
华夏国证 2000 指数增强型发起式证券投资基金

2024 年年度报告

2024 年 12 月 31 日

基金管理人：华夏基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

送出日期：二〇二五年三月三十一日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 3 月 27 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，安永华明会计师事务所（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 2024 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	13
§6 审计报告	14
§7 年度财务报表	16
7.1 资产负债表	16
7.2 利润表	17
7.3 净资产变动表	18
7.4 报表附注	19
§8 投资组合报告	43
8.1 期末基金资产组合情况	43
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	44
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	45
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	56
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	58
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	58
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	58
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	58
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	58
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	58
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	58
8.12 投资组合报告附注	58
§9 基金份额持有人信息	59
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	59
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	60
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	60
§10 开放式基金份额变动	60
§11 重大事件揭示	61
§12 影响投资者决策的其他重要信息	64
§13 备查文件目录	64

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华夏国证 2000 指数增强型发起式证券投资基金	
基金简称	华夏国证 2000 指数增强发起式	
基金主代码	018292	
交易代码	018292	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2023 年 5 月 23 日	
基金管理人	华夏基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	16,419,910.84 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华夏国证 2000 指数增强发起式 A	华夏国证 2000 指数增强发起式 C
下属分级基金的交易代码	018292	018293
报告期末下属分级基金的份额总额	13,715,740.64 份	2,704,170.20 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	方圆
	联系电话	400-818-6666	95559
	电子邮箱	service@ChinaAMC.com	fangy_20@bankcomm.com
客户服务电话		400-818-6666	95559
传真		010-63136700	021-62701216
注册地址		北京市顺义区安庆大街甲3号院	中国（上海）自由贸易试验区银城中路188号
办公地址		北京市朝阳区北辰西路6号院	中国（上海）长宁区仙霞路18号

	北辰中心C座5层	
邮政编码	100101	200336
法定代表人	张佑君	任德奇

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.ChinaAMC.com
基金年度报告备置地点	基金管理人和/或基金托管人的住所/办公地址

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层
注册登记机构	华夏基金管理有限公司	北京市朝阳区北辰西路 6 号院北辰中心 C 座 5 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	2024 年		2023 年 5 月 23 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日	
	华夏国证 2000 指数增强发起式 A	华夏国证 2000 指数增强发起式 C	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	-687,769.85	-681,709.24	-129,740.39	-43,693.67
本期利润	-702,247.37	-863,561.30	-143,872.53	-11,379.66
加权平均基金份额本期利润	-0.0522	-0.1475	-0.0114	-0.0016
本期加权平均净值利润率	-6.10%	-17.38%	-1.15%	-0.16%
本期基金份额净值增长率	-3.04%	-3.42%	-1.20%	-1.44%
3.1.2 期末数据 和指标	2024 年末		2023 年末	
	华夏国证 2000 指数增强发起式 A	华夏国证 2000 指数增强发起式 C	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	-721,472.37	-158,527.04	-161,485.26	-113,982.78

期末可供分配基金份额利润	-0.0526	-0.0586	-0.0120	-0.0144
期末基金资产净值	13,139,173.74	2,574,085.14	13,322,332.97	7,806,095.83
期末基金份额净值	0.9580	0.9519	0.9880	0.9856
3.1.3 累计期末指标	2024 年末		2023 年末	
	华夏国证 2000 指数增强发起式 A	华夏国证 2000 指数增强发起式 C	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	-4.20%	-4.81%	-1.20%	-1.44%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华夏国证 2000 指数增强发起式 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	3.41%	2.39%	5.99%	2.40%	-2.58%	-0.01%
过去六个月	21.81%	2.19%	22.48%	2.21%	-0.67%	-0.02%
过去一年	-3.04%	2.14%	-0.39%	2.12%	-2.65%	0.02%
自基金合同生效起至今	-4.20%	1.77%	-6.70%	1.77%	2.50%	0.00%

华夏国证 2000 指数增强发起式 C

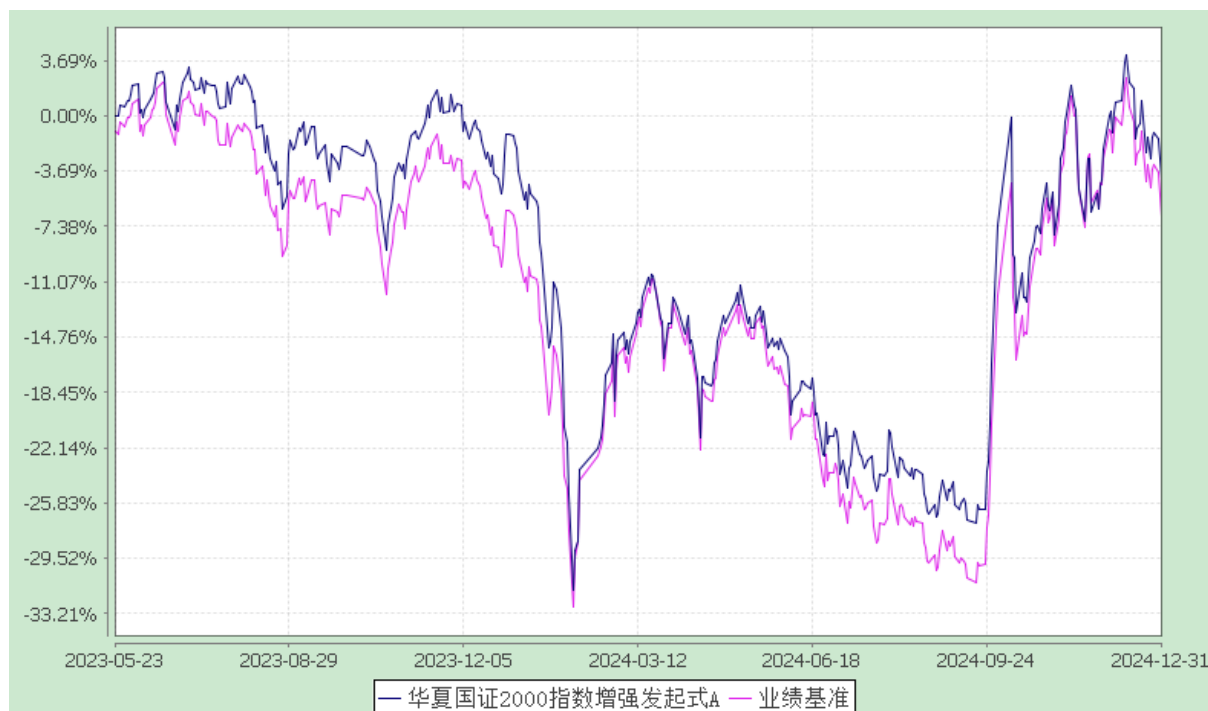
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	3.31%	2.39%	5.99%	2.40%	-2.68%	-0.01%
过去六个月	21.57%	2.19%	22.48%	2.21%	-0.91%	-0.02%
过去一年	-3.42%	2.14%	-0.39%	2.12%	-3.03%	0.02%
自基金合同生效起至今	-4.81%	1.77%	-6.70%	1.77%	1.89%	0.00%

