
华夏中证 1000 指数增强型证券投资基金

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：招商银行股份有限公司

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。

基金托管人招商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 1 月 1 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	8
§4 管理人报告	8
§5 托管人报告	15
§6 审计报告	16
§7 年度财务报表	18
7.1 资产负债表.....	18
7.2 利润表.....	19
7.3 净资产变动表.....	20
7.4 报表附注.....	21
§8 投资组合报告	60
8.1 期末基金资产组合情况.....	60
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	61
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	62
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	69
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	71
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	71
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	71
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	71
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	71
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	71
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	72
8.12 投资组合报告附注	72
§9 基金份额持有人信息	73
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	73
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	73
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	73
§10 开放式基金份额变动	74
§11 重大事件揭示	74
§12 影响投资者决策的其他重要信息	77
§13 备查文件目录	77

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华夏中证 1000 指数增强型证券投资基金	
基金简称	华夏中证 1000 指数增强	
基金主代码	014125	
交易代码	014125	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 12 月 7 日	
基金管理人	华夏基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,092,838,421.94 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华夏中证 1000 指数增强 A	华夏中证 1000 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	014125	014126
报告期末下属分级基金的份额总额	288,882,639.87 份	803,955,782.07 份

2.2 基金产品说明

投资目标	通过量化方法进行积极的投资组合管理与风险控制，力争在控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 7.75% 的基础上，追求获得超越标的指数的回报。
投资策略	主要投资策略包括股票投资策略，债券投资策略，衍生品投资策略，资产支持证券投资策略，可转换债券、可交换债券投资策略，融资、转融通证券出借业务投资策略等。
业绩比较基准	中证 1000 指数收益率×95%+人民币活期存款税后利率×5%。
风险收益特征	本基金为股票指数增强型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种，其预期风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金还将通过港股通渠道投资于香港证券市场，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还将面临汇率风险、香港市场风险等特殊投资风险。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华夏基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李彬	张姗
	联系电话	400-818-6666	400-61-95555
	电子邮箱	service@ChinaAMC.com	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		400-818-6666	400-61-95555
传真		010-63136700	0755-83195201
注册地址		北京市顺义区安庆大街甲3号	深圳市深南大道7088号招商银行大

	院	厦
办公地址	北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座8层	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
邮政编码	100033	518040
法定代表人	张佑君	缪建民

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		2022 年		2021 年 12 月 7 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日	
	华夏中证 1000 指数增强 A	华夏中证 1000 指数增强 C	华夏中证 1000 指数增强 A	华夏中证 1000 指数增强 C	华夏中证 1000 指数增强 A	华夏中证 1000 指数增强 C
本期已实现收益	-14,853,852.17	-56,449,179.08	-1,420,774.59	-17,119,239.14	-114,828.03	-1,017,328.06
本期利润	-10,452,244.11	-5,568,098.64	-16,632,438.05	-105,878,697.80	3,355,238.26	22,499,804.24
加权平均基金份额本期利润	-0.0532	-0.0062	-0.1513	-0.1160	0.0250	0.0248
本期加权平均净值利润率	-5.91%	-0.68%	-16.49%	-12.69%	2.50%	2.47%
本期基金份额净值增	-1.47%	-1.85%	-13.80%	-14.16%	2.50%	2.48%

长率						
3.1.2 期末数据和指标	2023 年末		2022 年末		2021 年末	
	华夏中证 1000 指数增强 A	华夏中证 1000 指数增强 C	华夏中证 1000 指数增强 A	华夏中证 1000 指数增强 C	华夏中证 1000 指数增强 A	华夏中证 1000 指数增强 C
期末可供分配利润	-37,409,969.72	-109,844,335.81	-13,645,909.47	-118,432,666.34	-114,828.03	-1,017,328.06
期末可供分配基金份额利润	-0.1295	-0.1366	-0.1165	-0.1203	-0.0009	-0.0011
期末基金资产净值	251,472,670.15	694,111,446.26	103,487,106.25	866,404,468.69	137,399,081.88	931,156,409.15
期末基金份额净值	0.8705	0.8634	0.8835	0.8797	1.0250	1.0248
3.1.3 累计期末指标	2023 年末		2022 年末		2021 年末	
	华夏中证 1000 指数增强 A	华夏中证 1000 指数增强 C	华夏中证 1000 指数增强 A	华夏中证 1000 指数增强 C	华夏中证 1000 指数增强 A	华夏中证 1000 指数增强 C
基金份额累计净值增长率	-12.95%	-13.66%	-11.65%	-12.03%	2.50%	2.48%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华夏中证 1000 指数增强 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-1.53%	0.97%	-2.98%	0.98%	1.45%	-0.01%
过去六个月	-7.51%	0.94%	-10.28%	0.95%	2.77%	-0.01%
过去一年	-1.47%	0.88%	-5.91%	0.90%	4.44%	-0.02%
自基金合同生效起至今	-12.95%	1.18%	-24.25%	1.23%	11.30%	-0.05%

华夏中证 1000 指数增强 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-1.63%	0.97%	-2.98%	0.98%	1.35%	-0.01%
过去六个月	-7.70%	0.94%	-10.28%	0.95%	2.58%	-0.01%
过去一年	-1.85%	0.88%	-5.91%	0.90%	4.06%	-0.02%
自基金合同生效起至今	-13.66%	1.18%	-24.25%	1.23%	10.59%	-0.05%

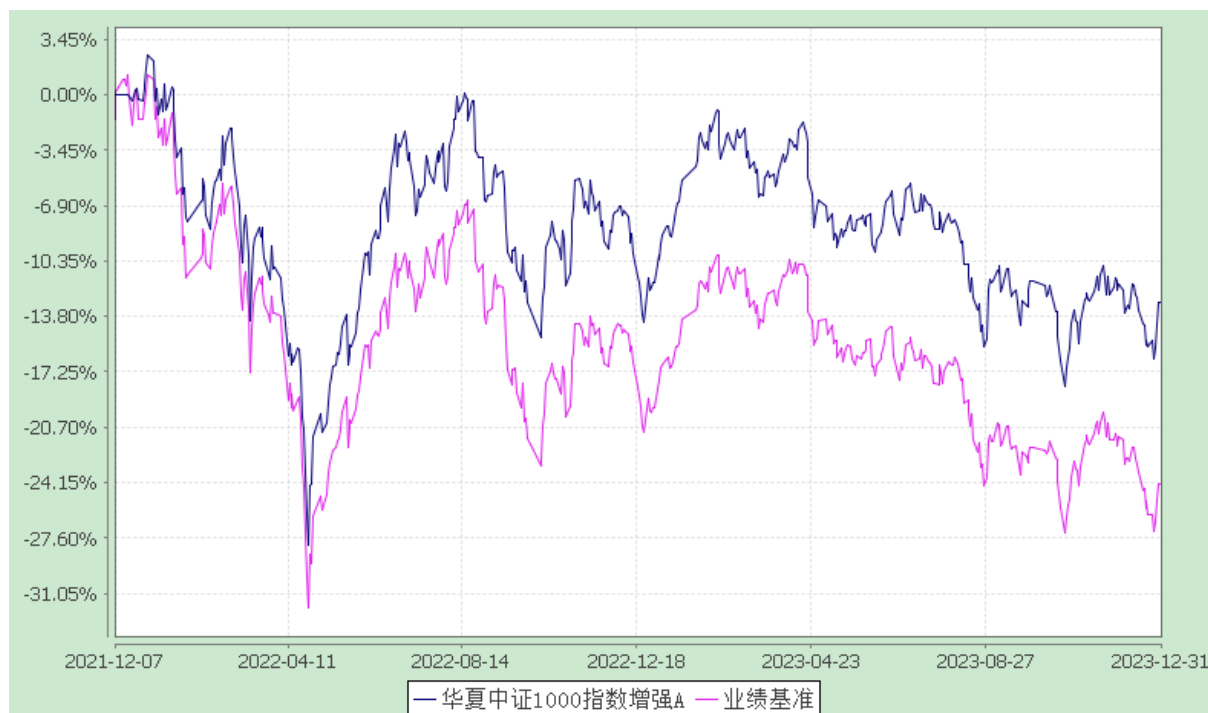
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华夏中证 1000 指数增强型证券投资基金

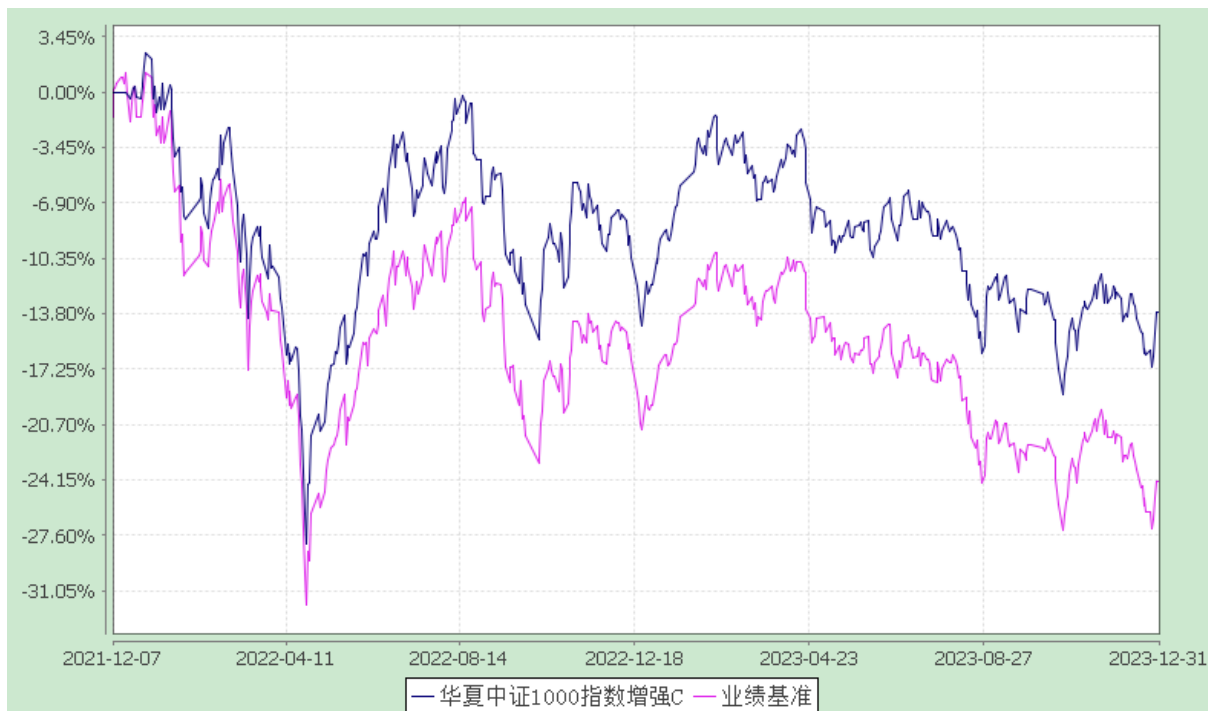
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2021 年 12 月 7 日至 2023 年 12 月 31 日)

