

**华夏国证 2000 指数增强型发起式  
证券投资基金  
2024 年中期报告  
2024 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：交通银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二四年八月三十日

## §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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 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 2024 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	1
§2 基金简介.....	3
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	4
3.1 主要会计数据和财务指标.....	4
3.2 基金净值表现.....	5
§4 管理人报告.....	6
§5 托管人报告.....	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 净资产变动表.....	13
6.4 报表附注.....	15
§7 投资组合报告.....	32
7.1 期末基金资产组合情况.....	32
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	32
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.....	34
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	46
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.....	46
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.....	46
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.....	46
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.....	46
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	46
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	46
7.12 投资组合报告附注.....	46
§8 基金份额持有人信息.....	47
§9 开放式基金份额变动.....	48
§10 重大事件揭示.....	49
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	51
§12 备查文件目录.....	51

## §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	17,372,143.61 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	12,574,925.63 份	4,797,217.98 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×95%+银行活期存款利率（税后）×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
	联系电话	400-818-6666
	电子邮箱	service@ChinaAMC.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号通泰大厦B座8层	中国（上海）长宁区仙霞路18号
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

## 2.5 其他相关资料

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

# §3 主要财务指标和基金净值表现

## 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 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	-2,093,431.13	-1,036,816.71
本期利润	-2,732,821.88	-1,494,624.18
加权平均基金份额本期利润	-0.1906	-0.1970
本期加权平均净值利润率	-22.37%	-23.10%
本期基金份额净值增长率	-20.39%	-20.56%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 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
期末可供分配利润	-2,685,181.28	-1,040,839.90
期末可供分配基金份额利润	-0.2135	-0.2170
期末基金资产净值	9,889,744.35	3,756,378.08
期末基金份额净值	0.7865	0.7830
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024 年 6 月 30 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
基金份额累计净值增长率	-21.35%	-21.70%

注：①所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

②本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

③期末可供分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

##### 华夏国证 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
过去一个月	-7.66%	1.49%	-8.54%	1.50%	0.88%	-0.01%
过去三个月	-8.73%	1.57%	-11.29%	1.60%	2.56%	-0.03%
过去六个月	-20.39%	2.07%	-18.67%	2.02%	-1.72%	0.05%
过去一年	-23.10%	1.59%	-24.60%	1.57%	1.50%	0.02%
自基金合同生效起至今	-21.35%	1.53%	-23.82%	1.52%	2.47%	0.01%

##### 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
过去一个月	-7.69%	1.50%	-8.54%	1.50%	0.85%	0.00%
过去三个月	-8.83%	1.57%	-11.29%	1.60%	2.46%	-0.03%
过去六个月	-20.56%	2.07%	-18.67%	2.02%	-1.89%	0.05%
过去一年	-23.41%	1.59%	-24.60%	1.57%	1.19%	0.02%
自基金合同生效起至今	-21.70%	1.53%	-23.82%	1.52%	2.12%	0.01%

#### 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 2024 年 6 月 30 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：根据本基金的基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同中投资范围、投资限制的有关约定。

## §4 管理人报告

## 4.1 基金管理人及基金经理情况

### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

华夏基金管理有限公司成立于 1998 年 4 月 9 日,是经中国证监会批准成立的首批全国性基金管理公司之一。公司总部设在北京,在北京、上海、深圳、成都、南京、杭州、广州、青岛、武汉及沈阳设有分公司,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 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 2024 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)华夏安泰对冲策略 3 个月定开混合排名第 1/22;在 QDII 混合基金(A 类)中华夏全球科技先锋混合(QDII)排名第 2/48;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 3/17;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 3/78、华夏消费臻选混合发起式(A 类)排名第 7/78。

**固收与固收+产品:**在 QDII 债券型基金(A 类)中华夏收益债券(QDII)(A 类)排名第 1/24、华夏大中华信用债券(QDII)(A 类)排名第 2/24;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 2/18;在定开纯债债券型基金(A 类)中华夏鼎华一年定开债券排名第 5/616、华夏鼎成一年定开债券排名第 14/616;在普通债券型基金(可投转债)(A 类)中华夏稳定双利债券(A 类)排名第 12/241;在长期纯债债券型基金(A 类)中华夏鼎航债券(A 类)排名第 7/793、华夏鼎茂债券(A 类)排名第 19/793、华夏鼎英债券(A 类)排名第 25/793、华夏鼎隆债券(A 类)排名第 26/793、华夏鼎信债券(A 类)排名第

52/793；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 13/416、华夏鼎源债券(A 类)排名第 27/416、华夏希望债券(A 类)排名第 29/416。

在《中国证券报》第二十届中国基金业金牛奖评选中，华夏基金荣获“金牛奖 20 周年特别贡献公司”，连续 8 年荣获“被动投资金牛基金公司”，产品层面华夏创新前沿股票荣获“五年期开放式股票型持续优胜金牛基金”，华夏中证 5G 通信主题 ETF 荣获“开放式指数型金牛基金”。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》主办的第二十届“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，华夏创新前沿股票荣获“金基金·股票型基金五年期奖”，华夏行业景气混合荣获“金基金·偏股混合型基金五年期奖”。

在客户服务方面，2024 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）华夏基金直销渠道继续优化页面显示，升级搜索及查询等功能，给客户更方便直观的使用体验；（2）华夏基金管家客户端上线亲子账户，通过亲子账户客户可以为子女创建专属理财账户，管理和储备孩子的零花钱、教育资金，从客户投资需求出发，进一步提升操作体验；（3）与常熟农商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“送你长期主义的花朵”、“领定制户口本”、“打工人又爱又怕的一天要来了”、“希望高考也这么简单”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	-	10 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。

#### 4.2 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 119 次，均为指数量化投资组合因投资策略需要发生的反向交易。

#### 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×95%+银行活期存款利率（税后）×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。

上半年，A 股市场波动较大，结构性行情明显。行业间分化较大：银行、煤炭、石油石化等行业表现较好，而消费者服务、计算机、商贸零售等行业表现较差。基金持仓继续保持均衡，期间量化策略整体表现较为一般。

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 2024 年 6 月 30 日，华夏国证 2000 指数增强发起式 A 基金份额净值为 0.7865 元，本报告期份额净值增长率为-20.39%；华夏国证 2000 指数增强发起式 C 基金份额净值为 0.7830 元，本报告