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 12 月 31 日)

华夏国证 2000 指数增强发起式 A



华夏国证 2000 指数增强发起式 C

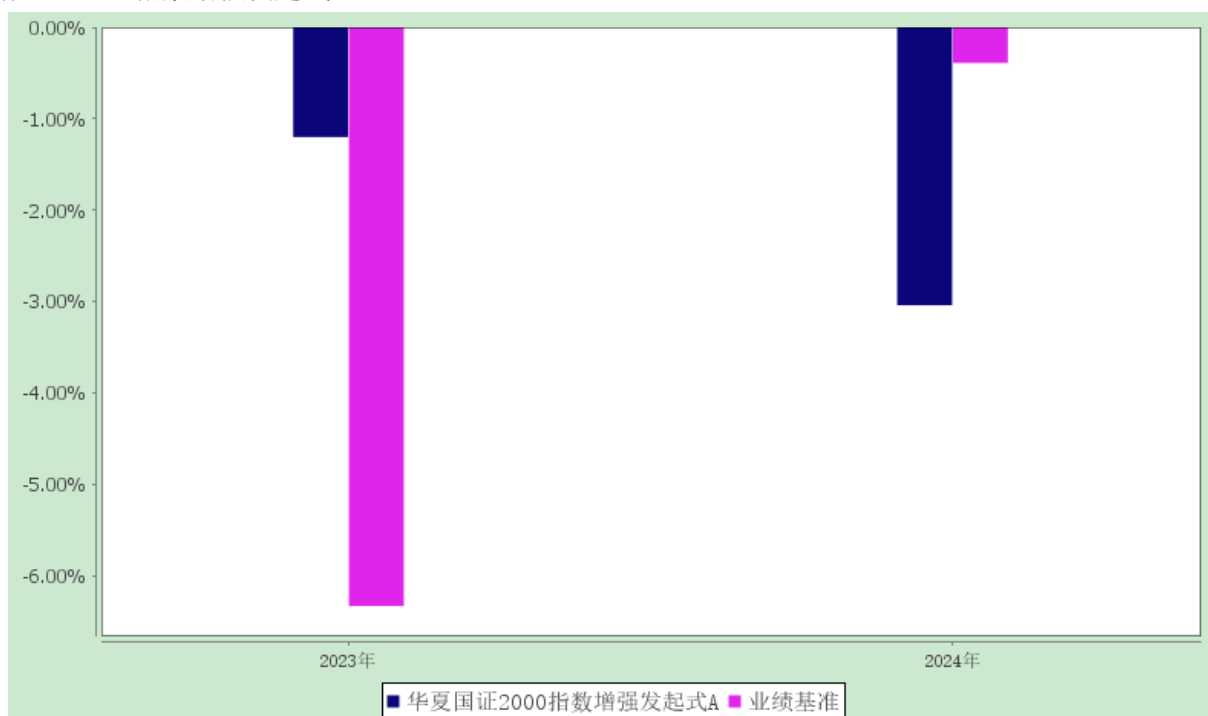


3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

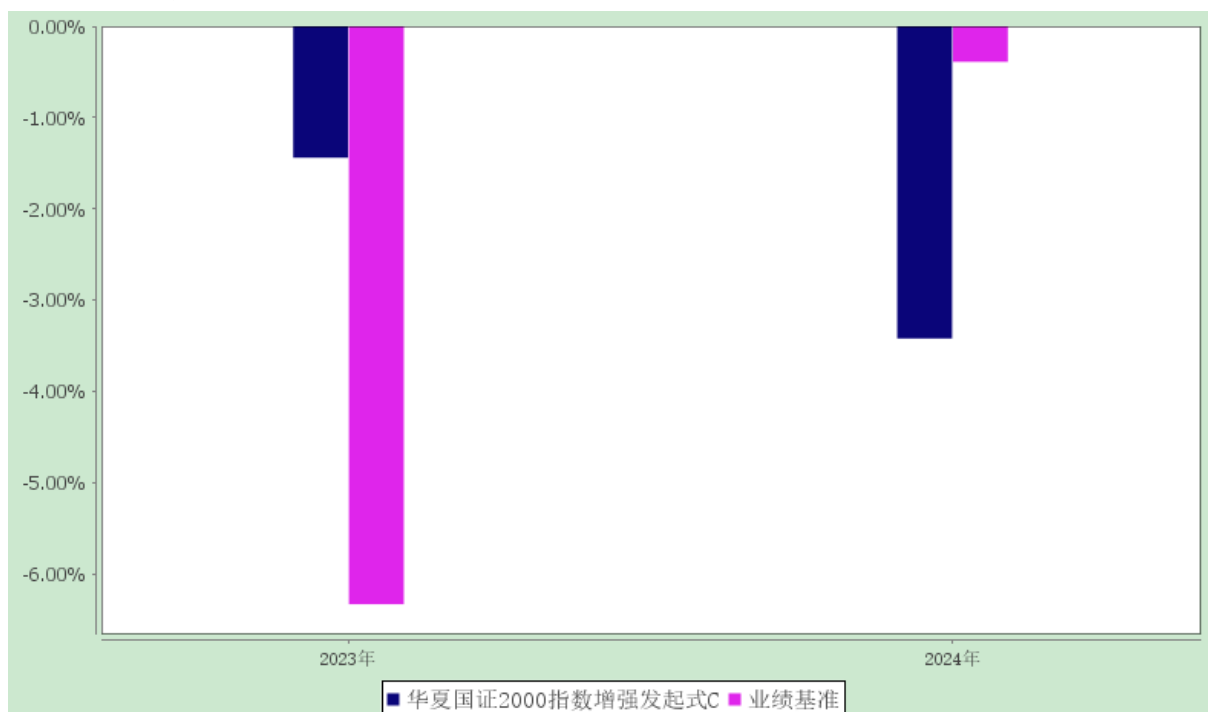
华夏国证 2000 指数增强型发起式证券投资基金

自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图

华夏国证 2000 指数增强发起式 A



华夏国证 2000 指数增强发起式 C



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

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自基金合同生效以来无利润分配事项。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

华夏基金管理有限公司成立于 1998 年 4 月 9 日，是经中国证监会批准成立的首批全国性基金管理公司之一。公司总部设在北京，在北京、上海、深圳、成都、南京、杭州、广州、青岛、武汉及沈阳设有分公司，在香港、深圳、上海、北京设有子公司。公司是首批全国社保基金管理人、首批企业年金基金管理人、境内首批 QDII 基金管理人、境内首只 ETF 基金管理人、境内首只沪港通 ETF 基金管理人、首批内地与香港基金互认基金管理人、首批基本养老保险基金投资管理人资格、首家加入联合国责任投资原则组织的公募基金公司、首批公募 FOF 基金管理人、首批公募养老目标基金管理人、首批个人养老金基金管理人、境内首批中日互通 ETF 基金管理人、首批商品期货 ETF 基金管理人、首批公募 MOM 基金管理人、首批纳入互联互通 ETF 基金管理人、首批北交所主题基金管理人以及特定客户资产管理人、保险资金投资管理人、公募 REITs 管理人，境内首家承诺“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 2024 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：在消费行业偏股型基金(A 类)中华夏消费臻选混合发起式(A 类)排名第 1/81；在新能源主题行业偏股型基金(A 类)中华夏清洁能源龙头混合发起式(A 类)排名第 1/27；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 1/11；在标准股票型基金(A 类)中华夏优势精选股票排名第 2/336、华夏潜龙精选股票排名第 15/336、华夏创新前沿股票排名第 64/336；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 3/16；在港股通标准股票型基金(A 类)中华夏港股通精选股票（LOF）(A 类)排名第 3/14；在 QDII 混合基金(A 类)中华夏全球科技先锋混合（QDII）排名第 5/51；在偏股型基金(股票上限 80%)(A 类)中华夏