华夏中证 1000 指数增强 A



华夏中证 1000 指数增强 C

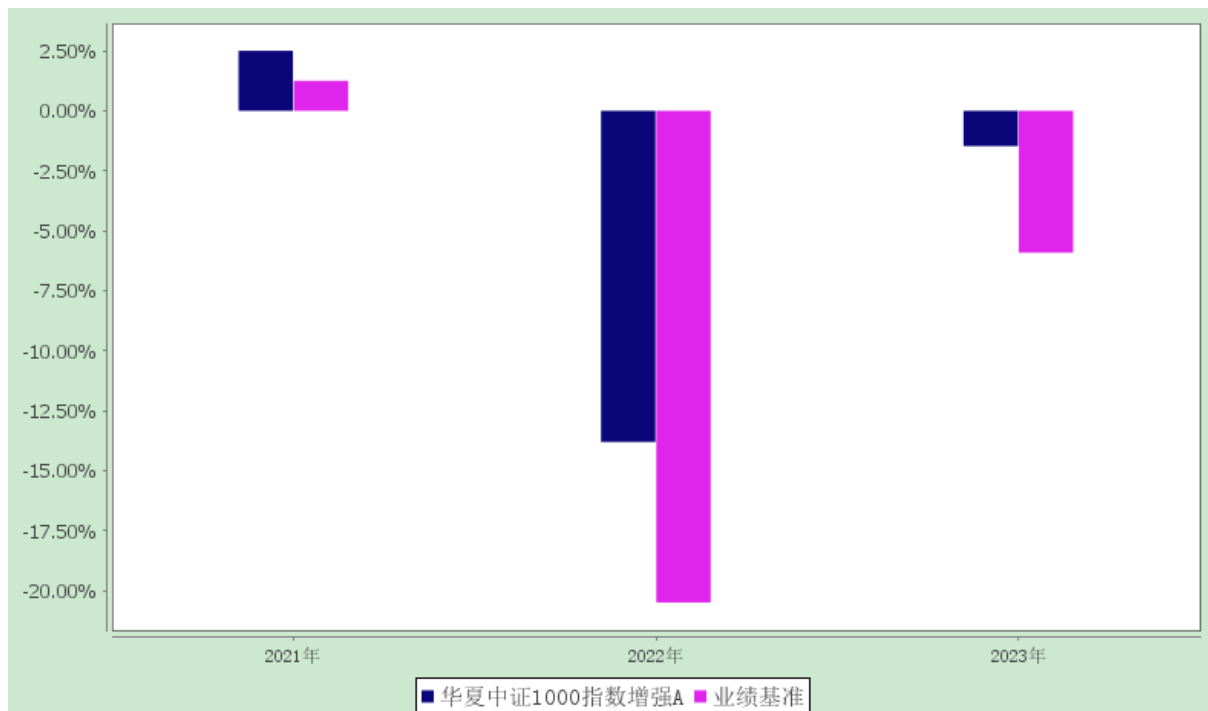


3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

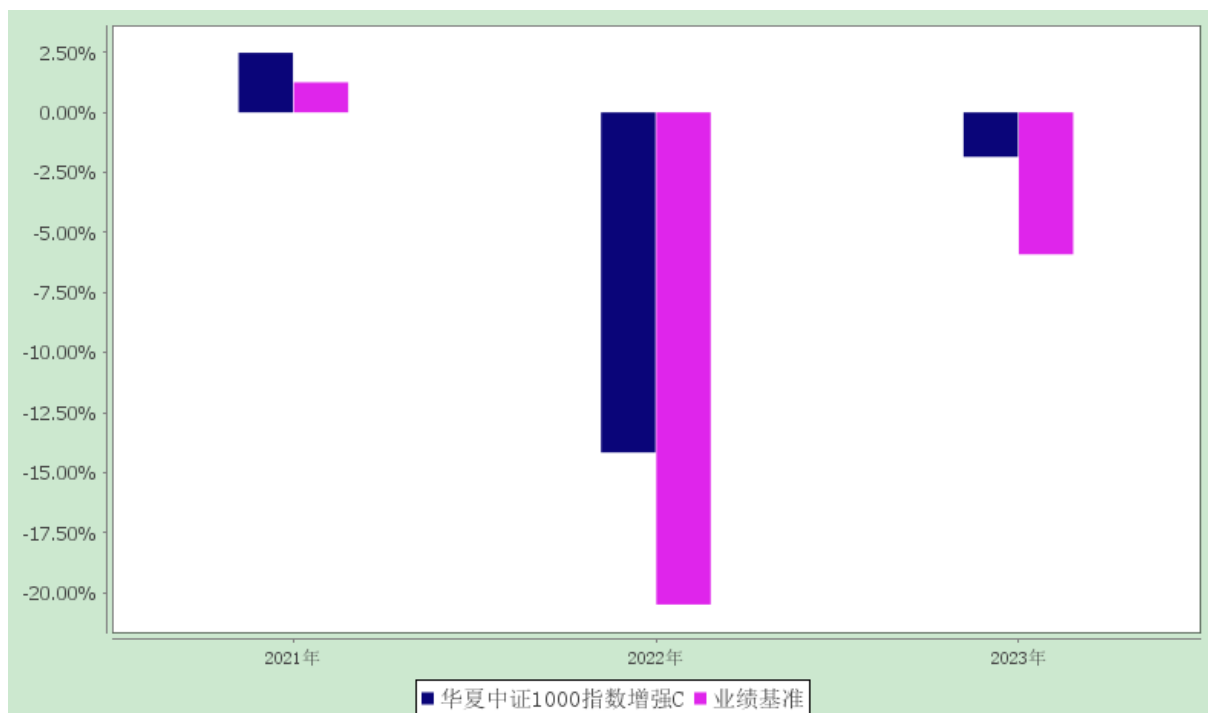
华夏中证 1000 指数增强型证券投资基金

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

华夏中证 1000 指数增强 A



华夏中证 1000 指数增强 C



注：本基金合同于 2021 年 12 月 7 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、华夏中证文化传媒 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		
袁英杰	本基金的基金经理、投委会成员	2021-12-07	-	17 年	硕士。曾任兴业证券股份有限公司研究员，上海申银万国证券研究所有限公司分析师，申万菱信基金管理有限公司高级数量研究员、基金经理助理、申万菱

					<p> 信中证军工指数分级证券投资基金基金经理、申万菱信中证环保产业指数分级证券投资基金基金经理、申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金基金经理、申万菱信中小板指数证券投资基金（LOF）基金经理、申万菱信深证成指分级证券投资基金基金经理、申万菱信中证申万电子行业投资指数分级证券投资基金基金经理、申万菱信中证申万传媒行业投资指数分级证券投资基金基金经理、申万菱信中证申万医药生物指数分级证券投资基金基金经理、申万菱信中证申万新兴健康产业主题投资指数证券投资基金（LOF）基金经理、申万菱信沪深 300 指数增强型证券投资基金基金经理、申万菱信中证 500 指数优选增强型证券投资基金基金经理、申万菱信臻选 6 个月定期开放混合型证券投资基金基金经理、申万菱信智选一年期定期开放混合型证券投资基金基金经理、申万菱信中证 500 指数增强型证券投资基金基金经理、申万菱信价值优利混合型证券投资基金基金经理、申万菱信价值优先混合型证券投资基金基金经理、申万菱信量化小盘股票型证券投资 </p>
--	--	--	--	--	------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

					资基金（LOF）基金经理、申万菱信量化对冲策略灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理。2020 年 5 月加入华夏基金管理有限公司。曾任投资经理。
--	--	--	--	--	----------------------------------------------------------------------------

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 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值(元)	任职时间
袁英杰	公募基金	3	4,204,078,669.05	2021-09-27
	私募资产管理计划	2	189,304,282.41	2021-04-27
	其他组合	-	-	-
	合计	5	4,393,382,951.46	-

注：报告期内，袁英杰于 2023 年 8 月 23 日离任 1 个私募资产管理计划；其管理的 1 个私募资产管理计划已于 2023 年 6 月 21 日终止。

4.1.4 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中证 1000 指数，业绩比较基准为：中证 1000 指数收益率 $\times 95\%$ + 银行活期存款利率(税后) $\times 5\%$ 。本基金股票投资方面主要采用指数增强量化投资策略，在严格控制跟踪误差的基础上，力求获得超越标的指数的超额收益。

2023 年，A 股市场上涨后震荡下跌，热点板块快速轮动，其中沪深 300 指数下跌 11.38% 左右，中证 500 指数下跌 7.42% 左右，中证 1000 指数下跌 6.28% 左右。行业间表现差异比较大：通信、传媒、计算机等科技相关行业表现较好，而美容护理、商业贸易、房地产等消费行业表现较差。从量化角度看，低波、反转等量价类因子表现持续较好，而盈利、成长等基本面类因子持续走弱，期间量化策略整体表现一般。