期份额净值增长率为-20.56%，同期业绩比较基准增长率为-18.67%。本基金本报告期 A 类份额跟踪偏离度为-1.72%，C 类份额跟踪偏离度为-1.89%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，考虑到政府对科技创新、绿色经济等新质生产力方面的政策支持因素，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分投资和每一份信任，本基金将继续奉行华夏基金管理有限公司“为信任奉献回报”的经营理念，规范运作，审慎投资，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求长期、稳定的回报。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及基金合同约定，本基金管理人为准确、及时进行基金估值和份额净值计价，制定了基金估值和份额净值计价的业务管理制度，建立了估值委员会，使用可靠的估值业务系统，设有完善的风险监测、控制和报告机制。本基金托管人审阅本基金管理人采用的估值原则及技术，并复核、审查基金资产净值和基金份额申购、赎回价格。会计师事务所在估值调整导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上时对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性发表专业意见。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期未进行利润分配，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中期报告中财务指标、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 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：华夏国证 2000 指数增强型发起式证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	1,039,562.08	1,996,835.41
结算备付金		73,930.76	246,458.25
存出保证金		9,349.57	8,216.38
交易性金融资产	6.4.7.2	12,647,423.45	19,413,839.84
其中：股票投资		12,647,423.45	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	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		68,357.83	551,434.57
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		13,838,623.69	22,216,784.45
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2023 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		0.01	245,570.60

应付赎回款		117,543.32	749,193.74
应付管理人报酬		9,261.06	14,846.81
应付托管费		1,736.41	2,783.77
应付销售服务费		1,282.72	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	6.4.7.6	62,677.74	73,208.99
负债合计		192,501.26	1,088,355.65
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	17,372,143.61	21,403,896.84
未分配利润	6.4.7.8	-3,726,021.18	-275,468.04
净资产合计		13,646,122.43	21,128,428.80
负债和净资产总计		13,838,623.69	22,216,784.45

注：①报告截止日 2024 年 6 月 30 日，华夏国证 2000 指数增强发起式 A 基金份额净值 0.7865 元，华夏国证 2000 指数增强发起式 C 基金份额净值 0.7830 元；华夏国证 2000 指数增强发起式基金份额总额 17,372,143.61 份（其中 A 类 12,574,925.63 份，C 类 4,797,217.98 份）。

②本基金合同于 2023 年 5 月 23 日生效，上年度可比期间自 2023 年 5 月 23 日至 2023 年 6 月 30 日。

## 6.2 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：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 5 月 23 日（基金 合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		-4,105,918.37	460,776.86
1.利息收入		2,996.05	753.13
其中：存款利息收入	6.4.7.9	2,996.05	753.13
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）		-3,022,236.98	266,756.29
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-3,173,135.17	163,713.50
基金投资收益	6.4.7.11	-	-
债券投资收益	6.4.7.12	2,916.06	0.01

资产支持证券投资收益	6.4.7.13	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	147,982.13	103,042.78
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-1,097,198.22	193,267.44
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	10,520.78	-
<b>减：二、营业总支出</b>		121,527.69	31,081.76
1.管理人报酬		73,934.31	16,013.90
2.托管费		13,862.62	3,002.56
3.销售服务费		12,751.91	2,895.72
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	6.4.7.20	-	-
7.税金及附加		-	-
8.其他费用	6.4.7.21	20,978.85	9,169.58
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-4,227,446.06	429,695.10
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-4,227,446.06	429,695.10
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-4,227,446.06	429,695.10

注：本基金合同于 2023 年 5 月 23 日生效，上年度可比期间自 2023 年 5 月 23 日至 2023 年 6 月 30 日。

### 6.3 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：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	21,403,896.84	-275,468.04	21,128,428.80
二、本期期初净资产	21,403,896.84	-275,468.04	21,128,428.80
三、本期增减变动	-4,031,753.23	-3,450,553.14	-7,482,306.37

额（减少以“-”号填列）			
（一）、综合收益总额	-	-4,227,446.06	-4,227,446.06
（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）	-4,031,753.23	776,892.92	-3,254,860.31
其中：1.基金申购款	38,742,415.49	-5,756,391.01	32,986,024.48
2.基金赎回款	-42,774,168.72	6,533,283.93	-36,240,884.79
（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	17,372,143.61	-3,726,021.18	13,646,122.43
项目	上年度可比期间		
	2023 年 5 月 23 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 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）	-	429,695.10	429,695.10
（一）、综合收益总额	-	429,695.10	429,695.10
（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）	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
（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	19,019,828.28	429,695.10	19,449,523.38

注：本基金合同于 2023 年 5 月 23 日生效，上年度可比期间自 2023 年 5 月 23 日至 2023 年 6 月 30 日。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：张佑君，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。

#### 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(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》、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。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 货币资金

单位:人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
活期存款	1,039,562.08
等于: 本金	1,039,507.30
加: 应计利息	54.78
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	1,039,562.08

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位:人民币元

项目	本期末 2024年6月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	13,726,439.80	-	12,647,423.45	-1,079,016.35
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	13,726,439.80	-	12,647,423.45	-1,079,016.35
----	---------------	---	---------------	---------------

注：股票投资的成本、公允价值及公允价值变动均包含中国存托凭证的成本、公允价值及公允价值变动。

#### 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

无。

#### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024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	42,786.96
其中：交易所市场	42,786.96
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	19,890.78
合计	62,677.74

#### 6.4.7.7 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 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	13,483,818.23	13,483,818.23
本期申购	5,087,628.80	5,087,628.80
本期赎回（以“-”号填列）	-5,996,521.40	-5,996,521.40

本期末	12,574,925.63	12,574,925.63
-----	---------------	---------------

## 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 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	7,920,078.61	7,920,078.61
本期申购	33,654,786.69	33,654,786.69
本期赎回（以“-”号填列）	-36,777,647.32	-36,777,647.32
本期末	4,797,217.98	4,797,217.98

## 6.4.7.8 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
上年度末	-148,020.53	-13,464.73	-161,485.26
本期期初	-148,020.53	-13,464.73	-161,485.26
本期利润	-2,093,431.13	-639,390.75	-2,732,821.88
本期基金份额交易产生的变动数	159,184.52	49,941.34	209,125.86
其中：基金申购款	-756,250.60	57,448.71	-698,801.89
基金赎回款	915,435.12	-7,507.37	907,927.75
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-2,082,267.14	-602,914.14	-2,685,181.28

## 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
上年度末	-105,888.37	-8,094.41	-113,982.78
本期期初	-105,888.37	-8,094.41	-113,982.78
本期利润	-1,036,816.71	-457,807.47	-1,494,624.18
本期基金份额交易产生的变动数	331,099.84	236,667.22	567,767.06
其中：基金申购款	-5,120,800.56	63,211.44	-5,057,589.12
基金赎回款	5,451,900.40	173,455.78	5,625,356.18
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-811,605.24	-229,234.66	-1,040,839.90

