	400	3,852.00	0.02
420	603611	诺力股份	200	3,786.00	0.02
421	002876	三利谱	100	3,677.00	0.02
422	603171	税友股份	100	3,538.00	0.02
423	000029	深深房 A	300	3,528.00	0.02
424	300263	隆华科技	500	3,520.00	0.02
425	300389	艾比森	200	3,468.00	0.02
426	002911	佛燃能源	300	3,438.00	0.02
427	001696	宗申动力	500	3,315.00	0.02
428	000061	农产品	500	3,235.00	0.02
429	300272	开能健康	500	3,100.00	0.01
430	603681	永冠新材	200	3,020.00	0.01
431	002171	楚江新材	400	2,992.00	0.01
432	603100	川仪股份	100	2,772.00	0.01
433	605133	嵘泰股份	100	2,767.00	0.01
434	000560	我爱我家	1,200	2,700.00	0.01
435	600552	凯盛科技	200	2,666.00	0.01
436	002334	英威腾	300	2,619.00	0.01
437	002937	兴瑞科技	100	2,606.00	0.01
438	600587	新华医疗	100	2,579.00	0.01
439	603983	丸美股份	100	2,527.00	0.01
440	002533	金杯电工	300	2,424.00	0.01
441	600266	城建发展	500	2,420.00	0.01
442	300377	赢时胜	300	2,328.00	0.01
443	600446	金证股份	200	2,314.00	0.01
444	600293	三峡新材	600	2,184.00	0.01
445	000926	福星股份	500	2,085.00	0.01
446	601789	宁波建工	500	2,070.00	0.01
447	300397	天和防务	200	2,064.00	0.01
448	002318	久立特材	100	1,988.00	0.01
449	600797	浙大网新	300	1,968.00	0.01
450	605377	华旺科技	100	1,909.00	0.01
451	002023	海特高新	200	1,820.00	0.01
452	300729	乐歌股份	100	1,791.00	0.01
453	603138	海量数据	100	1,780.00	0.01
454	002845	同兴达	100	1,775.00	0.01
455	002351	漫步者	100	1,767.00	0.01
456	600664	哈药股份	500	1,675.00	0.01
457	601500	通用股份	400	1,656.00	0.01
458	002539	云图控股	200	1,650.00	0.01
459	600114	东睦股份	100	1,549.00	0.01
460	300292	吴通控股	400	1,488.00	0.01
460	600576	祥源文旅	200	1,488.00	0.01

462	300815	玉禾田	100	1,460.00	0.01
463	002522	浙江众成	300	1,443.00	0.01
464	600502	安徽建工	300	1,395.00	0.01
465	002011	盾安环境	100	1,375.00	0.01
466	000650	仁和药业	200	1,326.00	0.01
467	002324	普利特	100	1,315.00	0.01
468	000592	平潭发展	500	1,265.00	0.01
469	301149	隆华新材	100	1,237.00	0.01
470	002609	捷顺科技	100	1,142.00	0.01
471	002154	报喜鸟	200	1,136.00	0.01
472	002237	恒邦股份	100	1,078.00	0.01
473	603718	海利生物	100	1,071.00	0.01
474	300686	智动力	100	1,058.00	0.01
475	600475	华光环能	100	1,040.00	0.00
476	002116	中国海诚	100	1,029.00	0.00
477	688660	电气风电	200	1,028.00	0.00
478	002053	云南能投	100	962.00	0.00
479	600218	全柴动力	100	957.00	0.00
480	001208	华菱线缆	100	929.00	0.00
481	002587	奥拓电子	100	857.00	0.00
482	002093	国脉科技	100	752.00	0.00

8.3.2 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	301040	中环海陆	4,400.00	83,468.00	0.40
2	301033	迈普医学	1,900.00	82,726.00	0.39
3	300626	华瑞股份	7,600.00	82,460.00	0.39
4	300816	艾可蓝	3,300.00	81,411.00	0.39
5	300697	电工合金	6,300.00	81,396.00	0.39
6	301323	新莱福	2,200.00	81,378.00	0.39
7	301157	华塑科技	1,900.00	81,320.00	0.38
8	301163	宏德股份	3,000.00	81,300.00	0.38
9	600083	博信股份	10,200.00	81,294.00	0.38
10	301212	联盛化学	3,000.00	81,000.00	0.38
10	300756	金马游乐	5,000.00	81,000.00	0.38
12	688178	万德斯	4,400.00	79,552.00	0.38
13	300824	北鼎股份	8,800.00	79,464.00	0.38
14	603955	大千生态	5,400.00	79,326.00	0.38
15	688314	康拓医疗	2,400.00	78,984.00	0.37
16	001227	兰州银行	30,300.00	78,780.00	0.37
17	300692	中环环保	12,700.00	78,740.00	0.37
18	300995	奇德新材	3,700.00	78,699.00	0.37