基金投资运作方面，报告期内本基金以多因子量化投资策略为主，选股模型比较符合市场行情

特征，基金净值表现领先比较基准指数，并且有效地控制本基金的跟踪误差。同时，本基金秉承尽职尽责的态度，尽量降低投资者日常申购、赎回等对基金可能带来的影响。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2023 年 12 月 31 日，华夏中证 1000 指数增强 A 基金份额净值为 0.8705 元，本报告期份额净值增长率为-1.47%；华夏中证 1000 指数增强 C 基金份额净值为 0.8634 元，本报告期份额净值增长率为-1.85%，同期业绩比较基准增长率为-5.91%。本基金本报告期 A 类份额跟踪偏离度为+4.44%，C 类份额跟踪偏离度为+4.06%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2024 年政府预计设定较高经济增长目标，货币政策将继续保持宽松，而财政政策将发挥更大作用，A 股上市公司盈利预计温和增长。展望 2024 年，随着投资者悲观情绪逐渐修复，市场预计震荡上行；短期市场风格切换将发生，但长期市场风格维持轮动特征，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。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

托管人声明：

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度报告中利润分配情况真实、准确。

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

本年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§6 审计报告

普华永道中天审字（2024）第 21584 号

华夏中证 1000 指数增强型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

我们审计了华夏中证 1000 指数增强型证券投资基金(以下简称“华夏中证 1000 指数增强”)的财务报表，包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表，2023 年度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，公允反映了华夏中证 1000 指数增强 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度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，我们独立于华夏中证 1000 指数增强，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

华夏中证 1000 指数增强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中证 1000 指数增强的持续经营能力，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中证 1000 指数增强、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中证 1000 指数增强的财务报告过程。

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，就可能导致对华夏中证 1000 指数增强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中证 1000 指数增强不能持续经营。

(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：华夏中证 1000 指数增强型证券投资基金

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	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	7.4.7.1	83,294,936.11	75,057,541.54
结算备付金		4,379,034.62	6,053,988.79
存出保证金		2,806,368.00	2,060,256.00
交易性金融资产	7.4.7.2	856,858,224.32	895,321,510.55
其中：股票投资		855,854,158.30	895,321,510.55
基金投资		-	-
债券投资		1,004,066.02	-
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		94,153.53	190,598.20
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		947,432,716.58	978,683,895.08
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		3,864.00	-
应付赎回款		684,536.87	7,515,932.22

应付管理人报酬		636,164.61	676,775.39
应付托管费		119,280.86	126,895.36
应付销售服务费		234,627.54	302,675.30
应付投资顾问费		-	-
应交税费		2.13	5.96
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	170,124.16	170,035.91
负债合计		1,848,600.17	8,792,320.14
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	1,092,838,421.94	1,101,970,150.75
未分配利润	7.4.7.8	-147,254,305.53	-132,078,575.81
净资产合计		945,584,116.41	969,891,574.94
负债和净资产总计		947,432,716.58	978,683,895.08

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，华夏中证 1000 指数增强 A 基金份额净值 0.8705 元，华夏中证 1000 指数增强 C 基金份额净值 0.8634 元；华夏中证 1000 指数增强基金份额总额 1,092,838,421.94 份（其中 A 类 288,882,639.87 份，C 类 803,955,782.07 份）。

7.2 利润表

会计主体：华夏中证 1000 指数增强型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
一、营业总收入		-3,166,920.94	-110,164,323.42
1.利息收入		355,683.40	421,830.92
其中：存款利息收入	7.4.7.9	355,683.40	421,830.92
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）		-58,885,435.01	-6,740,907.13
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-69,046,057.48	-14,649,500.53
基金投资收益	7.4.7.11	-	-
债券投资收益	7.4.7.12	600,153.10	908,461.88
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	-1,980,389.45	-2,616,392.42
股利收益	7.4.7.16	11,540,858.82	9,616,523.94
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	55,282,688.50	-103,971,122.12
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	80,142.17	125,874.91
减：二、营业总支出		12,853,421.81	12,346,812.43
1.管理人报酬		7,924,780.45	7,450,649.67
2.托管费		1,485,896.33	1,396,996.73
3.销售服务费		3,262,072.55	3,322,338.64
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		4,030.02	2.59
8.其他费用	7.4.7.21	176,642.46	176,824.80
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-16,020,342.75	-122,511,135.85
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-16,020,342.75	-122,511,135.85
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-16,020,342.75	-122,511,135.85

7.3 净资产变动表

会计主体：华夏中证 1000 指数增强型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 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	1,101,970,150.75	-132,078,575.81	969,891,574.94
二、本期期初净资产	1,101,970,150.75	-132,078,575.81	969,891,574.94
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-9,131,728.81	-15,175,729.72	-24,307,458.53
(一)、综合收益总额	-	-16,020,342.75	-16,020,342.75
(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)	-9,131,728.81	844,613.03	-8,287,115.78
其中：1.基金申购款	875,427,557.32	-54,242,688.55	821,184,868.77
2.基金赎回款	-884,559,286.13	55,087,301.58	-829,471,984.55
(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	1,092,838,421.94	-147,254,305.53	945,584,116.41
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 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	1,042,700,448.53	25,855,042.50	1,068,555,491.03
二、本期期初净资产	1,042,700,448.53	25,855,042.50	1,068,555,491.03
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	59,269,702.22	-157,933,618.31	-98,663,916.09
(一)、综合收益总额	-	-122,511,135.85	-122,511,135.85
(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)	59,269,702.22	-35,422,482.46	23,847,219.76
其中：1.基金申购款	625,180,512.08	-64,382,808.02	560,797,704.06
2.基金赎回款	-565,910,809.86	28,960,325.56	-536,950,484.30
(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	1,101,970,150.75	-132,078,575.81	969,891,574.94

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

华夏中证 1000 指数增强型证券投资基金(以下简称“本基金”)已获中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2021]3382 号文《关于准予华夏中证 1000 指数增强型证券投资基金注册的批复》，由华夏基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《华夏中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同》及其他有关法律法规负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限为不定期。本基金自 2021 年 11 月 24 日至 2021 年 12 月 3 日共募集 1,042,462,550.53 元(不含认购资金利息)，业经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)安永华明(2021)验字第 60739337_A181 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华夏中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同》于 2021 年 12 月 7 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,042,700,448.53 份基金份额，其

中认购资金利息折合 237,898.00 份基金份额。本基金的基金管理人为华夏基金管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和本基金基金合同的有关规定，本基金的标的指数为中证 1000 指数。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（含创业板、存托凭证及其他中国证监会注册或核准上市的股票）、港股通标的股票、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、地方政府债券、可转换债券、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、衍生品（包括股指期货、股票期权、国债期货）、资产支持证券、货币市场工具（含同业存单、债券回购等）、银行存款以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金可根据法律法规的规定参与融资、转融通证券出借业务。

本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产的 80%，港股通标的股票的投资比例为股票资产的 0%-15%，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。

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

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

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

(2) 权益工具

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

2、金融负债的分类

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

3、衍生金融工具

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

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

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

本基金参与的转融通证券出借业务，是指基金以一定的费率通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司(以下简称“证金公司”)出借证券，证金公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务。由于基金参与转融通证券出借业务不属于实质性证券转让行为，基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认该出借证券，仍按原金融资产类别进行后续计量，并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息确认为利息收入，将出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为投资收益。

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 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

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

7.4.4.13 分部报告

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

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

本基金目前以一个经营分部运作。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

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

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

票进行估值。

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

3、对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国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。

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

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	上年度末 2022 年 12 月 31 日
活期存款	26,875,786.35	42,789,127.18
等于: 本金	26,873,072.27	42,784,660.20
加: 应计利息	2,714.08	4,466.98
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	56,419,149.76	32,268,414.36
等于: 本金	56,415,547.01	32,264,634.92
加: 应计利息	3,602.75	3,779.44
合计	83,294,936.11	75,057,541.54

注: 其他存款为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

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	877,066,529.33	-	855,854,158.30	-21,212,371.03	
贵金属投资- 金交所黄金 合约	-	-	-	-	
债券	交易所市 场	1,004,000.00	66.02	1,004,066.02	-
	银行 间市	-	-	-	-

	场				
	合计	1,004,000.00	66.02	1,004,066.02	-
资产支持证 券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		878,070,529.33	66.02	856,858,224.32	-21,212,371.03
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日				
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		971,905,180.75	-	895,321,510.55	-76,583,670.20
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		971,905,180.75	-	895,321,510.55	-76,583,670.20

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

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	23,875,264.00	-	-	-
其中：股指期货	23,875,264.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	23,875,264.00	-	-	-
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	

利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	14,135,293.33	-	-	-
其中：股指期货	14,135,293.33	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	14,135,293.33	-	-	-

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IM2403	中证 1000 期货 IM2403 合约	20	23,386,400.00	-488,864.00
合计	-	-	-	-488,864.00
减：可抵销期货暂 收款	-	-	-	-488,864.00
净额				-

注：衍生金融资产项下的利率/权益/其他衍生工具为国债/股指/商品期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指/商品/国债期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指/商品/国债期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间抵销后的净额为 0。

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	上年度末 2022 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	124.16	35.91
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	-	-
其中：交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	170,000.00	170,000.00

合计	170,124.16	170,035.91
----	------------	------------

7.4.7.7 实收基金

华夏中证 1000 指数增强 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	117,133,015.72	117,133,015.72
本期申购	362,446,853.35	362,446,853.35
本期赎回（以“-”号填列）	-190,697,229.20	-190,697,229.20
本期末	288,882,639.87	288,882,639.87

华夏中证 1000 指数增强 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	984,837,135.03	984,837,135.03
本期申购	512,980,703.97	512,980,703.97
本期赎回（以“-”号填列）	-693,862,056.93	-693,862,056.93
本期末	803,955,782.07	803,955,782.07