经典混合排名第 5/148、华夏常阳三年定开混合排名第 19/148、华夏策略混合排名第 29/148；在 TMT 与信息技术行业偏股型基金(A 类)中华夏半导体龙头混合发起式(A 类)排名第 11/47；在医药医疗健康行业偏股型基金(A 类)中华夏乐享健康混合(A 类)排名第 13/78；在 QDII 股票型基金(A 类)中华夏全球股票 (QDII) 排名第 14/72；在偏股型基金(股票上下限 60%-95%)(A 类)中华夏见龙精选混合排名第 13/1719、华夏阿尔法精选混合(A 类)排名第 40/1719、华夏融盛可持续一年持有混合(A 类)排名第 101/1719、华夏远见成长一年持有混合(A 类)排名第 169/1719、华夏 ESG 可持续投资一年持有混合(A 类)排名第 177/1719、华夏先进制造龙头混合(A 类)排名第 184/1719、华夏行业景气混合排名第 214/1719、华夏景气成长一年持有混合发起式(A 类)排名第 257/1719、华夏科技前沿 6 个月定开混合(A 类)排名第 278/1719；在灵活配置型基金(基准股票比例 30%-60%)(A 类)中华夏磐晟混合 (LOF) 排名第 28/425、华夏高端制造混合(A 类)排名第 64/425、华夏新机遇混合(A 类)排名第 76/425；在偏股型基金(股票上限 95%)(A 类) 华夏新兴经济一年持有混合(A 类)排名第 34/221、华夏大盘精选混合(A 类)排名第 49/221。

固收与固收+产品：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 1/18；在普通债券型基金(可投转债)(A 类)中华夏双债债券(A 类)排名第 2/246；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 9/647、华夏鼎誉三个月定开债券(A 类)排名第 51/647；在定开普通债券型基金(二级)(A 类)中华夏卓信一年定开债券发起式排名第 11/24；在可转换债券型基金(A 类)中华夏可转债增强债券(A 类)排名第 12/38；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 14/333；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 15/165；在定开普通债券型基金(可投转债)(A 类)中华夏鼎禄三个月定开债券(A 类)排名第 22/157、华夏鼎福三个月定开债券(A 类)排名第 31/157；在长期纯债债券型基金(A 类)中华夏鼎茂债券(A 类)排名第 20/851、华夏鼎通债券(A 类)排名第 37/851；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 79/443。