## 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	活期存款利息收入	1,650.32

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	1,252.38
其他	93.35
合计	2,996.05

6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出股票成交总额	93,359,261.01
减：卖出股票成本总额	96,391,815.38
减：交易费用	140,580.80
买卖股票差价收入	-3,173,135.17

6.4.7.11 基金投资收益

无。

6.4.7.12 债券投资收益

6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
债券投资收益——利息收入	3.36
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	2,912.70
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	2,916.06

6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	25,219.03
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	22,300.00
减：应计利息总额	5.31
减：交易费用	1.02

买卖债券差价收入	2,912.70
----------	----------

## 6.4.7.13 资产支持证券投资收益

无。

## 6.4.7.14 贵金属投资收益

无。

## 6.4.7.15 衍生工具收益

## 6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

## 6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

## 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	147,982.13
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	147,982.13

## 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
1.交易性金融资产	-1,097,198.22
——股票投资	-1,096,736.23
——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	-1,097,198.22

## 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
基金赎回费收入	10,520.78
合计	10,520.78

## 6.4.7.19 持有基金产生的费用

无。

## 6.4.7.20 信用减值损失

无。

## 6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
审计费用	19,890.78
信息披露费	-
证券出借违约金	-
银行费用	1,081.24
存托服务费	6.83
合计	20,978.85

## 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

本基金本报告期不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。

## 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
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
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

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 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年5月23日（基金合同生效日）至 2023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	72,571,669.71	39.42%	-	-

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年5月23日（基金合同生效日）至 2023年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
中信证券	3,996.21	15.85%	-	-

6.4.10.1.4 债券回购交易

无。

6.4.10.1.5 基金交易

无。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024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	32,361.44	39.42%	24,149.56	56.44%
关联方名称	上年度可比期间 2023年5月23日（基金合同生效日）至2023年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
中信证券	8,551.09	36.03%	8,551.09	36.03%

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 2024年1月1日至2024年6月 30日	上年度可比期间 2023年5月23日（基金合同生 效日）至2023年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	73,934.31	16,013.90
其中：应支付销售机构的客户维护费	13,641.70	3,426.55
应支付基金管理人的净管理费	60,292.61	12,587.35

注：①支付基金管理人的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 0.80%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

②基金管理人报酬计算公式为：日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×0.80%/当年天数。

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

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月 30日	上年度可比期间 2023年5月23日（基金合同生 效日）至2023年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	13,862.62	3,002.56

注：①支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值 0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

②基金托管费计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.15%/当年天数。

##### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得 销售 服务 费的	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		合计
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华夏国证 2000 指数增强 发起式 A	华夏国证 2000 指数增强 发起式 C	

各关联方名称			
交通银行	-	2,350.73	2,350.73
中信证券	-	1,439.99	1,439.99
华夏基金管理有限公司	-	233.75	233.75
华夏财富	-	5.95	5.95
合计	-	4,030.42	4,030.42
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2023年5月23日（基金合同生效日）至2023年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华夏国证 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	-	1,566.60	1,566.60
华夏基金管理有限公司	-	6.26	6.26
合计	-	1,572.86	1,572.86

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

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

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年5月23日（基金合同生效日） 至2023年6月30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	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	10,009,800.10	-	-	-
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	-	10,009,800.10	-
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	79.60%	-	82.45%	-

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年5月23日（基金合同生效日） 至2023年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行活期存款	1,039,562.08	1,650.32	1,083,260.07	577.24

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。

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	601033	永兴股份	新股发行	500	8,100.00
上年度可比期间 2023 年 5 月 23 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位： 股/张）	总金额
中信证券	-	-	-	-	-

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（2024 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

无。

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

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指由于基金所投资债券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息，债券发行人信用评级降低导致债券价格下降，或基金在交易过程中发生交收违约，而造成基金资产损失的可能性。

本基金管理人通过信用分析团队建立了内部评级体系和交易对手库，对发行人及债券投资进行内部评级，对交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度，以控制可能出现的信用风险。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是在市场或持有资产流动性不足的情况下，基金管理人可能无法迅速、低成本地调整基金投资组合，从而对基金收益造成不利影响。

除在“6.4.12 期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限制的情况外，本基金所投资的证券均能及时变现。

##### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

在日常运作中，本基金的流动性安排能够与基金合同约定的申购赎回安排以及投资者的申购赎回规律相匹配。

在资产端，本基金主要投资于基金合同约定的具有良好流动性的金融工具。基金管理人持续监测本基金持有资产的市场交易量、交易集中度等涉及资产流动性水平的风险指标，并定期开展压力测试，详细评估在不同的压力情景下资产变现情况的变化。

在负债端，基金管理人持续监测本基金开放期内投资者历史申赎、投资者类型和结构变化等数据，审慎评估不同市场环境可能带来的投资者潜在赎回需求，当市场环境或投资者结构发生变化时，及时调整组合资产结构及比例，预留充足现金头寸，保持基金资产可变现规模和期限与负债赎回规

模和期限的匹配。

如遭遇极端市场情形或投资者非预期巨额赎回情形，基金管理人将采用本基金合同约定的赎回申请处理方式及其他各类流动性风险管理工具，控制极端情况下的潜在流动性风险。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指由于市场变化或波动所引起的资产损失的可能性，本基金管理人通过监测组合敏感性指标来衡量市场风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率变动引起组合中资产特别是债券投资的市场价格变动，从而影响基金投资收益的风险。

本基金为指数增强型基金，以国证 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。

##### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

##### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险为除市场利率和外汇汇率以外的市场因素（单个证券发行主体自身经营情况或证券市场整体波动）发生变动时导致基金资产发生损失的风险。

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

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 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	12,647,423.45	92.68	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	12,647,423.45	92.68	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。

#### 6.4.13.4.3.2 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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
	-5%	-665,506.54	-1,040,750.63
	+5%	665,506.54	1,040,750.63

#### 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 2024 年 6 月 30 日
第一层次	12,647,423.45
第二层次	-
第三层次	-
合计	12,647,423.45

###### 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 2024 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	12,647,423.45	91.39
	其中：股票	12,647,423.45	91.39
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	1,113,492.84	8.05
8	其他各项资产	77,707.40	0.56
9	合计	13,838,623.69	100.00

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 指数投资期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	107,763.00	0.79
B	采矿业	108,705.00	0.80
C	制造业	6,843,921.92	50.15
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	314,365.00	2.30