7.4.7.8 未分配利润

华夏中证 1000 指数增强 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-1,584,646.98	-12,061,262.49	-13,645,909.47
本期期初	-1,584,646.98	-12,061,262.49	-13,645,909.47
本期利润	-14,853,852.17	4,401,608.06	-10,452,244.11
本期基金份额交易产生的变动数	-5,025,256.73	-8,286,559.41	-13,311,816.14
其中：基金申购款	-11,163,925.54	-21,404,661.53	-32,568,587.07
基金赎回款	6,138,668.81	13,118,102.12	19,256,770.93
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-21,463,755.88	-15,946,213.84	-37,409,969.72

华夏中证 1000 指数增强 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-17,130,995.60	-101,301,670.74	-118,432,666.34
本期期初	-17,130,995.60	-101,301,670.74	-118,432,666.34
本期利润	-56,449,179.08	50,881,080.44	-5,568,098.64
本期基金份额交易产	8,205,718.51	5,950,710.66	14,156,429.17

生的变动数			
其中：基金申购款	-4,234,195.15	-17,439,906.33	-21,674,101.48
基金赎回款	12,439,913.66	23,390,616.99	35,830,530.65
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-65,374,456.17	-44,469,879.64	-109,844,335.81

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	129,796.39	132,976.32
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	119,298.38	158,880.72
结算备付金利息收入	106,588.63	129,973.88
其他	-	-
合计	355,683.40	421,830.92

注：其他存款利息收入为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金产生的利息收入。

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	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-69,046,057.48	-14,649,500.53
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	-69,046,057.48	-14,649,500.53

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	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	2,241,840,271.52	1,745,173,785.74
减：卖出股票成本总额	2,306,158,732.98	1,755,805,941.06

减：交易费用	4,727,596.02	4,017,345.21
买卖股票差价收入	-69,046,057.48	-14,649,500.53

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1月1日至2023年12月31 日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31 日
债券投资收益——利息收入	476.16	726.18
债券投资收益——买卖债券 (债转股及债券到期兑付) 差价收入	599,676.94	907,735.70
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	600,153.10	908,461.88

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1月1日至2023年12月31 日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31 日
卖出债券(债转股及债券到期 兑付) 成交总额	2,673,179.08	4,392,164.40
减：卖出债券(债转股及债券到 期兑付) 成本总额	2,072,500.00	3,482,800.00
减：应计利息总额	424.44	747.81
减：交易费用	577.70	880.89
买卖债券差价收入	599,676.94	907,735.70

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

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
股指期货投资收益	-1,980,389.45	-2,616,392.42

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
股票投资产生的股利收益	11,540,858.82	9,616,523.94
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	11,540,858.82	9,616,523.94

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
1.交易性金融资产	55,371,299.17	-103,570,868.79
——股票投资	55,371,299.17	-103,570,868.79
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	-88,610.67	-400,253.33
——权证投资	-	-
——期货投资	-88,610.67	-400,253.33
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	55,282,688.50	-103,971,122.12

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
基金赎回费收入	80,142.17	125,874.91

合计	80,142.17	125,874.91
----	-----------	------------

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1月1日至2023年12月31 日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31 日
审计费用	50,000.00	50,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行费用	6,642.46	6,824.80
合计	176,642.46	176,824.80

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
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	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
POWER CORPORATION OF CANADA	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
华夏资本管理有限公司（“华夏资本”）	基金管理人的子公司
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
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
上海华夏财富投资管理有限公司（“华夏财富”）	基金管理人的子公司
中信期货有限公司（“中信期货”）	基金管理人第一大股东的子公司
中信证券(山东)有限责任公司（“中信证券（山东）”）	基金管理人第一大股东的子公司
中信证券华南股份有限公司（“中信证券（华南）”）	基金管理人第一大股东的子公司

注：①根据华夏基金管理有限公司于 2023 年 1 月 6 日发布的公告，华夏基金管理有限公司股权

结构变更为中信证券（出资比例 62.2%）、MACKENZIE FINANCIAL CORPORATION（出资比例 27.8%）、天津海鹏科技咨询有限公司（出资比例 10%）。

②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

无。

7.4.10.1.2 权证交易

无。

7.4.10.1.3 债券交易

无。

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

无。

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1月1日至2023年12 月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12 月31日
当期发生的基金应支付的管理费	7,924,780.45	7,450,649.67
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,838,864.74	2,631,283.99
应支付基金管理人的净管理费	6,085,915.71	4,819,365.68

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1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,485,896.33	1,396,996.73

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1月1日至2023年12月31日 当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华夏中证 1000 指数增强 A	华夏中证 1000 指数增强 C	合计
华夏基金管理有限公司	-	1,328,852.74	1,328,852.74
招商银行	-	9,451.27	9,451.27
中信证券	-	7,623.45	7,623.45
中信证券（山东）	-	1,366.49	1,366.49
华夏财富	-	1,079.48	1,079.48
中信证券（华南）	-	38.13	38.13
中信期货	-	12.62	12.62
合计	-	1,348,424.18	1,348,424.18
	上年度可比期间		

获得销售服务费的各关联方名称	2022年1月1日至2022年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华夏中证 1000 指数增强 A	华夏中证 1000 指数增强 C	合计
华夏基金管理有限公司	-	948,056.83	948,056.83
中信证券（山东）	-	1,862.83	1,862.83
招商银行	-	1,505.30	1,505.30
中信证券	-	1,089.39	1,089.39
华夏财富	-	1,030.40	1,030.40
中信期货	-	98.40	98.40
中信证券（华南）	-	12.39	12.39
合计	-	953,655.54	953,655.54

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

无。

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1月1日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行活期存款	26,875,786.35	129,796.39	42,789,127.18	132,976.32

注：本基金的活期银行存款由基金托管人招商银行保管，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

金额单位：人民币元

本期 2023年1月1日至2023年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
中信证券	688343	云天励飞	新股发行	14,810	650,455.20
中信证券	688563	航材股份	新股发行	7,766	613,436.34
中信证券	688146	中船特气	新股发行	10,101	365,151.15
中信证券	001286	陕西能源	新股发行	37,667	361,603.20
中信证券	603296	华勤技术	新股发行	3,950	319,160.00
中信证券	301371	敷尔佳	新股发行	5,637	313,868.16
中信证券	301559	中集环科	新股发行	11,492	278,336.24
中信证券	688581	安杰思	新股发行	1,629	204,928.20
中信证券	688539	高华科技	新股发行	5,334	203,865.48
中信证券	688522	纳睿雷达	新股发行	4,299	200,677.32
中信证券	301439	泓淋电力	新股发行	9,486	189,625.14
中信证券	688523	航天环宇	新股发行	4,717	103,113.62
中信证券	301293	三博脑科	新股发行	3,324	98,390.40
中信证券	301323	新莱福	新股发行	2,277	88,939.62

中信证券	688450	光格科技	新股发行	1,662	88,235.58
中信证券	688631	莱斯信息	新股发行	3,357	84,864.96
中信证券	301170	锡南科技	新股发行	2,496	84,864.00
中信证券	301157	华塑科技	新股发行	1,498	84,637.00
中信证券	601133	柏诚股份	新股发行	6,632	77,329.12
中信证券	301261	恒工精密	新股发行	1,973	72,803.70
中信证券	301517	陕西华达	新股发行	1,841	49,467.67
中信证券	603281	江瀚新材	新股发行	863	30,714.17
中信证券	001367	海森药业	新股发行	549	24,419.52
中信证券	001324	长青科技	新股发行	1,131	21,353.28
中信证券	603162	海通发展	新股发行	523	19,481.75
上年度可比期间					
2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 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	688223	晶科能源	新股发行	134,261	671,305.00
中信证券	688382	益方生物	新股发行	36,208	656,088.96
中信证券	688302	海创药业	新股发行	13,082	561,479.44
中信证券	688061	灿瑞科技	新股发行	3,839	432,616.91
中信证券	688380	中微半导	新股发行	12,677	391,212.22
中信证券	301200	大族数控	新股发行	5,082	389,077.92
中信证券	688141	杰华特	新股发行	9,946	380,533.96
中信证券	688114	华大智造	新股发行	4,351	379,320.18
中信证券	301165	锐捷网络	新股发行	10,769	348,700.22
中信证券	301269	华大九天	新股发行	10,528	344,160.32
中信证券	688326	经纬恒润	新股发行	2,809	339,889.00
中信证券	301109	军信股份	新股发行	8,942	311,271.02
中信证券	301349	信德新材	新股发行	1,798	249,706.24
中信证券	301302	华如科技	新股发行	4,651	241,991.53
中信证券	301335	天元宠物	新股发行	4,192	209,516.16
中信证券	688432	有研硅	新股发行	20,044	198,636.04
中信证券	688370	丛麟科技	新股发行	3,254	194,459.04
中信证券	688426	康为世纪	新股发行	3,776	184,948.48
中信证券	301171	易点天下	新股发行	9,845	178,982.10
中信证券	301377	鼎泰高科	新股发行	7,695	176,061.60
中信证券	688150	莱特光电	新股发行	5,626	124,053.30
中信证券	688252	天德钰	新股发行	5,201	112,757.68
中信证券	301230	泓博医药	新股发行	2,687	107,480.00
中信证券	688290	景业智能	新股发行	3,040	103,025.60
中信证券	688525	佰维存储	新股发行	4,614	64,549.86
中信证券	600938	中国海油	新股发行	3,000	32,400.00
中信证券	603235	天新药业	新股发行	572	21,095.36
中信证券	001322	箭牌家居	新股发行	1,595	20,224.60

中信证券	001330	博纳影业	新股发行	3,564	17,926.92
中信证券	603132	金徽股份	新股发行	1,342	14,493.60
中信证券	001339	智微智能	新股发行	812	13,690.32
中信证券	603191	望变电气	新股发行	1,149	13,627.14
中信证券	603209	兴通股份	新股发行	595	12,804.40
中信证券	603151	邦基科技	新股发行	535	9,603.25
中信证券	001266	宏英智能	新股发行	247	9,536.67
中信证券	603215	比依股份	新股发行	575	7,187.50
中信证券	603051	鹿山新材	新股发行	272	7,014.88