19	002861	瀛通通讯	5,300.00	78,546.00	0.37
20	688466	金科环境	4,400.00	78,100.00	0.37
21	301159	三维天地	1,700.00	77,571.00	0.37
22	603038	华立股份	6,700.00	77,385.00	0.37
23	301399	英特科技	2,000.00	76,540.00	0.36
24	688171	纬德信息	3,400.00	76,500.00	0.36
25	300993	玉马遮阳	6,700.00	73,566.00	0.35
26	603029	天鹅股份	3,600.00	73,440.00	0.35
27	603729	龙韵股份	2,100.00	69,678.00	0.33
28	301070	开勒股份	1,500.00	67,290.00	0.32
29	688047	龙芯中科	600.00	66,366.00	0.31
30	301257	普蕊斯	700.00	44,450.00	0.21
31	301226	祥明智能	1,500.00	34,245.00	0.16
32	600535	天士力	1,600.00	27,232.00	0.13
33	300017	网宿科技	2,900.00	22,765.00	0.11
34	600867	通化东宝	2,100.00	22,743.00	0.11
35	002395	双象股份	1,100.00	22,154.00	0.10
36	000050	深天马 A	2,000.00	21,300.00	0.10
37	300027	华谊兄弟	7,800.00	20,904.00	0.10
38	300383	光环新网	2,000.00	19,440.00	0.09
39	002373	千方科技	1,700.00	19,057.00	0.09
40	000729	燕京啤酒	2,200.00	18,986.00	0.09
41	600161	天坛生物	600.00	18,564.00	0.09
42	002285	世联行	7,500.00	18,075.00	0.09
43	603228	景旺电子	800.00	18,048.00	0.09
44	301118	恒光股份	700.00	17,101.00	0.08
45	603717	天域生态	2,200.00	16,918.00	0.08
46	688607	康众医疗	800.00	16,304.00	0.08
47	603041	美思德	1,200.00	16,152.00	0.08
48	603236	移远通信	300.00	16,125.00	0.08
49	688628	优利德	400.00	15,760.00	0.07
50	301317	鑫磊股份	800.00	15,728.00	0.07
51	001225	和泰机电	400.00	15,692.00	0.07
52	300670	大烨智能	2,000.00	15,660.00	0.07
53	301079	邵阳液压	900.00	15,570.00	0.07
54	603016	新宏泰	700.00	15,533.00	0.07
55	300196	长海股份	1,400.00	15,232.00	0.07
56	301197	工大科雅	800.00	15,032.00	0.07
57	301009	可靠股份	1,400.00	14,924.00	0.07
58	301373	凌玮科技	500.00	14,825.00	0.07
59	000423	东阿阿胶	300.00	14,796.00	0.07
60	605169	洪通燃气	1,300.00	14,729.00	0.07
61	600234	科新发展	1,700.00	14,722.00	0.07
62	300644	南京聚隆	700.00	14,525.00	0.07

63	301158	德石股份	900.00	14,481.00	0.07
64	301305	朗坤环境	800.00	14,440.00	0.07
65	301019	宁波色母	600.00	14,418.00	0.07
66	001336	楚环科技	500.00	14,360.00	0.07
67	000014	沙河股份	1,300.00	14,313.00	0.07
68	301181	标榜股份	500.00	14,115.00	0.07
69	688273	麦澜德	400.00	13,324.00	0.06
70	301229	纽泰格	400.00	13,300.00	0.06
71	688350	富淼科技	800.00	13,224.00	0.06
72	301220	亚香股份	400.00	13,220.00	0.06
73	688772	珠海冠宇	600.00	13,206.00	0.06
74	301283	聚胶股份	400.00	13,152.00	0.06
75	002472	双环传动	500.00	13,010.00	0.06
76	301258	富士莱	400.00	12,912.00	0.06
77	600699	均胜电子	700.00	12,572.00	0.06
78	688004	博汇科技	400.00	11,748.00	0.06
79	002984	森麒麟	400.00	11,540.00	0.05
80	002739	万达电影	800.00	10,416.00	0.05
81	600037	歌华有线	1,300.00	10,049.00	0.05
82	002249	大洋电机	2,000.00	9,940.00	0.05
83	600707	彩虹股份	1,400.00	9,450.00	0.04
84	600110	诺德股份	1,600.00	9,024.00	0.04
85	600808	马钢股份	3,300.00	8,976.00	0.04
86	600977	中国电影	700.00	8,568.00	0.04
87	601108	财通证券	1,000.00	7,760.00	0.04
88	603088	宁波精达	900.00	7,758.00	0.04
89	600038	中直股份	200.00	7,706.00	0.04
90	002568	百润股份	300.00	7,383.00	0.03
91	002745	木林森	800.00	6,928.00	0.03
92	000902	新洋丰	600.00	6,834.00	0.03
93	000338	潍柴动力	500.00	6,825.00	0.03
94	601336	新华保险	200.00	6,226.00	0.03
95	603056	德邦股份	400.00	5,788.00	0.03
96	300253	卫宁健康	800.00	5,752.00	0.03
97	002558	巨人网络	500.00	5,570.00	0.03
98	300800	力合科技	400.00	5,468.00	0.03
99	002706	良信股份	600.00	5,298.00	0.03
100	002608	江苏国信	800.00	5,256.00	0.02
101	300230	永利股份	1,300.00	5,239.00	0.02
102	001203	大中矿业	500.00	5,085.00	0.02
103	603233	大参林	200.00	4,980.00	0.02
104	603298	杭叉集团	200.00	4,976.00	0.02
105	601231	环旭电子	300.00	4,533.00	0.02
106	002463	沪电股份	200.00	4,424.00	0.02