E	建筑业	144,743.00	1.06
F	批发和零售业	347,433.30	2.55
G	交通运输、仓储和邮政业	349,323.30	2.56
H	住宿和餐饮业	1,820.00	0.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,079,591.20	7.91
J	金融业	265,880.00	1.95
K	房地产业	96,089.00	0.70
L	租赁和商务服务业	171,630.95	1.26
M	科学研究和技术服务业	297,729.00	2.18
N	水利、环境和公共设施管理业	135,194.00	0.99
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	101,828.20	0.75
S	综合	1,404.00	0.01
	合计	10,367,420.87	75.97

## 7.2.2 积极投资期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	9,056.00	0.07
B	采矿业	149,598.00	1.10
C	制造业	1,500,008.58	10.99
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	817.00	0.01
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	109,652.00	0.80
G	交通运输、仓储和邮政业	6,651.00	0.05
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	217,135.00	1.59
J	金融业	118,932.00	0.87
K	房地产业	2,196.00	0.02
L	租赁和商务服务业	3,222.00	0.02
M	科学研究和技术服务业	126,414.00	0.93
N	水利、环境和公共设施管理业	21,724.00	0.16
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	936.00	0.01
R	文化、体育和娱乐业	13,661.00	0.10
S	综合	-	-

合计	2,280,002.58	16.71
----	--------------	-------

## 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

## 7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600810	神马股份	20,800	128,960.00	0.95
2	300852	四会富仕	4,400	128,128.00	0.94
3	002807	江阴银行	33,400	125,918.00	0.92
4	600575	淮河能源	31,800	123,702.00	0.91
5	002267	陕天然气	16,000	120,960.00	0.89
6	301120	新特电气	11,500	119,485.00	0.88
7	001328	登康口腔	4,700	118,910.00	0.87
8	002757	南兴股份	9,800	118,090.00	0.87
9	603031	安孚科技	5,100	115,158.00	0.84
10	601089	福元医药	8,300	114,955.00	0.84
11	300345	华民股份	18,700	114,631.00	0.84
12	300976	达瑞电子	2,500	114,625.00	0.84
13	601163	三角轮胎	7,500	114,150.00	0.84
14	600694	大商股份	6,790	114,139.90	0.84
15	688522	纳睿雷达	2,400	112,512.00	0.82
16	300940	南极光	8,800	112,112.00	0.82
17	300451	创业慧康	32,400	112,104.00	0.82
18	300559	佳发教育	11,700	111,969.00	0.82
19	603888	新华网	5,200	111,852.00	0.82
20	603033	三维股份	9,500	111,150.00	0.81
21	301330	熵基科技	4,900	110,152.00	0.81
22	300453	三鑫医疗	17,200	109,908.00	0.81
23	002664	信质集团	9,200	109,480.00	0.80
24	000061	农产品	22,400	108,864.00	0.80
25	601065	江盐集团	12,500	108,375.00	0.79
26	300355	蒙草生态	49,200	108,240.00	0.79
27	300972	万辰集团	5,100	107,763.00	0.79
28	300878	维康药业	7,400	107,596.00	0.79
29	300740	水羊股份	7,300	107,164.00	0.79
30	002922	伊戈尔	4,900	107,114.00	0.78
31	603629	利通电子	5,800	107,068.00	0.78
32	300369	绿盟科技	20,900	106,799.00	0.78
33	300416	苏试试验	8,300	106,738.00	0.78
34	003013	地铁设计	7,500	106,350.00	0.78
35	301046	能辉科技	5,400	106,218.00	0.78

36	000523	红棉股份	41,000	106,190.00	0.78
37	000791	甘肃能源	17,200	106,124.00	0.78
38	603530	神马电力	4,000	105,960.00	0.78
39	301168	通灵股份	3,700	102,786.00	0.75
40	605319	无锡振华	5,800	102,660.00	0.75
41	300693	盛弘股份	4,900	102,606.00	0.75
42	600420	国药现代	9,500	101,460.00	0.74
43	301129	瑞纳智能	4,000	100,960.00	0.74
44	002923	润都股份	10,900	100,934.00	0.74
45	301391	卡莱特	2,300	100,694.00	0.74
46	300080	易成新能	34,800	100,224.00	0.73
47	001236	弘业期货	14,000	99,540.00	0.73
48	000557	西部创业	26,400	99,264.00	0.73
49	301030	仕净科技	4,000	98,480.00	0.72
50	301517	陕西华达	1,800	97,200.00	0.71
51	300860	锋尚文化	4,580	96,363.20	0.71
52	600894	广日股份	8,300	95,450.00	0.70
53	301266	宇邦新材	3,100	94,984.00	0.70
54	300354	东华测试	3,000	93,210.00	0.68
55	600850	电科数字	5,100	92,310.00	0.68
56	301377	鼎泰高科	5,200	91,260.00	0.67
57	603368	柳药集团	5,000	87,500.00	0.64
58	688380	中微半导	5,200	86,944.00	0.64
59	002393	力生制药	4,700	74,307.00	0.54
60	000521	长虹美菱	9,200	69,736.00	0.51
61	301058	中粮科工	7,100	67,237.00	0.49
62	301207	华兰疫苗	3,800	67,146.00	0.49
63	300560	中富通	6,100	66,002.00	0.48
64	688606	奥泰生物	1,400	65,982.00	0.48
65	002565	顺灏股份	27,300	65,247.00	0.48
66	001338	永顺泰	6,400	62,720.00	0.46
67	300678	中科信息	2,300	60,996.00	0.45
68	688027	国盾量子	401	60,551.00	0.44
69	301421	波长光电	1,400	60,522.00	0.44
70	301179	泽宇智能	3,080	59,936.80	0.44
71	300389	艾比森	4,800	58,944.00	0.43
72	301018	申菱环境	3,000	58,320.00	0.43
73	300415	伊之密	2,800	58,184.00	0.43
74	301017	漱玉平民	5,900	58,056.00	0.43
75	300908	仲景食品	2,074	57,615.72	0.42
76	603220	中贝通信	2,000	54,320.00	0.40
77	600169	太原重工	29,200	53,436.00	0.39
78	300011	鼎汉技术	10,600	52,894.00	0.39