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：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688717	艾罗能源	2023-12-26	6 个月	新发流通受限	55.66	55.66	11,303	629,124.98	629,124.98	-
688717	艾罗能源	2023-12-26	1 个月内 (含)	新发流通受限	55.66	55.66	4,844	269,617.04	269,617.04	-
688548	广钢气体	2023-08-08	6 个月	新发流通受限	9.87	12.75	4,048	39,953.76	51,612.00	-

				限						
688563	航材股份	2023-07-12	6 个月	新发流通受限	78.99	60.49	777	61,375.23	47,000.73	-
301526	国际复材	2023-12-19	6 个月	新发流通受限	2.66	4.45	9,723	25,863.18	43,267.35	-
301291	明阳电气	2023-06-21	6 个月	新发流通受限	38.13	28.36	1,206	45,984.78	34,202.16	-
603296	华勤技术	2023-08-01	6 个月	新发流通受限	80.80	77.75	395	31,916.00	30,711.25	-
301348	蓝箭电子	2023-08-01	6 个月	新发流通受限	18.08	44.57	613	11,083.04	27,321.41	-
688702	盛科通信	2023-09-06	6 个月	新发流通受限	42.66	48.18	549	23,420.34	26,450.82	-
688582	芯动联科	2023-06-21	6 个月	新发流通受限	26.74	38.67	648	17,327.52	25,058.16	-
301486	致尚	2023-06-30	6 个月	新发	57.66	47.25	482	27,792.12	22,774.50	-

	科技			流通受限						
301511	德福科技	2023-08-08	6 个月	新发流通受限	28.00	22.67	982	27,496.00	22,261.94	-
688652	京仪装备	2023-11-22	6 个月	新发流通受限	31.95	52.25	416	13,291.20	21,736.00	-
301525	儒竞科技	2023-08-23	6 个月	新发流通受限	99.57	81.46	266	26,485.62	21,668.36	-
301498	乖宝宠物	2023-08-09	6 个月	新发流通受限	39.99	38.81	554	22,154.46	21,500.74	-
301371	敷尔佳	2023-07-24	6 个月	新发流通受限	55.68	37.58	564	31,403.52	21,195.12	-
301559	中集环科	2023-09-26	6 个月	新发流通受限	24.22	18.24	1,150	27,853.00	20,976.00	-
301370	国科恒泰	2023-07-03	6 个月	新发流通受限	13.39	16.01	1,240	16,603.60	19,852.40	-

				限						
688627	精智达	2023-07-11	6 个月	新发流通受限	46.77	87.72	222	10,382.94	19,473.84	-
301488	豪恩汽电	2023-06-26	6 个月	新发流通受限	39.78	69.09	262	10,422.36	18,101.58	-
301468	博盈特焊	2023-07-12	6 个月	新发流通受限	47.58	30.22	598	28,452.84	18,071.56	-
301381	赛维时代	2023-07-05	6 个月	新发流通受限	20.45	29.69	571	11,676.95	16,952.99	-
301172	君逸数码	2023-07-19	6 个月	新发流通受限	31.33	38.16	438	13,722.54	16,714.08	-
301362	民爆光电	2023-07-27	6 个月	新发流通受限	51.05	38.52	420	21,441.00	16,178.40	-
688612	威迈斯	2023-07-19	6 个月	新发流通受限	47.29	37.97	422	19,956.38	16,023.34	-
601096	宏盛	2023-12-15	6 个月	新发	1.70	4.06	3,918	6,660.60	15,907.08	-

	华源			流通受限						
301393	昊帆生物	2023-07-05	6 个月	新发流通受限	67.68	59.37	260	17,596.80	15,436.20	-
688610	埃科光电	2023-07-10	6 个月	新发流通受限	73.33	51.00	275	20,165.75	14,025.00	-
601083	锦江航运	2023-11-28	6 个月	新发流通受限	11.25	11.07	1,263	14,208.75	13,981.41	-
301510	固高科技	2023-08-04	6 个月	新发流通受限	12.00	35.01	396	4,752.00	13,863.96	-
301210	金杨股份	2023-06-21	6 个月	新发流通受限	57.88	45.48	281	16,264.28	12,779.88	-
301566	达利凯普	2023-12-22	6 个月	新发流通受限	8.90	22.14	576	5,126.40	12,752.64	-
301456	盘古智能	2023-07-06	6 个月	新发流通受限	37.96	30.39	407	15,449.72	12,368.73	-

				限						
688602	康鹏科技	2023-07-13	6 个月	新发流通受限	8.66	11.06	1,066	9,231.56	11,789.96	-
688719	爱科赛博	2023-09-20	6 个月	新发流通受限	69.98	60.10	194	13,576.12	11,659.40	-
301550	斯菱股份	2023-09-06	6 个月	新发流通受限	37.56	43.57	260	9,765.60	11,328.20	-
301292	海科新源	2023-06-29	6 个月	新发流通受限	19.99	19.35	583	11,654.17	11,281.05	-
301508	中机认检	2023-11-23	6 个月	新发流通受限	16.82	26.68	419	7,047.58	11,178.92	-
688603	天承科技	2023-06-30	6 个月	新发流通受限	55.00	74.14	140	7,700.00	10,379.60	-
301528	多浦乐	2023-08-17	6 个月	新发流通受限	71.80	68.91	148	10,626.40	10,198.68	-
301329	信音	2023-07-05	6 个月	新发	21.00	22.23	458	9,618.00	10,181.34	-

	电子			流通受限						
301372	科净源	2023-08-03	6 个月	新发流通受限	45.00	43.59	231	10,395.00	10,069.29	-
301261	恒工精密	2023-06-29	6 个月	新发流通受限	36.90	50.85	198	7,306.20	10,068.30	-
301202	朗威股份	2023-06-28	6 个月	新发流通受限	25.82	31.80	306	7,900.92	9,730.80	-
301395	仁信新材	2023-06-21	6 个月	新发流通受限	26.68	18.69	520	13,873.60	9,718.80	-
301413	安培龙	2023-12-11	6 个月	新发流通受限	33.25	58.19	164	5,453.00	9,543.16	-
301500	飞南资源	2023-09-13	6 个月	新发流通受限	23.97	20.89	455	10,906.35	9,504.95	-
301418	协昌科技	2023-08-10	6 个月	新发流通受	51.88	50.20	189	9,805.32	9,487.80	-

				限						
301516	中远通	2023-12-01	6 个月	新发流通受限	6.87	15.51	604	4,149.48	9,368.04	-
301272	英华特	2023-07-06	6 个月	新发流通受限	51.39	53.38	173	8,890.47	9,234.74	-
301469	恒达新材	2023-08-10	6 个月	新发流通受限	36.58	33.09	275	10,059.50	9,099.75	-
301519	舜禹股份	2023-07-19	6 个月	新发流通受限	20.93	20.21	442	9,251.06	8,932.82	-
301518	长华化学	2023-07-26	6 个月	新发流通受限	25.75	23.01	385	9,913.75	8,858.85	-
301568	思泰克	2023-11-21	6 个月	新发流通受限	23.23	35.58	246	5,714.58	8,752.68	-
301520	万邦医药	2023-09-18	6 个月	新发流通受限	67.88	52.74	160	10,860.80	8,438.40	-
688638	誉辰	2023-07-04	6 个月	新发	83.90	59.68	141	11,829.90	8,414.88	-

	智能			流通受限						
301459	丰茂股份	2023-12-06	6 个月	新发流通受限	31.90	39.84	208	6,635.20	8,286.72	-
688720	艾森股份	2023-11-29	6 个月	新发流通受限	28.03	49.84	165	4,624.95	8,223.60	-
301489	思泉新材	2023-10-16	6 个月	新发流通受限	41.66	64.11	128	5,332.48	8,206.08	-
688651	盛邦安全	2023-07-19	6 个月	新发流通受限	39.90	46.05	178	7,102.20	8,196.90	-
301517	陕西华达	2023-10-09	6 个月	新发流通受限	26.87	43.69	185	4,970.95	8,082.65	-
301578	辰奕智能	2023-12-21	6 个月	新发流通受限	48.94	68.32	118	5,774.92	8,061.76	-
301548	崇德科技	2023-09-11	6 个月	新发流通受	66.80	58.99	136	9,084.80	8,022.64	-

				限						
688657	浩辰软件	2023-09-25	6 个月	新发流通受限	103.40	78.23	101	10,443.40	7,901.23	-
688671	碧兴物联	2023-08-02	6 个月	新发流通受限	36.12	34.30	226	8,163.12	7,751.80	-
688693	锆威特	2023-08-10	6 个月	新发流通受限	40.83	43.41	178	7,267.74	7,726.98	-
603275	众辰科技	2023-08-16	6 个月	新发流通受限	49.97	39.70	193	9,644.21	7,662.10	-
301533	威马农机	2023-08-07	6 个月	新发流通受限	29.50	33.16	225	6,637.50	7,461.00	-
603062	麦加芯彩	2023-10-31	6 个月	新发流通受限	58.08	57.81	126	7,318.08	7,284.06	-
301555	惠柏新材	2023-10-24	6 个月	新发流通受限	22.88	32.44	224	5,125.12	7,266.56	-
301505	苏州	2023-07-12	6 个月	新发	26.35	35.81	194	5,111.90	6,947.14	-