107	300034	钢研高纳	200.00	4,070.00	0.02
108	002396	星网锐捷	200.00	3,614.00	0.02
109	603027	千禾味业	200.00	3,234.00	0.02
110	600011	华能国际	400.00	3,080.00	0.01
111	002595	豪迈科技	100.00	2,977.00	0.01
112	300092	科新机电	200.00	2,664.00	0.01
113	601601	中国太保	100.00	2,378.00	0.01
114	300741	华宝股份	100.00	2,141.00	0.01
115	000514	渝开发	500.00	2,085.00	0.01
116	601068	中铝国际	400.00	1,848.00	0.01
117	002429	兆驰股份	300.00	1,674.00	0.01
118	600160	巨化股份	100.00	1,649.00	0.01
119	600258	首旅酒店	100.00	1,562.00	0.01
120	000539	粤电力 A	300.00	1,467.00	0.01
121	002360	同德化工	200.00	1,460.00	0.01
122	600901	江苏金租	300.00	1,452.00	0.01
123	002402	和而泰	100.00	1,429.00	0.01
124	002056	横店东磁	100.00	1,354.00	0.01
125	002152	广电运通	100.00	1,226.00	0.01
126	000598	兴蓉环境	200.00	1,138.00	0.01
127	603010	万盛股份	100.00	1,079.00	0.01
128	002790	瑞尔特	100.00	1,044.00	0.00
129	002153	石基信息	100.00	974.00	0.00
130	001896	豫能控股	200.00	874.00	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	600165	宁科生物	361,991.00	1.71
2	002519	银河电子	356,296.00	1.69
3	601218	吉鑫科技	355,502.00	1.68
4	300830	金现代	352,080.00	1.67
5	300638	广和通	351,697.00	1.66
6	002017	东信和平	344,883.00	1.63
7	300143	盈康生命	342,222.00	1.62
8	301195	北路智控	341,509.50	1.62
9	600158	中体产业	336,923.48	1.59
10	301268	铭利达	332,579.00	1.57
11	600651	飞乐音响	328,129.00	1.55
12	300318	博晖创新	326,821.00	1.55

13	300443	金雷股份	326,671.00	1.55
14	300085	银之杰	318,250.00	1.51
15	300887	谱尼测试	317,064.00	1.50
16	300232	洲明科技	316,987.00	1.50
17	300326	凯利泰	312,544.00	1.48
18	300332	天壕能源	311,865.00	1.48
19	300132	青松股份	310,850.00	1.47
20	002111	威海广泰	308,024.00	1.46

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。

8.4.2 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	300830	金现代	374,408.00	1.77
2	002519	银河电子	362,649.00	1.72
3	601218	吉鑫科技	352,495.00	1.67
4	600165	宁科生物	349,015.00	1.65
5	301195	北路智控	344,847.00	1.63
6	600651	飞乐音响	331,645.00	1.57
7	301268	铭利达	322,220.54	1.53
8	002017	东信和平	317,950.00	1.50
9	600158	中体产业	314,561.00	1.49
10	300318	博晖创新	313,067.00	1.48
11	600841	动力新科	309,410.00	1.46
12	605339	南侨食品	304,752.00	1.44
13	300638	广和通	302,365.80	1.43
14	002111	威海广泰	302,293.00	1.43
15	300143	盈康生命	298,952.00	1.41
16	688225	亚信安全	295,543.92	1.40
17	002168	惠程科技	294,095.00	1.39
18	002022	科华生物	293,785.00	1.39
19	300472	新元科技	292,975.00	1.39
20	603377	东方时尚	292,632.00	1.39

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。

8.4.3 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	174,078,262.68
卖出股票收入（成交）总额	154,814,099.65