79	300873	海晨股份	3,600	52,488.00	0.38
80	300161	华中数控	2,200	49,478.00	0.36
81	002843	泰嘉股份	3,200	48,992.00	0.36
82	605018	长华集团	5,400	48,924.00	0.36
83	300494	盛天网络	4,700	47,235.00	0.35
84	603727	博迈科	3,500	46,060.00	0.34
85	000755	山西高速	10,100	42,218.00	0.31
86	000795	英洛华	7,500	41,550.00	0.30
87	600452	涪陵电力	3,200	40,544.00	0.30
88	300657	弘信电子	2,600	39,052.00	0.29
89	300582	英飞特	4,400	37,664.00	0.28
90	605198	安德利	1,400	36,960.00	0.27
91	002261	拓维信息	3,300	36,531.00	0.27
92	300802	矩子科技	2,200	34,694.00	0.25
93	000797	中国武夷	13,800	32,154.00	0.24
94	300994	久祺股份	2,900	31,871.00	0.23
95	688183	生益电子	1,600	31,008.00	0.23
96	300130	新国都	1,800	29,952.00	0.22
97	301550	斯菱股份	600	28,746.00	0.21
98	600657	信达地产	9,400	28,670.00	0.21
99	300863	卡倍亿	840	28,400.40	0.21
100	688018	乐鑫科技	280	27,630.40	0.20
101	688766	普冉股份	280	27,207.60	0.20
102	688399	硕世生物	400	27,048.00	0.20
103	603277	银都股份	900	27,036.00	0.20
104	605168	三人行	1,015	26,724.95	0.20
105	300049	福瑞股份	500	25,170.00	0.18
106	001696	宗申动力	2,300	24,472.00	0.18
107	603171	税友股份	900	24,336.00	0.18
108	688127	蓝特光学	1,200	22,068.00	0.16
109	300323	华灿光电	4,800	20,880.00	0.15
110	600075	新疆天业	6,000	20,700.00	0.15
111	600601	方正科技	6,800	20,400.00	0.15
112	000758	中色股份	4,000	20,320.00	0.15
113	002020	京新药业	1,900	19,893.00	0.15
114	600691	阳煤化工	11,500	19,665.00	0.14
115	688208	道通科技	800	19,312.00	0.14
116	002948	青岛银行	5,700	19,209.00	0.14
117	000065	北方国际	1,800	18,666.00	0.14
118	002961	瑞达期货	1,700	18,615.00	0.14
119	301061	匠心家居	390	18,314.40	0.13
120	603766	隆鑫通用	2,700	18,306.00	0.13
121	600320	振华重工	5,300	18,126.00	0.13

122	605365	立达信	1,100	17,457.00	0.13
123	688088	虹软科技	600	17,316.00	0.13
124	000923	河钢资源	1,000	17,220.00	0.13
125	300170	汉得信息	2,800	17,192.00	0.13
126	688800	瑞可达	600	16,848.00	0.12
127	000543	皖能电力	1,900	16,815.00	0.12
128	688586	江航装备	1,800	16,740.00	0.12
129	600649	城投控股	4,900	16,268.00	0.12
130	000099	中信海直	1,000	16,240.00	0.12
131	300662	科锐国际	1,000	16,130.00	0.12
132	002237	恒邦股份	1,400	16,114.00	0.12
133	301155	海力风电	400	16,092.00	0.12
133	300679	电连技术	400	16,092.00	0.12
135	300166	东方国信	2,600	15,912.00	0.12
136	300079	数码视讯	3,900	15,834.00	0.12
137	002697	红旗连锁	3,400	15,742.00	0.12
138	603328	依顿电子	2,000	15,720.00	0.12
139	600557	康缘药业	1,000	15,700.00	0.12
140	002681	奋达科技	4,300	15,695.00	0.12
141	002215	诺普信	2,100	15,645.00	0.11
142	688381	帝奥微	800	15,584.00	0.11
143	002274	华昌化工	2,100	15,582.00	0.11
144	002635	安洁科技	1,000	15,440.00	0.11
145	601126	四方股份	800	15,376.00	0.11
146	002649	博彦科技	1,900	15,124.00	0.11
147	600284	浦东建设	2,800	14,952.00	0.11
148	002993	奥海科技	400	14,880.00	0.11
149	600475	华光环能	1,700	14,807.00	0.11
150	300463	迈克生物	1,300	14,794.00	0.11
151	301051	信濠光电	560	14,688.80	0.11
152	600477	杭萧钢构	6,300	14,679.00	0.11
153	002283	天润工业	3,400	14,586.00	0.11
154	002053	云南能投	1,200	14,508.00	0.11
155	002034	旺能环境	1,100	14,311.00	0.10
156	600216	浙江医药	1,300	14,274.00	0.10
157	300973	立高食品	500	14,045.00	0.10
158	688106	金宏气体	800	14,016.00	0.10
159	688166	博瑞医药	400	14,000.00	0.10
160	605333	沪光股份	500	13,925.00	0.10
161	688239	航宇科技	400	13,920.00	0.10
162	002100	天康生物	2,000	13,860.00	0.10
163	603348	文灿股份	500	13,845.00	0.10
164	601101	昊华能源	1,500	13,785.00	0.10

165	000019	深粮控股	2,400	13,776.00	0.10
166	300134	大富科技	2,000	13,640.00	0.10
167	605376	博迁新材	600	13,542.00	0.10
168	000682	东方电子	1,200	13,248.00	0.10
169	688351	微电生理	600	13,224.00	0.10
170	002815	崇达技术	1,400	13,132.00	0.10
171	600266	城建发展	3,500	13,090.00	0.10
171	002768	国恩股份	700	13,090.00	0.10
173	688630	芯碁微装	200	12,514.00	0.09
174	688029	南微医学	200	12,312.00	0.09
175	002646	天佑德酒	1,200	12,276.00	0.09
176	688123	聚辰股份	200	12,166.00	0.09
177	688348	昱能科技	200	11,800.00	0.09
178	600312	平高电气	600	11,670.00	0.09
179	002245	蔚蓝锂芯	1,500	11,625.00	0.09
180	002332	仙琚制药	1,000	11,410.00	0.08
181	600508	上海能源	800	11,320.00	0.08
182	600751	海航科技	5,000	11,100.00	0.08
183	003021	兆威机电	240	11,076.00	0.08
184	605598	上海港湾	500	11,045.00	0.08
185	002583	海能达	2,700	10,989.00	0.08
186	002011	盾安环境	1,100	10,813.00	0.08
187	002645	华宏科技	1,700	10,812.00	0.08
188	600300	维维股份	4,500	10,800.00	0.08
189	300768	迪普科技	900	10,665.00	0.08
190	300624	万兴科技	200	10,614.00	0.08
191	300685	艾德生物	600	10,584.00	0.08
192	002573	清新环境	2,700	10,449.00	0.08
193	600835	上海机电	900	10,359.00	0.08
194	688268	华特气体	200	10,322.00	0.08
195	603153	上海建科	600	10,146.00	0.07
196	600389	江山股份	700	9,877.00	0.07
197	300687	赛意信息	700	9,744.00	0.07
198	300303	聚飞光电	2,000	9,720.00	0.07
199	002545	东方铁塔	1,400	9,534.00	0.07
200	300113	顺网科技	900	9,216.00	0.07
201	002023	海特高新	1,000	9,150.00	0.07
202	002979	雷赛智能	500	9,100.00	0.07
203	002975	博杰股份	300	8,964.00	0.07
204	301171	易点天下	600	8,820.00	0.06
205	300406	九强生物	500	7,690.00	0.06
206	300772	运达股份	800	7,680.00	0.06
207	301328	维峰电子	200	7,382.00	0.05