	规划			流通受限						
301529	福赛科技	2023-08-31	6 个月	新发流通受限	36.60	37.88	182	6,661.20	6,894.16	-
301515	港通医疗	2023-07-13	6 个月	新发流通受限	31.16	28.27	230	7,166.80	6,502.10	-
688648	中邮科技	2023-11-06	6 个月	新发流通受限	15.18	21.43	303	4,599.54	6,493.29	-
001378	德冠新材	2023-10-23	6 个月	新发流通受限	31.68	31.27	205	6,494.40	6,410.35	-
688450	光格科技	2023-07-17	6 个月	新发流通受限	53.09	36.42	167	8,866.03	6,082.14	-
603004	鼎龙科技	2023-12-20	6 个月	新发流通受限	16.80	31.19	195	3,276.00	6,082.05	-
603119	浙江荣泰	2023-07-21	6 个月	新发流通受	15.32	23.87	226	3,462.32	5,394.62	-

				限						
001306	夏厦精密	2023-11-09	6 个月	新发流通受限	53.63	75.36	64	3,432.32	4,823.04	-
603075	热威股份	2023-09-01	6 个月	新发流通受限	23.10	23.31	182	4,204.20	4,242.42	-
001358	兴欣新材	2023-12-14	6 个月	新发流通受限	41.00	44.16	87	3,567.00	3,841.92	-
001239	永达股份	2023-12-04	6 个月	新发流通受限	12.05	19.92	189	2,277.45	3,764.88	-
603231	索宝蛋白	2023-12-06	6 个月	新发流通受限	21.29	21.53	161	3,427.69	3,466.33	-
603273	天元智能	2023-10-16	6 个月	新发流通受限	9.50	18.97	178	1,691.00	3,376.66	-
603276	恒兴新材	2023-09-18	6 个月	新发流通受限	25.73	24.88	134	3,447.82	3,333.92	-
603373	安邦	2023-12-13	6 个月	新发	19.10	34.75	88	1,680.80	3,058.00	-

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
113069	博 23 转债	2023-12-22	1 个月内 (含)	新发流通受限	100.00	100.01	10,040	1,004,000.00	1,004,066.02	期末估值单价为含息价格

注：①根据中国证监会《上市公司证券发行注册管理办法》，基金参与上市公司向特定对象发行股票所获得的股票，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。

②基金还可作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

③根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

④基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的设定限售期的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

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，以中证 1000 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		上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净	公允价值	占基金 资产净

		值比例 (%)		值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	855,854,158.30	90.51	895,321,510.55	92.31
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	1,004,066.02	0.11	-	-
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	856,858,224.32	90.62	895,321,510.55	92.31

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	除中证 1000 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	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	-5%	-40,953,776.45	-45,274,807.95
	+5%	40,953,776.45	45,274,807.95

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	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	853,919,169.34	893,022,326.67
第二层次	1,902,808.04	385,863.40
第三层次	1,036,246.94	1,913,320.48
合计	856,858,224.32	895,321,510.55

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。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位: 人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	1,913,320.48	1,913,320.48
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	2,434,416.02	2,434,416.02
转出第三层次	-	4,407,467.37	4,407,467.37
当期利得或损失总额	-	1,095,977.81	1,095,977.81
其中: 计入损益的利得或损失	-	1,095,977.81	1,095,977.81
计入其他综合收益的利得或损失 (若有)	-	-	-
期末余额	-	1,036,246.94	1,036,246.94
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	66,520.34	66,520.34
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	2,064,064.80	2,064,064.80
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	-150,744.32	-150,744.32
其中: 计入损益的利得或损失	-	-150,744.32	-150,744.32
计入其他综合	-	-	-

收益的利得或损失 (若有)			
期末余额	-	1,913,320.48	1,913,320.48
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-150,744.32	-150,744.32

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	1,036,246.94	平均价格亚式期权模型	预期年化波动率	0.1462-2.1988	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	1,913,320.48	平均价格亚式期权模型	预期年化波动率	0.1891-2.4756	负相关

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	855,854,158.30	90.33
	其中：股票	855,854,158.30	90.33

2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,004,066.02	0.11
	其中：债券	1,004,066.02	0.11
	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	87,673,970.73	9.25
8	其他各项资产	2,900,521.53	0.31
9	合计	947,432,716.58	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	5,922,304.00	0.63
B	采矿业	21,961,989.20	2.32
C	制造业	618,623,887.31	65.42
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	27,062,065.50	2.86
E	建筑业	19,127,003.16	2.02
F	批发和零售业	16,016,455.39	1.69
G	交通运输、仓储和邮政业	14,235,551.10	1.51
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	56,522,861.10	5.98
J	金融业	18,755,108.30	1.98
K	房地产业	12,953,134.40	1.37
L	租赁和商务服务业	12,376,297.60	1.31
M	科学研究和技术服务业	7,939,394.00	0.84
N	水利、环境和公共设施管理业	176,148.36	0.02
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	7,275,600.00	0.77
R	文化、体育和娱乐业	13,443,795.00	1.42
S	综合	-	-
	合计	852,391,594.42	90.14

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	-	-
C	制造业	3,239,955.13	0.34
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	453.60	0.00
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	19,852.40	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	13,981.41	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	84,153.60	0.01
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	3,058.00	0.00
M	科学研究和技术服务业	68,515.98	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	32,593.76	0.00
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	3,462,563.88	0.37

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	002737	葵花药业	311,400	8,090,172.00	0.86
2	603171	税友股份	227,000	8,031,260.00	0.85
3	600312	平高电气	625,700	7,940,133.00	0.84
4	601965	中国汽研	359,900	7,939,394.00	0.84
5	600761	安徽合力	433,500	7,894,035.00	0.83
6	688639	华恒生物	62,475	7,865,602.50	0.83
7	601567	三星医疗	381,400	7,818,700.00	0.83
8	688676	金盘科技	217,740	7,801,624.20	0.83
9	688127	蓝特光学	333,500	7,767,215.00	0.82
10	600428	中远海特	1,427,600	7,651,936.00	0.81

11	002990	盛视科技	221,300	7,641,489.00	0.81
12	688266	泽璟制药	142,493	7,543,579.42	0.80
13	688088	虹软科技	183,147	7,516,352.88	0.79
14	688578	艾力斯	179,716	7,486,968.56	0.79
15	600586	金晶科技	1,117,000	7,461,560.00	0.79
16	688278	特宝生物	142,500	7,459,875.00	0.79
17	002130	沃尔核材	985,500	7,440,525.00	0.79
18	601702	华峰铝业	412,500	7,404,375.00	0.78
19	688016	心脉医疗	37,931	7,382,510.53	0.78
20	600480	凌云股份	808,000	7,360,880.00	0.78
21	600971	恒源煤电	658,900	7,346,735.00	0.78
22	002096	易普力	707,500	7,329,700.00	0.78
23	603505	金石资源	268,900	7,300,635.00	0.77
24	300627	华测导航	235,300	7,299,006.00	0.77
25	000543	皖能电力	1,163,900	7,286,014.00	0.77
26	002985	北摩高科	209,821	7,276,592.28	0.77
27	301239	普瑞眼科	84,600	7,275,600.00	0.77
28	300406	九强生物	380,500	7,267,550.00	0.77
29	600976	健民集团	111,000	7,242,750.00	0.77
30	603439	贵州三力	383,600	7,242,368.00	0.77
31	601163	三角轮胎	501,200	7,222,292.00	0.76
32	002212	天融信	735,000	7,188,300.00	0.76
33	600587	新华医疗	278,700	7,187,673.00	0.76
34	603298	杭叉集团	288,600	7,180,368.00	0.76
35	601801	皖新传媒	1,030,100	7,159,195.00	0.76
36	688389	普门科技	317,992	7,157,999.92	0.76
37	601137	博威合金	460,900	7,157,777.00	0.76
38	000811	冰轮环境	526,300	7,141,891.00	0.76
39	300130	新国都	294,500	7,126,900.00	0.75
40	600601	方正科技	2,463,000	7,118,070.00	0.75
41	002274	华昌化工	942,000	7,112,100.00	0.75
42	002724	海洋王	864,600	7,107,012.00	0.75
43	603699	纽威股份	512,000	7,096,320.00	0.75
44	002126	银轮股份	379,300	7,081,531.00	0.75
45	601126	四方股份	497,000	7,037,520.00	0.74
46	000923	河钢资源	417,500	7,014,000.00	0.74
47	603920	世运电路	381,500	6,973,820.00	0.74
48	605123	派克新材	76,400	6,967,680.00	0.74
49	688568	中科星图	141,800	6,956,708.00	0.74
50	688789	宏华数科	69,323	6,926,060.93	0.73
51	600459	贵研铂业	479,500	6,885,620.00	0.73
52	002643	万润股份	415,000	6,884,850.00	0.73
53	000065	北方国际	610,500	6,849,810.00	0.72
54	301015	百洋医药	190,906	6,845,889.16	0.72