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。

8.5 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）	17,063.94	0.08
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	17,063.94	0.08

8.6 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	127102	浙建转债	81	8,100.25	0.04
2	113069	博 23 转债	50	5,000.33	0.02
3	113679	芯能转债	30	3,434.22	0.02
4	127100	神码转债	4	400.03	0.00
5	123232	金现转债	1	129.11	0.00

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 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。

8.11.2 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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。

8.12.2 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。

8.12.3 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	8,216.38
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	551,434.57
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	559,650.95

8.12.4 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。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 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。

8.12.5.2 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。

8.12.6 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。

§9 基金份额持有人信息

9.1 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
华夏国证 2000 指数增强发起式 A	269	50,125.72	10,116,743.24	75.03%	3,367,074.99	24.97%
华夏国证 2000 指数增强发起式 C	1,754	4,515.44	500,000.00	6.31%	7,420,078.61	93.69%
合计	2,023	10,580.28	10,616,743.24	49.60%	10,787,153.60	50.40%

9.2 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	华夏国证 2000 指数增强发起式 A	892,709.78	6.62%
	华夏国证 2000 指数增强发起式 C	-	-
	合计	892,709.78	4.17%

9.3 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	华夏国证 2000 指数增强发起式 A	0
	华夏国证 2000 指数增强发起式 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	华夏国证 2000 指数增强发起式 A	0
	华夏国证 2000 指数增强发起式 C	0
	合计	0

9.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,009,800.10	46.77%	10,000,000.00	46.72%	不少于三年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人	-	-	-	-	-

员					
基金管理人股 东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,009,800.10	46.77%	10,000,000.00	46.72%	不少于三年

§10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华夏国证 2000 指数增强发起式 A	华夏国证 2000 指数 增强发起式 C
基金合同生效日(2023 年 5 月 23 日) 基金份额总额	12,140,412.47	6,879,415.81
基金合同生效日起至报告期 期末基金总申购份额	4,685,226.36	21,286,952.24
减：基金合同生效日起至报告 期期末基金总赎回份额	3,341,820.60	20,246,289.44
基金合同生效日起至报告期 期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	13,483,818.23	7,920,078.61

注：本基金合同于 2023 年 5 月 23 日生效。

§11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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，张佑君先生担任本基金管理人董事长，杨明辉先生离任本基金管理人董事长。

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。

11.3 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。

11.4 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。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期应支付给普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为 30,000 元人民

币。本基金本报告期内选聘普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）提供首年审计服务。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 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。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	
中信证券	4	187,977,863.28	57.16%	82,976.31	54.36%	-
招商证券	4	122,548,978.99	37.26%	54,140.16	35.47%	-
中信建投证券	3	15,120,760.22	4.60%	14,081.87	9.23%	-
国投证券	3	3,238,284.84	0.98%	1,443.68	0.95%	-

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 5 月 23 日生效，除本表列示外，本基金还选择了长城证券、东方财富证券、东方证券、东吴证券、东兴证券、光大证券、广发证券、国泰君安证券、国信证券、国元证券、华宝证券、华创证券、华泰证券、申万宏源、申万宏源证券、西部证券、西南证券、浙商证券、中国银河证券、中金公司、中泰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。

11.7.2 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
中信证券	40,475.68	91.59%	-	-	-	-	-	-
招商证券	3,717.60	8.41%	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-	-	-

11.8 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	华夏国证 2000 指数增强型发起式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	2023-05-24
2	华夏国证 2000 指数增强型发起式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	2023-06-28
3	华夏基金管理有限公司关于设立武汉分公司的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-07-20
4	华夏基金管理有限公司关于设立沈阳分公司的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-07-26
5	华夏基金管理有限公司公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-09-22
6	华夏基金管理有限公司关于杭州分公司营业场所变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-09-27
7	华夏基金管理有限公司关于设立华夏股权投资基金管理（北京）有限公司的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-10-12

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比

		超过20%的时间区间					
机构	1	2023-05-23至 2023-12-31	10,009,800.10	-	-	10,009,800.10	46.77%
产品特有风险							
<p>本基金在报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额20%的情形，在市场流动性不足的情况下，如遇投资者巨额赎回或集中赎回，基金管理人可能无法以合理的价格及时变现基金资产，有可能对基金净值产生一定的影响，甚至可能引发基金的流动性风险。</p> <p>在特定情况下，若持有基金份额占比较高的投资者大量赎回本基金，可能导致在其赎回后本基金资产规模持续低于正常运作水平，面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。</p>							

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予基金注册的文件；
- 2、《华夏国证 2000 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《华夏国证 2000 指数增强型发起式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。

13.2 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。

13.3 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
二〇二四年三月二十八日