指数产品：在标准策略指数股票型基金(A 类)中华夏上证 50AH 优选指数 (LOF) (A 类)排名第 6/25；在策略指数股票 ETF 基金中华夏中证智选 300 价值稳健策略 ETF 排名第 8/48；在规模指数股票 ETF 基金中华夏 MSCI 中国 A50 互联互通 ETF 排名第 14/161、华夏中证沪港深 500ETF 排名第 20/161、华夏上证 50ETF 排名第 29/161；在行业指数股票 ETF 基金中华夏中证银行 ETF 排名第 5/72、华夏中证全指证券公司 ETF 排名第 15/72；在增强规模指数股票型基金(A 类)中华夏沪深 300 指数增强(A 类)排名第 5/191、华夏上证科创板 50 成份指数增强发起式(A 类)排名第 17/191；在主题指数股票 ETF 基金中华夏金融 ETF 发起式排名第 2/357、华夏国证半导体芯片 ETF 排名第 19/357、华夏中证金融科技主题 ETF 排名第 21/357、华夏中证 5G 通信主题 ETF 排名第 60/357、华夏中证人工智能

主题 ETF 排名第 72/357、华夏中证云计算与大数据主题 ETF 排名第 83/357。

在客户服务方面，2024 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，升级搜索及查询功能，给客户更方便、直观的使用感受；（2）华夏基金管家客户端从客户需求出发持续优化操作页面，进一步提升操作体验；（3）与常熟农商银行、长春农商银行、贵文基金等代销机构合作，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”、“换个角度，世界可能不一样”、“聊聊新赛道”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。

4.1.3 基金经理薪酬机制

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合,制定并严格遵守相应的制度和流程,通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内,本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《华夏基金管理有限公司公平交易制度》的规定。

4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

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

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

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内,本基金管理人旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中,同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的交易共有 197 次,其中 1 次为不同基金经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易,有关基金经理已根据公司管理要求提供决策依据;其余均为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

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

2024 年，A 股市场经历了较大波动，结构性行情明显。全年来看，行业间分化较大：银行、非银金融、家电等行业表现较好，而综合、医药、农林牧渔等行业表现较差。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 12 月 31 日，华夏国证 2000 指数增强发起式 A 基金份额净值为 0.9580 元，本报告期份额净值增长率为-3.04%；华夏国证 2000 指数增强发起式 C 基金份额净值为 0.9519 元，本报告期份额净值增长率为-3.42%，同期业绩比较基准增长率为-0.39%。本基金本报告期 A 类份额跟踪偏离度为-2.65%，C 类份额跟踪偏离度为-3.03%。

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 2025 年，在积极财政政策和适度宽松货币政策的支持下，以提振内需为核心，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，在廉洁从业风险防控、信息披露、洗钱风险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和公募基金信息披露责任意识。持续优化合规管理的机制化和系统化，完善合规管理综合服务平台，提高合规管理效能。持续做好信息披露业务，通过流程优化、系统优化及强化培训持续保障信息披露的完整性、准确性、及时性。持续规范基金销售业务，通过严格审查宣传推介材料，认真开展投资者适当性管理工作等，确保基金销售业务依法合规。公司高度重视洗钱风险管理，深入实践风险为本方法，认真贯彻落实各项反洗钱监管要求，持续加强“风险评估+合规检查”双支柱管理框架，深入推进洗钱风险管理数智化转型，持续提升洗钱风险管理水平。

在风险控制方面，公司秉承数字化管理理念，持续完善内部风险管理系统建设，稳步夯实投资风险管理基础。紧密跟踪各项法律法规要求、加强风险研究，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。会计师事务所对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

本基金本报告期末未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

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

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由华夏基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关华夏国证 2000 指数增强型发起式证券投资基金的年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§6 审计报告

安永华明（2025）审字第 70035283_A291 号

华夏国证 2000 指数增强型发起式证券投资基金全体基金份额持有人：

6.1 审计意见

我们审计了华夏国证 2000 指数增强型发起式证券投资基金的财务报表，包括 2024 年 12 月 31 日的资产负债表，2024 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。

我们认为，后附的华夏国证 2000 指数增强型发起式证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了华夏国证 2000 指数增强型发起式证券投资基金 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 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。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于华夏国证 2000 指数增强型发起式证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。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。

6.3 其他信息

华夏国证 2000 指数增强型发起式证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。

我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。

结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。

基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。

6.4 管理层和治理层对财务报表的责任

管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，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，管理层负责评估华夏国证 2000 指数增强型发起式证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。

治理层负责监督华夏国证 2000 指数增强型发起式证券投资基金的财务报告过程。

6.5 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：

（1）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。

（2）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。

（3）评价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。

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

（5）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。

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

中国注册会计师

蒋燕华 张晓阳

北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层

2025 年 3 月 27 日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：华夏国证 2000 指数增强型发起式证券投资基金

报告截止日：2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	7.4.7.1	1,278,131.56	1,996,835.41
结算备付金		54,799.81	246,458.25
存出保证金		2,764.63	8,216.38
交易性金融资产	7.4.7.2	14,560,836.00	19,413,839.84
其中：股票投资		14,560,836.00	19,396,775.90
基金投资		-	-
债券投资		-	17,063.94
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		88,364.25	551,434.57
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		15,984,896.25	22,216,784.45
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-

应付清算款		29.80	245,570.60
应付赎回款		233,530.00	749,193.74
应付管理人报酬		11,154.72	14,846.81
应付托管费		2,091.50	2,783.77
应付销售服务费		1,153.10	2,751.74
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	23,678.25	73,208.99
负债合计		271,637.37	1,088,355.65
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	16,419,910.84	21,403,896.84
未分配利润	7.4.7.8	-706,651.96	-275,468.04
净资产合计		15,713,258.88	21,128,428.80
负债和净资产总计		15,984,896.25	22,216,784.45