55	300346	南大光电	246,220	6,798,134.20	0.72
56	000966	长源电力	1,531,500	6,784,545.00	0.72
57	688050	爱博医疗	39,274	6,756,698.96	0.71
58	601890	亚星锚链	681,800	6,749,820.00	0.71
59	002913	奥士康	220,000	6,743,000.00	0.71
60	603300	华铁应急	1,053,340	6,741,376.00	0.71
61	600502	安徽建工	1,449,340	6,739,431.00	0.71
62	688239	航宇科技	141,000	6,735,570.00	0.71
63	300638	广和通	352,400	6,706,172.00	0.71
64	002276	万马股份	654,900	6,693,078.00	0.71
65	600458	时代新材	724,700	6,674,487.00	0.71
66	002063	远光软件	1,075,916	6,649,160.88	0.70
67	688106	金宏气体	274,925	6,622,943.25	0.70
68	688019	安集科技	41,346	6,605,436.96	0.70
69	688190	云路股份	92,161	6,601,492.43	0.70
70	603197	保隆科技	117,000	6,598,800.00	0.70
71	603179	新泉股份	130,000	6,592,300.00	0.70
72	600007	中国国贸	339,400	6,577,572.00	0.70
73	002959	小熊电器	126,500	6,569,145.00	0.69
74	600483	福能股份	790,250	6,535,367.50	0.69
75	688173	希荻微	371,202	6,529,443.18	0.69
76	688033	天宜上佳	385,611	6,516,825.90	0.69
77	002402	和而泰	453,000	6,473,370.00	0.68
78	603063	禾望电气	257,900	6,447,500.00	0.68
79	002206	海利得	1,282,000	6,435,640.00	0.68
80	600201	生物股份	594,400	6,401,688.00	0.68
81	603187	海容冷链	421,960	6,396,913.60	0.68
82	603323	苏农银行	1,532,350	6,374,576.00	0.67
83	300666	江丰电子	108,815	6,374,382.70	0.67
84	688556	高测股份	163,132	6,360,516.68	0.67
85	688100	威胜信息	219,165	6,338,251.80	0.67
86	601882	海天精工	241,200	6,307,380.00	0.67
87	600210	紫江企业	1,340,023	6,298,108.10	0.67
88	601019	山东出版	670,000	6,284,600.00	0.66
89	603871	嘉友国际	394,992	6,264,573.12	0.66
90	603027	千禾味业	386,908	6,256,302.36	0.66
91	000567	海德股份	588,500	6,255,755.00	0.66
92	603690	至纯科技	242,780	6,239,446.00	0.66
93	688366	昊海生科	57,600	6,237,504.00	0.66
94	688037	芯源微	46,641	6,231,704.01	0.66
95	002351	漫步者	351,600	6,212,772.00	0.66
96	600098	广州发展	1,155,500	6,205,035.00	0.66
97	301087	可孚医疗	162,803	6,170,233.70	0.65
98	600933	爱柯迪	281,100	6,167,334.00	0.65

99	002461	珠江啤酒	778,300	6,148,570.00	0.65
100	600908	无锡银行	1,212,600	6,123,630.00	0.65
101	600641	万业企业	354,740	6,122,812.40	0.65
102	000528	柳工	900,600	6,070,044.00	0.64
103	002158	汉钟精机	270,300	6,016,878.00	0.64
104	002283	天润工业	1,026,300	6,003,855.00	0.63
105	300634	彩讯股份	293,200	6,001,804.00	0.63
106	300775	三角防务	215,100	6,001,290.00	0.63
107	002847	盐津铺子	86,000	5,975,280.00	0.63
108	002458	益生股份	550,400	5,922,304.00	0.63
109	300119	瑞普生物	360,692	5,911,741.88	0.63
110	002335	科华数据	212,663	5,886,511.84	0.62
111	603567	珍宝岛	479,700	5,833,152.00	0.62
112	600273	嘉化能源	667,200	5,731,248.00	0.61
113	300109	新开源	316,000	5,700,640.00	0.60
114	002484	江海股份	352,000	5,653,120.00	0.60
115	605168	三人行	88,935	5,634,921.60	0.60
116	301039	中集车辆	597,200	5,601,736.00	0.59
117	002060	粤水电	1,127,700	5,537,007.00	0.59
118	002706	良信股份	617,000	5,448,110.00	0.58
119	002612	朗姿股份	282,500	5,432,475.00	0.57
120	603170	宝立食品	320,500	5,419,655.00	0.57
121	300855	图南股份	178,470	5,389,794.00	0.57
122	002851	麦格米特	212,500	5,227,500.00	0.55
123	603556	海兴电力	156,900	4,554,807.00	0.48
124	300476	胜宏科技	234,600	4,328,370.00	0.46
125	300910	瑞丰新材	84,100	3,863,554.00	0.41
126	603566	普莱柯	127,800	2,894,670.00	0.31
127	688617	惠泰医疗	7,400	2,874,900.00	0.30
128	600285	羚锐制药	149,400	2,556,234.00	0.27
129	601678	滨化股份	518,200	2,181,622.00	0.23
130	603368	柳药集团	100,997	1,910,863.24	0.20
131	300224	正海磁材	123,600	1,448,592.00	0.15
132	688198	佰仁医疗	8,373	1,042,689.69	0.11
133	002139	拓邦股份	87,500	854,000.00	0.09
134	600330	天通股份	53,900	465,157.00	0.05
135	002635	安洁科技	21,400	349,462.00	0.04
136	301291	明阳电气	11,854	336,179.44	0.04
137	600125	铁龙物流	52,400	317,020.00	0.03
138	600123	兰花科创	27,230	300,619.20	0.03
139	002100	天康生物	33,700	295,549.00	0.03
140	600639	浦东金桥	25,000	252,750.00	0.03
141	603693	江苏新能	22,400	251,104.00	0.03
142	600557	康缘药业	11,800	242,136.00	0.03

143	600562	国睿科技	17,300	239,432.00	0.03
144	300101	振芯科技	10,213	233,162.79	0.02
145	601908	京运通	44,200	201,994.00	0.02
146	002539	云图控股	23,700	195,525.00	0.02
147	603588	高能环境	26,934	176,148.36	0.02
148	603678	火炬电子	6,500	172,055.00	0.02
149	301381	赛维时代	571	16,952.99	0.00
150	301363	美好医疗	445	16,376.00	0.00
151	301316	慧博云通	359	8,343.16	0.00
152	603236	移远通信	57	3,063.75	0.00
153	603713	密尔克卫	38	2,021.98	0.00
154	300685	艾德生物	76	1,670.48	0.00
155	603733	仙鹤股份	86	1,388.04	0.00
156	300623	捷捷微电	83	1,317.21	0.00
157	002597	金禾实业	54	1,183.14	0.00
158	002961	瑞达期货	77	1,147.30	0.00
159	300432	富临精工	88	924.00	0.00
160	603583	捷昌驱动	46	921.38	0.00
161	002051	中工国际	93	755.16	0.00
162	300458	全志科技	33	748.77	0.00
163	603728	鸣志电器	10	658.50	0.00
164	002258	利尔化学	51	610.47	0.00
165	603612	索通发展	30	461.70	0.00
166	300035	中科电气	35	368.90	0.00
167	603876	鼎胜新材	20	250.60	0.00
168	601677	明泰铝业	20	226.80	0.00
169	600740	山西焦化	44	221.76	0.00
170	688128	中国电研	8	164.16	0.00
171	000672	上峰水泥	16	128.96	0.00
172	002145	中核钛白	20	89.60	0.00
173	600360	华微电子	2	14.46	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	688717	艾罗能源	16,147.00	898,742.02	0.10
2	300740	水羊股份	20,700.00	345,069.00	0.04
3	300487	蓝晓科技	4,750.00	252,035.00	0.03
4	600416	湘电股份	13,800.00	219,144.00	0.02
5	600378	昊华科技	6,700.00	204,216.00	0.02
6	688450	光格科技	1,662.00	61,217.74	0.01
7	301210	金杨股份	1,201.00	54,621.48	0.01
8	688548	广钢气体	4,048.00	51,612.00	0.01

9	688563	航材股份	777.00	47,000.73	0.00
10	301526	国际复材	9,723.00	43,267.35	0.00
11	603296	华勤技术	395.00	30,711.25	0.00
12	301391	卡莱特	247.00	28,276.56	0.00
13	301348	蓝箭电子	613.00	27,321.41	0.00
14	688702	盛科通信	549.00	26,450.82	0.00
15	688582	芯动联科	648.00	25,058.16	0.00
16	301389	隆扬电子	1,269.00	24,212.52	0.00
17	301486	致尚科技	482.00	22,774.50	0.00
18	301511	德福科技	982.00	22,261.94	0.00
19	688652	京仪装备	416.00	21,736.00	0.00
20	301525	儒竞科技	266.00	21,668.36	0.00
21	301498	乖宝宠物	554.00	21,500.74	0.00
22	301371	敷尔佳	564.00	21,195.12	0.00
23	301559	中集环科	1,150.00	20,976.00	0.00
24	301303	真兰仪表	1,058.00	20,832.02	0.00
25	301356	天振股份	1,105.00	20,099.95	0.00
26	301370	国科恒泰	1,240.00	19,852.40	0.00
27	688627	精智达	222.00	19,473.84	0.00
28	301377	鼎泰高科	770.00	18,210.50	0.00
29	301488	豪恩汽电	262.00	18,101.58	0.00
30	301468	博盈特焊	598.00	18,071.56	0.00
31	301280	珠城科技	418.00	17,171.44	0.00
32	301172	君逸数码	438.00	16,714.08	0.00
33	301362	民爆光电	420.00	16,178.40	0.00
34	301322	绿通科技	391.00	16,093.56	0.00
35	688612	威迈斯	422.00	16,023.34	0.00
36	301396	宏景科技	475.00	15,983.75	0.00
37	601096	宏盛华源	3,918.00	15,907.08	0.00
38	301368	丰立智能	337.00	15,886.18	0.00
39	301393	昊帆生物	260.00	15,436.20	0.00
40	301223	中荣股份	815.00	14,767.80	0.00
41	688610	埃科光电	275.00	14,025.00	0.00
42	601083	锦江航运	1,263.00	13,981.41	0.00
43	301510	固高科技	396.00	13,863.96	0.00
44	301277	新天地	658.00	13,692.98	0.00
45	301317	鑫磊股份	694.00	13,644.04	0.00
46	301305	朗坤环境	753.00	13,591.65	0.00
47	301230	泓博医药	376.00	13,460.80	0.00
48	301379	天山电子	449.00	13,285.91	0.00
49	301566	达利凯普	576.00	12,752.64	0.00
50	301335	天元宠物	588.00	12,583.20	0.00
51	301398	星源卓镁	255.00	12,568.95	0.00
52	301456	盘古智能	407.00	12,368.73	0.00