208	002556	辉隆股份	1,700	7,089.00	0.05
209	600449	宁夏建材	600	7,050.00	0.05
210	300638	广和通	400	6,840.00	0.05
211	600366	宁波韵升	1,300	6,786.00	0.05
212	002127	南极电商	2,500	6,500.00	0.05
213	300493	润欣科技	800	6,472.00	0.05
214	300737	科顺股份	1,500	6,450.00	0.05
215	002707	众信旅游	1,100	6,314.00	0.05
216	688373	盟科药业	1,400	6,090.00	0.04
217	002284	亚太股份	900	6,084.00	0.04
218	002991	甘源食品	100	6,065.00	0.04
219	603297	永新光学	100	6,049.00	0.04
220	000731	四川美丰	900	5,967.00	0.04
221	300441	鲍斯股份	1,000	5,930.00	0.04
222	002073	软控股份	800	5,912.00	0.04
223	000920	沃顿科技	800	5,864.00	0.04
224	605090	九丰能源	200	5,800.00	0.04
225	600114	东睦股份	400	5,756.00	0.04
226	688680	海优新材	200	5,748.00	0.04
227	601975	招商南油	1,600	5,744.00	0.04
228	688313	仕佳光子	600	5,712.00	0.04
229	600512	腾达建设	3,000	5,670.00	0.04
230	000905	厦门港务	1,000	5,650.00	0.04
231	002658	雪迪龙	1,100	5,643.00	0.04
232	301149	隆华新材	600	5,544.00	0.04
233	688588	凌志软件	800	5,480.00	0.04
234	601702	华峰铝业	300	5,478.00	0.04
235	002550	千红制药	1,000	5,390.00	0.04
236	002039	黔源电力	300	5,280.00	0.04
237	603995	甬金股份	300	5,256.00	0.04
238	603630	拉芳家化	500	5,255.00	0.04
239	002449	国星光电	700	4,984.00	0.04
240	300228	富瑞特装	900	4,914.00	0.04
241	002440	闰土股份	900	4,887.00	0.04
242	688365	光云科技	800	4,816.00	0.04
243	601326	秦港股份	1,500	4,755.00	0.03
244	601038	一拖股份	300	4,743.00	0.03
245	688575	亚辉龙	200	4,664.00	0.03
245	603187	海容冷链	400	4,664.00	0.03
247	605577	龙版传媒	300	4,659.00	0.03
248	002140	东华科技	600	4,650.00	0.03
249	300048	合康新能	1,000	4,630.00	0.03
250	600293	三峡新材	1,800	4,482.00	0.03

251	300101	振芯科技	300	4,431.00	0.03
252	300592	华凯易佰	380	4,343.40	0.03
253	300401	花园生物	300	4,302.00	0.03
254	601500	通用股份	800	4,272.00	0.03
255	300326	凯利泰	1,100	4,180.00	0.03
256	600997	开滦股份	600	4,116.00	0.03
257	603229	奥翔药业	400	4,020.00	0.03
258	002344	海宁皮城	1,300	3,978.00	0.03
259	002048	宁波华翔	300	3,882.00	0.03
260	605020	永和股份	200	3,836.00	0.03
261	300315	掌趣科技	900	3,753.00	0.03
262	688510	航亚科技	200	3,682.00	0.03
263	600963	岳阳林纸	1,000	3,670.00	0.03
264	002790	瑞尔特	400	3,612.00	0.03
265	600201	生物股份	500	3,605.00	0.03
266	002741	光华科技	400	3,592.00	0.03
267	300702	天宇股份	200	3,566.00	0.03
268	002107	沃华医药	900	3,537.00	0.03
269	600888	新疆众和	500	3,535.00	0.03
270	603075	热威股份	200	3,530.00	0.03
271	301080	百普赛斯	100	3,500.00	0.03
272	002204	大连重工	800	3,416.00	0.03
273	300348	长亮科技	500	3,410.00	0.02
274	300470	中密控股	100	3,381.00	0.02
275	600874	创业环保	600	3,354.00	0.02
276	603626	科森科技	600	3,336.00	0.02
277	300065	海兰信	500	3,305.00	0.02
278	603113	金能科技	600	3,282.00	0.02
279	002516	旷达科技	900	3,276.00	0.02
280	002194	武汉凡谷	400	3,220.00	0.02
281	000517	荣安地产	1,200	3,216.00	0.02
282	002997	瑞鹄模具	100	3,197.00	0.02
283	603169	兰石重装	700	3,150.00	0.02
284	603811	诚意药业	500	3,125.00	0.02
285	603399	吉翔股份	500	3,095.00	0.02
286	600035	楚天高速	700	3,003.00	0.02
287	600526	菲达环保	800	2,968.00	0.02
288	300796	贝斯美	200	2,894.00	0.02
289	300168	万达信息	600	2,850.00	0.02
290	688238	和元生物	600	2,778.00	0.02
291	300718	长盛轴承	200	2,764.00	0.02
292	002315	焦点科技	100	2,696.00	0.02
293	002314	南山控股	1,300	2,691.00	0.02