注：①报告截止日 2024 年 12 月 31 日，华夏国证 2000 指数增强发起式 A 基金份额净值 0.9580 元，华夏国证 2000 指数增强发起式 C 基金份额净值 0.9519 元；华夏国证 2000 指数增强发起式基金份额总额 16,419,910.84 份（其中 A 类 13,715,740.64 份，C 类 2,704,170.20 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 12 月 31 日。

7.2 利润表

会计主体：华夏国证 2000 指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 5 月 23 日 (基金合同生效日) 至 2023 年 12 月 31 日
一、营业总收入		-1,379,519.52	6,067.29
1.利息收入		4,392.74	3,637.13
其中：存款利息收入	7.4.7.9	4,392.74	3,637.13
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-1,208,810.09	-17,311.06
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-1,400,908.85	-160,630.13
基金投资收益	7.4.7.11	-	-
债券投资收益	7.4.7.12	3,748.93	9,593.45

资产支持证券投资收益	7.4.7.13	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	188,349.83	133,725.62
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-196,329.58	18,181.87
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	21,227.41	1,559.35
减：二、营业总支出		186,289.15	161,319.48
1.管理人报酬		131,831.74	95,137.75
2.托管费		24,718.32	17,838.27
3.销售服务费		19,878.87	17,123.60
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.信用减值损失	7.4.7.20	-	-
7.税金及附加		-	-
8.其他费用	7.4.7.21	9,860.22	31,219.86
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-1,565,808.67	-155,252.19
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-1,565,808.67	-155,252.19
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-1,565,808.67	-155,252.19

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 12 月 31 日。

7.3 净资产变动表

会计主体：华夏国证 2000 指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	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、本期增减变动额 （减少以“-”号填列）	-4,983,986.00	-431,183.92	-5,415,169.92
（一）、综合收益总额	-	-1,565,808.67	-1,565,808.67
（二）、本期基金份额	-4,983,986.00	1,134,624.75	-3,849,361.25

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	49,538,837.16	-6,506,936.59	43,031,900.57
2.基金赎回款	-54,522,823.16	7,641,561.34	-46,881,261.82
（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	16,419,910.84	-706,651.96	15,713,258.88
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 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-
二、本期期初净资产	19,019,828.28	-	19,019,828.28
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	2,384,068.56	-275,468.04	2,108,600.52
（一）、综合收益总额	-	-155,252.19	-155,252.19
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	2,384,068.56	-120,215.85	2,263,852.71
其中：1.基金申购款	25,972,178.60	-235,576.85	25,736,601.75
2.基金赎回款	-23,588,110.04	115,361.00	-23,472,749.04
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	21,403,896.84	-275,468.04	21,128,428.80

注：本基金合同于 2023 年 5 月 23 日生效，上年度可比期间自 2023 年 5 月 23 日至 2023 年 12 月 31 日。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：张佑君，主管会计工作负责人：朱威，会计机构负责人：朱威

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

华夏国证 2000 指数增强型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）已获中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2023]693 号文《关于准予华夏国证 2000 指数增强型发起

式证券投资基金注册的批复》，由华夏基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《华夏国证 2000 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》及其他有关法律法规负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限为不定期。本基金自 2023 年 4 月 24 日至 2023 年 5 月 19 日共募集 19,009,464.80 元(不含认购资金利息)，业经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)安永华明(2023)验字第 60739337_A24 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华夏国证 2000 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》于 2023 年 5 月 23 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 19,019,828.28 份基金份额，其中认购资金利息折合 10,363.48 份基金份额。本基金的基金管理人为华夏基金管理有限公司，基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和本基金基金合同的有关规定，本基金的标的指数为国证 2000 指数。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（含科创板、创业板、存托凭证及其他中国证监会注册或核准上市的股票）、债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、地方政府债券、可转换债券、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、衍生品（包括股指期货、股票期权、国债期货）、资产支持证券、货币市场工具（含同业存单、债券回购等）、银行存款以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金可根据法律法规的规定参与融资、转融通证券出借业务。

本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产的 80%，投资于标的指数成份股及其备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布和修订的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则(以下合称“企业会计准则”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会发布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》和中国证监会、中国基金业协会允许的如财务报表附注 7.4.4 所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金本报告期末的财务状况以及

本报告期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

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业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

（1）债务工具

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

以摊余成本计量：

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

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

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

（2）权益工具

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

2、金融负债的分类

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

3、衍生金融工具

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

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

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

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

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

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

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

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

算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况。当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产。当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额。

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

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

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

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

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。对于曾经实施份额拆分或折算的基金，由于基金份额拆分或折算引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日或基金份额折算日根据拆分前或折算前的基金份额数及确定的拆分或折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。对于已开放转换业务的基金，上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

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

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

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

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

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

由于本基金各基金份额类别在费用收取上不同，其对应的可分配收益可能有所不同。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

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

1、对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

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

3、对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566 号《关于发布<关于固定收益品种的估值处理标准>的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场交易的固定收益品种，按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 税项

根据财税[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]103 号《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81 号《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]125 号《财政部、国家税务总局、证监会关于内地与香港基金互认有关税收政策的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《财政部、国家税务总局关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《财政部、国家税务总局关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2023]39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 以发行基金方式募集资金不属于增值税征收范围，不征收增值税。

(2) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

(3) 基金买卖股票、债券的差价收入免征增值税，暂不征收企业所得税。

(4) 存款利息收入不征收增值税。

(5) 国债、地方政府债利息收入，金融同业往来利息收入免征增值税。

(6) 对基金取得的债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(7) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(8) 对基金在境内取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利收入时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不征收企业所得税。基金在境内从上市公司分配取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，全额计入应纳税所得额，持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，减按 50% 计入应纳税所得额，持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中国结算”）提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。对香港市场投资者取得的股息、红利收入按照 10% 的税率代扣所得税。

(9) 基金在境内卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(10) 基金在境外证券交易所进行交易或取得的源自境外证券市场的收益，其涉及的税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行。