53	301115	建科股份	685.00	12,261.50	0.00
54	688602	康鹏科技	1,066.00	11,789.96	0.00
55	301365	矩阵股份	774.00	11,702.88	0.00
56	688719	爱科赛博	194.00	11,659.40	0.00
57	301550	斯菱股份	260.00	11,328.20	0.00
58	301292	海科新源	583.00	11,281.05	0.00
59	301508	中机认检	419.00	11,178.92	0.00
60	688603	天承科技	140.00	10,379.60	0.00
61	301429	森泰股份	499.00	10,199.56	0.00
62	301528	多浦乐	148.00	10,198.68	0.00
63	301329	信音电子	458.00	10,181.34	0.00
64	301372	科净源	231.00	10,069.29	0.00
65	301261	恒工精密	198.00	10,068.30	0.00
66	301202	朗威股份	306.00	9,730.80	0.00
67	301395	仁信新材	520.00	9,718.80	0.00
68	301413	安培龙	164.00	9,543.16	0.00
69	301500	飞南资源	455.00	9,504.95	0.00
70	301418	协昌科技	189.00	9,487.80	0.00
71	301516	中远通	604.00	9,368.04	0.00
72	301272	英华特	173.00	9,234.74	0.00
73	301326	捷邦科技	227.00	9,104.97	0.00
74	301469	恒达新材	275.00	9,099.75	0.00
75	301519	舜禹股份	442.00	8,932.82	0.00
76	301313	凡拓数创	247.00	8,906.82	0.00
77	301518	长华化学	385.00	8,858.85	0.00
78	301568	思泰克	246.00	8,752.68	0.00
79	301520	万邦医药	160.00	8,438.40	0.00
80	688638	誉辰智能	141.00	8,414.88	0.00
81	301265	华新环保	819.00	8,394.75	0.00
82	301459	丰茂股份	208.00	8,286.72	0.00
83	688720	艾森股份	165.00	8,223.60	0.00
84	301489	思泉新材	128.00	8,206.08	0.00
85	688651	盛邦安全	178.00	8,196.90	0.00
86	301517	陕西华达	185.00	8,082.65	0.00
87	301578	辰奕智能	118.00	8,061.76	0.00
88	301548	崇德科技	136.00	8,022.64	0.00
89	603065	宿迁联盛	581.00	8,006.18	0.00
90	301206	三元生物	275.00	7,942.00	0.00
91	688657	浩辰软件	101.00	7,901.23	0.00
92	688671	碧兴物联	226.00	7,751.80	0.00
93	688693	锆威特	178.00	7,726.98	0.00
94	603275	众辰科技	193.00	7,662.10	0.00
95	301273	瑞晨环保	277.00	7,642.43	0.00
96	301533	威马农机	225.00	7,461.00	0.00

97	603062	麦加芯彩	126.00	7,284.06	0.00
98	301555	惠柏新材	224.00	7,266.56	0.00
99	301388	欣灵电气	292.00	7,121.88	0.00
100	301505	苏州规划	194.00	6,947.14	0.00
101	301529	福赛科技	182.00	6,894.16	0.00
102	301319	唯特偶	115.00	6,717.15	0.00
103	301515	港通医疗	230.00	6,502.10	0.00
104	688648	中邮科技	303.00	6,493.29	0.00
105	001378	德冠新材	205.00	6,410.35	0.00
106	603004	鼎龙科技	195.00	6,082.05	0.00
107	603119	浙江荣泰	226.00	5,394.62	0.00
108	001306	夏厦精密	64.00	4,823.04	0.00
109	301228	实朴检测	273.00	4,526.34	0.00
110	603075	热威股份	182.00	4,242.42	0.00
111	001358	兴欣新材	87.00	3,841.92	0.00
112	001239	永达股份	189.00	3,764.88	0.00
113	603231	索宝蛋白	161.00	3,466.33	0.00
114	603273	天元智能	178.00	3,376.66	0.00
115	603276	恒兴新材	134.00	3,333.92	0.00
116	603373	安邦护卫	88.00	3,058.00	0.00
117	688122	西部超导	18.00	958.14	0.00
118	002497	雅化集团	37.00	484.33	0.00
119	601158	重庆水务	80.00	453.60	0.00
120	002407	多氟多	17.00	258.74	0.00
121	688525	佰维存储	3.00	187.98	0.00
122	000683	远兴能源	3.00	17.61	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	002276	万马股份	17,492,419.00	1.80
2	688085	三友医疗	16,095,466.48	1.66
3	601222	林洋能源	15,485,827.00	1.60
4	603187	海容冷链	15,342,039.54	1.58
5	688100	威胜信息	15,241,598.39	1.57
6	002130	沃尔核材	15,221,624.00	1.57
7	601702	华峰铝业	14,482,344.00	1.49
8	002737	葵花药业	13,504,686.00	1.39
9	002549	凯美特气	12,757,340.00	1.32
10	002006	精工科技	12,722,930.00	1.31

11	603690	至纯科技	12,700,387.00	1.31
12	300593	新雷能	12,475,135.00	1.29
13	603368	柳药集团	12,430,543.79	1.28
14	688066	航天宏图	12,091,431.26	1.25
15	002060	粤水电	11,863,043.00	1.22
16	300346	南大光电	11,589,670.00	1.19
17	688198	佰仁医疗	11,408,465.87	1.18
18	300443	金雷股份	11,214,734.00	1.16
19	600428	中远海特	10,917,207.00	1.13
20	601567	三星医疗	10,900,853.00	1.12

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	002472	双环传动	19,700,585.00	2.03
2	300726	宏达电子	19,577,483.02	2.02
3	300502	新易盛	19,338,773.02	1.99
4	688066	航天宏图	19,038,530.97	1.96
5	688085	三友医疗	16,891,755.70	1.74
6	002292	奥飞娱乐	16,883,502.00	1.74
7	688128	中国电研	16,751,588.88	1.73
8	300593	新雷能	16,540,499.81	1.71
9	600869	远东股份	16,364,178.00	1.69
10	300229	拓尔思	16,264,133.54	1.68
11	002135	东南网架	16,063,348.76	1.66
12	603187	海容冷链	15,913,500.04	1.64
13	600057	厦门象屿	15,816,810.00	1.63
14	688198	佰仁医疗	15,433,528.81	1.59
15	002675	东诚药业	14,729,614.07	1.52
16	300457	赢合科技	14,432,292.00	1.49
17	601222	林洋能源	14,156,652.00	1.46
18	002463	沪电股份	14,033,109.82	1.45
19	002276	万马股份	14,010,202.72	1.44
20	601567	三星医疗	13,185,598.00	1.36

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	2,211,320,081.56
卖出股票收入（成交）总额	2,241,840,271.52

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）	1,004,066.02	0.11
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,004,066.02	0.11

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	113069	博 23 转债	10,040	1,004,066.02	0.11
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

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

本基金为指数增强型基金，主要投资标的为指数成份股和备选成份股。基金留存的现金头寸根据基金合同规定，投资于标的指数为基础资产的股指期货，旨在配合基金日常投资管理需要，更有

效地进行流动性管理，以更好地跟踪标的指数，实现投资目标。

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	2,806,368.00
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	94,153.53
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,900,521.53

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	688717	艾罗能源	898,742.02	0.10	新发流通受限

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
华夏中证 1000 指数增强 A	3,000	96,294.21	173,236,248.27	59.97%	115,646,391.60	40.03%
华夏中证 1000 指数增强 C	10,418	77,169.88	323,562,993.73	40.25%	480,392,788.34	59.75%
合计	13,418	81,445.70	496,799,242.00	45.46%	596,039,179.94	54.54%

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	华夏中证 1000 指数增强 A	571,014.40	0.20%
	华夏中证 1000 指数增强 C	1,668.66	0.00%
	合计	572,683.06	0.05%

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	华夏中证 1000 指数增强 A	0
	华夏中证 1000 指数增强 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	华夏中证 1000 指数增强 A	0
	华夏中证 1000 指数增强 C	0
	合计	0

9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况

基金经理姓名	产品类型	持有本人管理的产品份额总量的数量区间 (万份)
袁英杰	公募基金	>100
	私募资产管理计划	0

	合计	>100
--	----	------

§10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华夏中证 1000 指数增强 A	华夏中证 1000 指数增强 C
基金合同生效日（2021 年 12 月 7 日）基金份额总额	134,043,843.62	908,656,604.91
本报告期期初基金份额总额	117,133,015.72	984,837,135.03
本报告期基金总申购份额	362,446,853.35	512,980,703.97
减：本报告期基金总赎回份额	190,697,229.20	693,862,056.93
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	288,882,639.87	803,955,782.07

§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，基金托管人无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期末发生影响基金管理人经营或基金运营业务的诉讼。

本报告期内，无涉及基金托管业务的诉讼。

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 50,000 元人民币。截至本报告期末，该事务所已向本基金提供 2 年的审计服务。

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，基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

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	
海通证券	2	4,426,065,908.24	100.00%	2,425,034.84	100.00%	-

注：①为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择券商的标准，即：

i 经营行为规范。

ii 公司财务状况良好。

iii 有良好的内控制度，在业内有良好的声誉。

iv 有较强的全方位金融服务能力和水平：能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

v 建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯和服务。

②券商专用交易单元选择程序：

i 本基金管理人根据上述标准进行评估并确定选用的券商。

ii 本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议/证券经纪服务协议。

③除本表列示外，本基金本报告期未选择其他交易单元作为本基金交易单元。

④本报告期内，本基金租用的券商交易单元未发生变更。

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
海通证券	2,673,179.08	100.00%	-	-	-	-	-	-

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	华夏基金管理有限公司公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-01-06
2	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-01-19
3	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-02-24
4	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-03-03
5	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-03-11
6	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-03-23
7	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-03-30
8	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-04-01
9	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-04-13
10	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-04-15
11	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-04-27
12	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-05-13
13	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-05-27
14	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-05-31
15	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-06-17
16	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-06-21
17	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-07-01
18	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-07-14
19	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-07-19
20	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
21	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-07-26
22	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

23	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-08-03
24	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
25	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
26	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-09-28
27	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-10-11
28	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	2023-01-01 至 2023-02-21, 2023-02-28 至 2023-12-31	385,721,051.64	311,049,597.83	385,721,051.64	311,049,597.83	28.46%

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。

§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、《华夏中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同》；
- 3、《华夏中证 1000 指数增强型证券投资基金托管协议》；
- 4、法律意见书；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照。

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