294	601388	怡球资源	1,200	2,628.00	0.02
295	603093	南华期货	300	2,598.00	0.02
296	301117	佳缘科技	100	2,580.00	0.02
297	605599	菜百股份	200	2,546.00	0.02
298	002585	双星新材	500	2,480.00	0.02
299	002406	远东传动	500	2,465.00	0.02
300	300258	精锻科技	300	2,439.00	0.02
301	301015	百洋医药	100	2,353.00	0.02
302	002937	兴瑞科技	100	2,331.00	0.02
303	002469	三维化学	400	2,280.00	0.02
304	600602	云赛智联	200	2,208.00	0.02
304	601789	宁波建工	600	2,208.00	0.02
306	603618	杭电股份	500	2,190.00	0.02
307	600223	福瑞达	300	2,121.00	0.02
308	600929	雪天盐业	400	2,120.00	0.02
309	300260	新莱应材	100	2,094.00	0.02
310	601339	百隆东方	400	2,084.00	0.02
311	600609	金杯汽车	600	2,082.00	0.02
312	002859	洁美科技	100	2,008.00	0.01
313	300047	天源迪科	300	1,962.00	0.01
314	002833	弘亚数控	100	1,824.00	0.01
315	301073	君亭酒店	100	1,820.00	0.01
316	300061	旗天科技	400	1,792.00	0.01
317	601827	三峰环境	200	1,698.00	0.01
318	000969	安泰科技	200	1,586.00	0.01
319	002609	捷顺科技	200	1,516.00	0.01
319	002515	金字火腿	400	1,516.00	0.01
319	001208	华菱线缆	200	1,516.00	0.01
322	300031	宝通科技	100	1,437.00	0.01
323	002276	万马股份	200	1,434.00	0.01
324	000833	粤桂股份	300	1,404.00	0.01
325	601015	陕西黑猫	500	1,400.00	0.01
326	002149	西部材料	100	1,396.00	0.01
327	600368	五洲交通	390	1,392.30	0.01
328	300533	冰川网络	100	1,388.00	0.01
329	603013	亚普股份	100	1,347.00	0.01
330	603408	建霖家居	100	1,319.00	0.01
331	603109	神驰机电	100	1,311.00	0.01
332	000922	佳电股份	100	1,193.00	0.01
333	300349	金卡智能	100	1,192.00	0.01
334	300589	江龙船艇	100	1,188.00	0.01
335	300435	中泰股份	100	1,177.00	0.01
336	601616	广电电气	400	1,164.00	0.01

337	600586	金晶科技	200	1,160.00	0.01
338	603309	维力医疗	100	1,101.00	0.01
339	601226	华电重工	200	980.00	0.01
340	600552	凯盛科技	100	943.00	0.01
341	000607	华媒控股	300	927.00	0.01
342	300708	聚灿光电	100	900.00	0.01
343	002017	东信和平	100	833.00	0.01
344	002026	山东威达	100	830.00	0.01
345	600757	长江传媒	100	806.00	0.01
346	002666	德联集团	200	724.00	0.01
347	002852	道道全	100	720.00	0.01
348	000576	甘化科工	100	600.00	0.00
349	600269	赣粤高速	100	517.00	0.00
350	600662	外服控股	100	401.00	0.00

## 7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	300668	杰恩设计	7,400.00	122,544.00	0.90
2	002252	上海莱士	14,800.00	115,736.00	0.85
3	688387	信科移动	21,601.00	108,869.04	0.80
4	000426	兴业银锡	8,000.00	108,640.00	0.80
5	600080	金花股份	17,900.00	106,863.00	0.78
6	300695	兆丰股份	2,900.00	106,372.00	0.78
7	603235	天新药业	4,400.00	105,732.00	0.77
8	600816	建元信托	39,000.00	105,690.00	0.77
9	688657	浩辰软件	2,800.00	103,488.00	0.76
10	002738	中矿资源	3,700.00	99,160.00	0.73
11	300622	博士眼镜	8,000.00	97,360.00	0.71
12	301358	湖南裕能	2,700.00	84,942.00	0.62
13	688075	安旭生物	2,000.00	67,380.00	0.49
14	300253	卫宁健康	9,800.00	57,820.00	0.42
15	688585	上纬新材	11,162.00	57,707.54	0.42
16	001229	魅视科技	1,600.00	46,672.00	0.34
17	000761	本钢板材	18,000.00	45,180.00	0.33
18	603979	金诚信	800.00	40,424.00	0.30
19	301067	显盈科技	2,000.00	39,420.00	0.29
20	002855	捷荣技术	1,700.00	35,734.00	0.26
21	688047	龙芯中科	400.00	35,172.00	0.26
22	301387	光大同创	1,040.00	34,840.00	0.26
23	688591	泰凌微	1,400.00	27,370.00	0.20
24	301190	善水科技	1,900.00	26,657.00	0.20

25	301193	家联科技	1,500.00	23,940.00	0.18
26	603052	可川科技	800.00	22,520.00	0.17
27	000400	许继电气	600.00	20,646.00	0.15
28	603903	中持股份	2,900.00	20,329.00	0.15
29	300383	光环新网	2,300.00	19,435.00	0.14
30	300529	健帆生物	700.00	19,047.00	0.14
31	300840	酷特智能	2,000.00	18,500.00	0.14
32	002291	遥望科技	3,600.00	15,480.00	0.11
33	600219	南山铝业	3,800.00	14,478.00	0.11
34	002340	格林美	2,200.00	14,014.00	0.10
35	002249	大洋电机	2,900.00	13,717.00	0.10
36	600273	嘉化能源	1,900.00	13,566.00	0.10
37	600299	安迪苏	1,300.00	12,610.00	0.09
38	300136	信维通信	600.00	11,748.00	0.09
39	600161	天坛生物	480.00	11,712.00	0.09
40	002318	久立特材	500.00	11,665.00	0.09
41	001288	运机集团	400.00	11,072.00	0.08
42	600875	东方电气	600.00	11,070.00	0.08
43	689009	九号公司	300.00	11,043.00	0.08
44	002901	大博医疗	400.00	10,332.00	0.08
45	300558	贝达药业	300.00	9,765.00	0.07
46	601019	山东出版	800.00	9,456.00	0.07
47	603658	安图生物	200.00	9,214.00	0.07
48	300761	立华股份	400.00	9,056.00	0.07
49	001225	和泰机电	300.00	8,313.00	0.06
50	000488	晨鸣纸业	2,300.00	7,958.00	0.06
51	603160	汇顶科技	100.00	6,875.00	0.05
52	000034	神州数码	300.00	6,867.00	0.05
53	002558	巨人网络	700.00	6,608.00	0.05
54	000050	深天马 A	900.00	6,552.00	0.05
55	688275	万润新能	200.00	5,884.00	0.04
56	600927	永安期货	500.00	5,575.00	0.04
57	605188	国光连锁	700.00	5,425.00	0.04
58	002354	天娱数科	1,800.00	5,382.00	0.04
59	688662	富信科技	200.00	4,880.00	0.04
60	600660	福耀玻璃	100.00	4,790.00	0.04
61	300776	帝尔激光	100.00	4,596.00	0.03
62	002472	双环传动	200.00	4,404.00	0.03
63	000728	国元证券	700.00	4,242.00	0.03
64	300251	光线传媒	500.00	4,205.00	0.03
65	605369	拱东医疗	100.00	3,990.00	0.03
66	301306	西测测试	100.00	3,870.00	0.03
67	002001	新和成	200.00	3,840.00	0.03