(11) 本基金分别按实际缴纳的增值税额的 7%、3%、2% 缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
活期存款	1,278,131.56	1,996,835.41
等于：本金	1,278,093.56	1,996,733.07
加：应计利息	38.00	102.34
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
合计	1,278,131.56	1,996,835.41

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2024 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		14,738,983.71	-	14,560,836.00	-178,147.71
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		14,738,983.71	-	14,560,836.00	-178,147.71
项目		上年度末 2023 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		19,379,056.02	-	19,396,775.90	17,719.88
贵金属投资- 金交所黄金 合约		-	-	-	-
债券	交易所市 场	16,600.00	1.95	17,063.94	461.99
	银行间市 场	-	-	-	-
	合计	16,600.00	1.95	17,063.94	461.99
资产支持证 券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		19,395,656.02	1.95	19,413,839.84	18,181.87

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。

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额
无。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额
无。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券
无。

7.4.7.5 其他资产
无。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	15,778.25	43,208.99
其中：交易所市场	15,778.25	43,208.99
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	7,900.00	30,000.00
合计	23,678.25	73,208.99

7.4.7.7 实收基金

华夏国证 2000 指数增强发起式 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	13,483,818.23	13,483,818.23
本期申购	9,178,651.09	9,178,651.09
本期赎回（以“-”号填列）	-8,946,728.68	-8,946,728.68
本期末	13,715,740.64	13,715,740.64

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12月31日

	基金份额（份）	账面金额
上年度末	7,920,078.61	7,920,078.61
本期申购	40,360,186.07	40,360,186.07
本期赎回（以“-”号填列）	-45,576,094.48	-45,576,094.48
本期末	2,704,170.20	2,704,170.20

7.4.7.8 未分配利润

华夏国证 2000 指数增强发起式 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
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	-687,769.85	-14,477.52	-702,247.37
本期基金份额交易产生的变动数	114,318.01	172,847.72	287,165.73
其中：基金申购款	-1,275,180.40	452,382.10	-822,798.30
基金赎回款	1,389,498.41	-279,534.38	1,109,964.03
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-721,472.37	144,905.47	-576,566.90

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	-681,709.24	-181,852.06	-863,561.30
本期基金份额交易产生的变动数	629,070.57	218,388.45	847,459.02
其中：基金申购款	-6,278,305.25	594,166.96	-5,684,138.29
基金赎回款	6,907,375.82	-375,778.51	6,531,597.31
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-158,527.04	28,441.98	-130,085.06

7.4.7.9 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 5 月 23 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	2,509.69	2,131.07
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	1,754.60	1,440.93
其他	128.45	65.13

合计	4,392.74	3,637.13
----	----------	----------

7.4.7.10 股票投资收益

7.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 5 月 23 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-1,400,908.85	-160,630.13
股票投资收益——赎回差价收入	-	-
股票投资收益——申购差价收入	-	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-	-
合计	-1,400,908.85	-160,630.13

7.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 5 月 23 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	150,879,653.87	154,814,099.65
减：卖出股票成本总额	152,081,508.82	154,699,206.66
减：交易费用	199,053.90	275,523.12
买卖股票差价收入	-1,400,908.85	-160,630.13

7.4.7.11 基金投资收益

无。

7.4.7.12 债券投资收益

7.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 5 月 23 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
债券投资收益——利息收入	4.35	7.96
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	3,744.58	9,585.49
债券投资收益——赎回差价收入	-	-

债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	3,748.93	9,593.45

7.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年5月23日（基金合同生效日）至2023年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	32,052.18	44,193.28
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	28,300.00	34,600.00
减：应计利息总额	6.30	6.01
减：交易费用	1.30	1.78
买卖债券差价收入	3,744.58	9,585.49

7.4.7.13 资产支持证券投资收益

无。

7.4.7.14 贵金属投资收益

无。

7.4.7.15 衍生工具收益

无。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年5月23日（基金合同生效日）至2023年12月31日
股票投资产生的股利收益	188,349.83	133,725.62
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	188,349.83	133,725.62

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年5月23日（基金合同生效日）至2023年12月31日
1.交易性金融资产	-196,329.58	18,181.87
——股票投资	-195,867.59	17,719.88
——债券投资	-461.99	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	-196,329.58	18,181.87

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年5月23日（基金合同生效日）至2023年12月31日
基金赎回费收入	21,227.41	1,559.35
合计	21,227.41	1,559.35

7.4.7.19 持有基金产生的费用

无。

7.4.7.20 信用减值损失

无。

7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年5月23日（基金合同生效日）至2023年12月31日
审计费用	7,900.00	30,000.00
信息披露费	-	-
证券出借违约金	-	-
银行费用	1,951.24	819.86
存托服务费	8.98	-
其他	-	400.00
合计	9,860.22	31,219.86

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
华夏基金管理有限公司	基金管理人
交通银行股份有限公司（“交通银行”）	基金托管人
中信证券股份有限公司（“中信证券”）	基金管理人的股东
天津海鹏科技咨询有限公司	基金管理人的股东
MACKENZIE FINANCIAL CORPORATION	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
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
华夏资本管理有限公司（“华夏资本”）	基金管理人的子公司
中信证券(山东)有限责任公司（“中信证券（山东）”）	基金管理人第一大股东的子公司
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：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年12月31日		上年度可比期间 2023年5月23日（基金合同生效日）至2023年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
中信证券	102,775,294.72	34.45%	187,977,863.28	57.16%

7.4.10.1.2 权证交易

无。

7.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年12月31日		上年度可比期间 2023年5月23日（基金合同生效日）至2023年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例

中信证券	3,996.21	12.47%	40,475.68	91.59%
------	----------	--------	-----------	--------

7.4.10.1.4 债券回购交易

无。

7.4.10.1.5 基金交易

无。

7.4.10.1.6 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12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
中信证券	38,275.34	36.64%	-	-
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12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
中信证券	82,976.31	54.36%	11,864.72	27.46%