68	600717	天津港	800.00	3,416.00	0.03
69	002214	大立科技	300.00	3,384.00	0.02
70	600718	东软集团	400.00	3,308.00	0.02
71	002532	天山铝业	400.00	3,244.00	0.02
72	000058	深赛格	600.00	3,222.00	0.02
73	601169	北京银行	500.00	2,920.00	0.02
74	002068	黑猫股份	400.00	2,840.00	0.02
75	002925	盈趣科技	200.00	2,534.00	0.02
76	300448	浩云科技	600.00	2,514.00	0.02
77	002019	亿帆医药	200.00	2,472.00	0.02
78	600007	中国国贸	100.00	2,196.00	0.02
79	002602	世纪华通	600.00	2,058.00	0.02
80	001872	招商港口	100.00	1,925.00	0.01
81	300034	钢研高纳	100.00	1,589.00	0.01
82	601717	郑煤机	100.00	1,480.00	0.01
83	002705	新宝股份	100.00	1,407.00	0.01
84	002266	浙富控股	500.00	1,395.00	0.01
85	603056	德邦股份	100.00	1,310.00	0.01
86	300707	威唐工业	100.00	1,238.00	0.01
87	300055	万邦达	300.00	1,215.00	0.01
88	603887	城地香江	200.00	1,042.00	0.01
89	000516	国际医学	200.00	936.00	0.01
90	600956	新天绿能	100.00	817.00	0.01
91	600590	泰豪科技	200.00	762.00	0.01
92	002661	克明食品	100.00	747.00	0.01
93	603385	惠达卫浴	100.00	549.00	0.00
94	600497	驰宏锌锗	100.00	534.00	0.00
95	600901	江苏金租	100.00	505.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 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	000426	兴业银锡	411,059.00	1.95
2	000061	农产品	373,582.00	1.77
3	300510	金冠股份	359,384.00	1.70
4	603511	爱慕股份	355,075.00	1.68
5	301239	普瑞眼科	350,647.00	1.66
6	002428	云南锗业	343,825.00	1.63
7	001236	弘业期货	314,929.00	1.49
8	300729	乐歌股份	311,160.00	1.47
9	300492	华图山鼎	310,391.00	1.47

10	601089	福元医药	305,498.00	1.45
11	301330	熵基科技	286,474.00	1.36
12	301117	佳缘科技	282,620.00	1.34
13	002267	陕天然气	281,497.00	1.33
14	300813	泰林生物	280,546.00	1.33
15	300986	志特新材	279,609.00	1.32
16	001338	永顺泰	277,319.00	1.31
17	301179	泽宇智能	276,751.20	1.31
18	300318	博晖创新	274,910.00	1.30
19	301120	新特电气	274,564.00	1.30
20	300982	苏文电能	272,411.00	1.29

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	300982	苏文电能	374,573.00	1.77
2	000426	兴业银锡	365,471.00	1.73
3	603511	爱慕股份	358,560.00	1.70
4	300990	同飞股份	349,498.00	1.65
5	300492	华图山鼎	335,518.00	1.59
6	300997	欢乐家	334,718.00	1.58
7	300510	金冠股份	334,177.00	1.58
8	002428	云南锗业	326,032.00	1.54
9	001337	四川黄金	315,163.00	1.49
10	300813	泰林生物	312,688.00	1.48
11	300887	谱尼测试	309,586.00	1.47
12	603662	柯力传感	300,380.00	1.42
13	300729	乐歌股份	299,061.00	1.42
14	301117	佳缘科技	298,313.00	1.41
15	300318	博晖创新	292,376.00	1.38
16	000717	中南股份	292,344.00	1.38
17	301239	普瑞眼科	290,184.00	1.37
18	000766	通化金马	287,669.00	1.36
19	300969	恒帅股份	285,840.00	1.35
20	300352	北信源	285,751.00	1.35

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	90,739,199.16
--------------	---------------

卖出股票收入（成交）总额	93,359,261.01
--------------	---------------

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	9,349.57
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-

5	应收申购款	68,357.83
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	77,707.40

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

##### 7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

##### 7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

#### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## §8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额 级别	持有 人户 数 (户)	户均持有 的基金份 额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
华夏 国证 2000 指 数 增 强 发 起 式 A	346	36,343.72	10,116,743.24	80.45%	2,458,182.39	19.55%
华夏 国证 2000 指 数 增 强 发 起 式 C	1,102	4,353.19	500,000.00	10.42%	4,297,217.98	89.58%

合计	1,448	11,997.34	10,616,743.24	61.11%	6,755,400.37	38.89%
----	-------	-----------	---------------	--------	--------------	--------

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份 额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	华夏国证 2000 指数增强发起式 A	53,644.75	0.43%
	华夏国证 2000 指数增强发起式 C	-	-
	合计	53,644.75	0.31%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和相关部门负责人持有本开放式基金	华夏国证 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

8.4 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	57.62%	10,000,000.00	57.56%	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	57.62%	10,000,000.00	57.56%	不少于三年

## §9 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
本报告期期初基金份额总额	13,483,818.23	7,920,078.61
本报告期基金总申购份额	5,087,628.80	33,654,786.69
减: 本报告期基金总赎回份额	5,996,521.40	36,777,647.32
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	12,574,925.63	4,797,217.98

## §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。

### 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。

### 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	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期	佣金	占当期	

	数量		股票成交总额的比例		佣金总量的比例	
中信证券	4	72,571,669.71	39.42%	32,361.44	39.42%	-
招商证券	4	69,735,181.45	37.88%	31,095.55	37.88%	-
国投证券	3	41,783,509.01	22.70%	18,637.40	22.70%	-

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、中信建投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本报告期内，本基金租用的券商交易单元未发生变更。

#### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
中信证券	3,996.21	15.85%	-	-	-	-	-	-
招商证券	11,952.05	47.39%	-	-	-	-	-	-
国投	9,270.77	36.76%	-	-	-	-	-	-

证券								
----	--	--	--	--	--	--	--	--

10.8 其他重大事件

本基金本报告期内无需要披露的主要事项。

## §11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20% 的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2024-01-01 至 2024-06-30	10,009,800.10	-	-	10,009,800.10	57.62%

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。

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

二〇二四年八月三十日