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。根据证监会公告[2024]3号《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，自2024年7月1日起，针对被动股票型基金，不再通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用。针对其他类型基金，不再通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

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 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年5月23日（基金合同生效日）至2023年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	131,831.74	95,137.75
其中：应支付销售机构的客户维护费	22,497.86	19,456.34
应支付基金管理人的净管理费	109,333.88	75,681.41

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

②基金管理人报酬计算公式为：日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×年费率/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 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年5月23日（基金合同生效日）至2023年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	24,718.32	17,838.27

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

②基金托管费计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×年费率/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 2024年1月1日至2024年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华夏国证 2000 指数增强发起式 A	华夏国证 2000 指数增强发起式 C	合计
交通银行	-	4,123.83	4,123.83
中信证券	-	1,444.90	1,444.90
华夏基金管理有限公司	-	316.80	316.80
华夏财富	-	30.89	30.89
中信证券（华	-	4.69	4.69

南)			
中信 证券 (山 东)	-	-	-
合计	-	5,921.11	5,921.11
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12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华夏国证 2000 指数增 强发起式 A	华夏国证 2000 指数增 强发起式 C	合计
交通 银行	-	4,356.83	4,356.83
华夏 基金 管理 有限 公司	-	202.42	202.42
华夏 财富	-	113.43	113.43
中信 证券	-	45.13	45.13
中信 证券 (山 东)	-	0.90	0.90
合计	-	4,718.71	4,718.71

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

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

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日		上年度可比期间 2023年5月23日（基金合同生效日）至2023年12月31日	
	华夏国证2000指数 增强发起式A	华夏国证2000指数 增强发起式C	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	72.98%	-	74.24%	-

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 2024年1月1日至2024年12月31日		上年度可比期间 2023年5月23日（基金合同生效日）至2023年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行活期存款	1,278,131.56	2,509.69	1,996,835.41	2,131.07

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

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	601033	永兴股份	新股发行	500	8,100.00
中信证券	001391	国货航	新股发行	500	1,150.00
上年度可比期间 2023 年 5 月 23 日（基金合同生效日）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	-	-	-	-	-

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（2024 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

无。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002379	宏创控股	2024-12-23	重大事项	8.97	2025-01-07	9.87	17,000	125,258.41	152,490.00	-

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。

除在“7.4.12 期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限制的情况外，本基金所投资的证券均能及时变现。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

在资产端，本基金主要投资于基金合同约定的具有良好流动性的金融工具。基金管理人持续监测本基金持有资产的市场交易量、交易集中度等涉及资产流动性水平的风险指标，并定期开展压力

测试，详细评估在不同的压力情景下资产变现情况的变化。

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

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

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

本基金为指数增强型基金，以国证 2000 指数为标的指数，基金股票投资方面将主要采用指数增强量化投资策略。因此，利率风险不是本基金的主要风险。

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 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	14,560,836.00	92.67	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	14,560,836.00	92.67	19,413,839.84	91.88

注：①本表中交易性金融资产-债券投资科目仅包含可转换公司债券和可交换公司债券等。

②由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除国证 2000 指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
	-5%	-771,398.72	-1,040,750.63
	+5%	771,398.72	1,040,750.63

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	14,408,346.00	19,400,339.23
第二层次	152,490.00	13,500.61
第三层次	-	-
合计	14,560,836.00	19,413,839.84

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券等投资，若出现交易不活跃（包括重大事项停牌、境内证券涨跌停等导致的交易不活跃）和非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值

所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。本基金政策以导致各层次之间转换的事项发生日作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 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

无。

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 2024 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	14,560,836.00	91.09
	其中：股票	14,560,836.00	91.09
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	1,332,931.37	8.34
8	其他各项资产	91,128.88	0.57
9	合计	15,984,896.25	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	1,474.00	0.01
B	采矿业	287,004.00	1.83
C	制造业	8,735,915.00	55.60
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	205,178.00	1.31
E	建筑业	80,476.00	0.51
F	批发和零售业	166,024.00	1.06
G	交通运输、仓储和邮政业	326,052.00	2.08
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,268,941.00	8.08
J	金融业	113,459.00	0.72
K	房地产业	175,981.00	1.12
L	租赁和商务服务业	96,333.00	0.61
M	科学研究和技术服务业	194,639.00	1.24
N	水利、环境和公共设施管理业	18,306.00	0.12
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	46,584.00	0.30
R	文化、体育和娱乐业	133,838.00	0.85
S	综合	-	-
	合计	11,850,204.00	75.42

8.2.2 积极投资期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	5,470.00	0.03
C	制造业	1,907,313.00	12.14
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	14,712.00	0.09
E	建筑业	123,651.00	0.79
F	批发和零售业	57,230.00	0.36
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-

H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	271,660.00	1.73
J	金融业	133,112.00	0.85
K	房地产业	3,725.00	0.02
L	租赁和商务服务业	2,552.00	0.02
M	科学研究和技术服务业	12,370.00	0.08
N	水利、环境和公共设施管理业	175,766.00	1.12
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	3,071.00	0.02
S	综合	-	-
	合计	2,710,632.00	17.25

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	300151	昌红科技	8,900	151,300.00	0.96
2	300857	协创数据	1,400	149,646.00	0.95
3	301291	明阳电气	3,300	144,936.00	0.92
4	300561	汇金科技	2,600	142,896.00	0.91
5	601579	会稽山	12,100	133,826.00	0.85
6	600810	神马股份	16,400	132,676.00	0.84
7	002437	誉衡药业	53,100	132,219.00	0.84
8	002613	北玻股份	32,500	131,300.00	0.84
9	600226	亨通股份	51,300	130,815.00	0.83
10	002170	芭田股份	14,900	130,077.00	0.83
11	301117	佳缘科技	4,200	128,646.00	0.82
12	600682	南京新百	18,800	128,592.00	0.82
13	300580	贝斯特	5,600	128,520.00	0.82
14	000828	东莞控股	12,000	128,280.00	0.82
15	000655	金岭矿业	20,800	127,920.00	0.81
16	001328	登康口腔	4,000	127,040.00	0.81
17	600759	洲际油气	55,800	126,666.00	0.81
18	002057	中钢天源	17,500	126,350.00	0.80
19	688176	亚虹医药	18,600	126,294.00	0.80
20	300485	赛升药业	18,000	126,180.00	0.80
21	603530	神马电力	5,100	126,021.00	0.80
22	002644	佛慈制药	16,300	125,836.00	0.80
23	688591	泰凌微	4,000	125,600.00	0.80

24	301333	诺思格	2,500	124,975.00	0.80
25	300145	中金环境	33,600	124,656.00	0.79
26	688523	航天环宇	6,200	124,000.00	0.79
27	688522	纳睿雷达	2,200	123,948.00	0.79
28	300809	华辰装备	3,900	123,552.00	0.79
29	688766	普冉股份	1,200	121,512.00	0.77
30	600724	宁波富达	19,000	120,650.00	0.77
31	688507	索辰科技	2,200	120,340.00	0.77
32	002082	万邦德	18,500	118,955.00	0.76
33	301116	益客食品	9,600	118,560.00	0.75
34	002122	汇洲智能	34,800	118,320.00	0.75
35	002238	天威视讯	14,700	118,041.00	0.75
36	300657	弘信电子	5,200	117,832.00	0.75
37	000766	通化金马	7,400	116,180.00	0.74
38	300852	四会富仕	4,400	115,368.00	0.73
39	001313	粤海饲料	13,100	114,494.00	0.73
40	301328	维峰电子	2,700	114,129.00	0.73
41	301509	金凯生科	4,200	108,696.00	0.69
42	688612	威迈斯	4,600	108,284.00	0.69
43	301266	宇邦新材	3,100	103,850.00	0.66
44	300913	兆龙互连	1,800	103,518.00	0.66
45	002590	万安科技	8,400	102,648.00	0.65
46	000737	北方铜业	13,000	101,400.00	0.65
47	002489	浙江永强	31,200	101,088.00	0.64
48	301327	华宝新能	1,300	99,723.00	0.63
49	000755	山西高速	19,300	97,658.00	0.62
50	300304	云意电气	12,100	96,800.00	0.62
51	600367	红星发展	8,300	95,782.00	0.61
52	605018	长华集团	10,900	95,702.00	0.61
53	600186	莲花控股	16,300	92,910.00	0.59
54	688351	微电生理	4,800	91,392.00	0.58
55	002328	新朋股份	14,200	87,046.00	0.55
56	002553	南方精工	6,500	83,590.00	0.53
57	603009	北特科技	2,100	82,068.00	0.52
58	603662	柯力传感	1,200	77,520.00	0.49
59	688097	博众精工	2,800	73,500.00	0.47
60	600694	大商股份	2,700	71,199.00	0.45
61	600618	氯碱化工	7,200	70,992.00	0.45
62	688208	道通科技	1,800	70,488.00	0.45
63	002962	五方光电	4,000	69,560.00	0.44
64	300451	创业慧康	15,300	68,544.00	0.44
65	600657	信达地产	16,300	67,808.00	0.43
66	600864	哈投股份	9,100	66,885.00	0.43
67	600169	太原重工	26,800	66,732.00	0.42

68	002843	泰嘉股份	3,100	66,092.00	0.42
69	002400	省广集团	8,000	63,920.00	0.41
70	688306	均普智能	8,200	63,550.00	0.40
71	000969	安泰科技	5,600	62,440.00	0.40
72	603386	骏亚科技	5,600	62,272.00	0.40
73	002263	大东南	24,600	61,008.00	0.39
74	688027	国盾量子	200	59,672.00	0.38
75	301456	盘古智能	2,600	58,734.00	0.37
76	300607	拓斯达	2,300	58,627.00	0.37
77	600420	国药现代	4,900	58,506.00	0.37
78	001267	汇绿生态	7,600	58,064.00	0.37
79	603918	金桥信息	4,500	57,240.00	0.36
80	600825	新华传媒	8,700	56,985.00	0.36
81	600649	城投控股	12,600	56,070.00	0.36
82	000597	东北制药	10,400	54,808.00	0.35
83	688246	嘉和美康	2,200	54,560.00	0.35
84	002149	西部材料	3,000	53,100.00	0.34
85	300267	尔康制药	17,100	47,538.00	0.30
86	301211	亨迪药业	2,200	46,772.00	0.30
87	300548	博创科技	1,000	46,410.00	0.30
88	300326	凯利泰	6,700	43,550.00	0.28
89	300194	福安药业	9,400	41,924.00	0.27
90	000631	顺发恒业	13,900	40,866.00	0.26
91	688593	新相微	2,200	40,260.00	0.26
92	688343	云天励飞	800	39,680.00	0.25
93	003013	地铁设计	2,600	39,312.00	0.25
94	301205	联特科技	500	37,845.00	0.24
95	300188	国投智能	2,700	37,233.00	0.24
96	002361	神剑股份	6,800	37,060.00	0.24
97	300229	拓尔思	1,700	35,598.00	0.23
98	002892	科力尔	2,300	35,420.00	0.23
99	600866	星湖科技	5,400	34,938.00	0.22
100	301293	三博脑科	800	34,624.00	0.22
101	301085	亚康股份	500	34,285.00	0.22
102	300981	中红医疗	2,500	32,150.00	0.20
103	301155	海力风电	600	31,986.00	0.20
104	300788	中信出版	1,000	31,570.00	0.20
105	300315	掌趣科技	5,500	30,250.00	0.19
106	301051	信濠光电	1,100	29,766.00	0.19
107	603569	长久物流	4,000	29,760.00	0.19
108	002923	润都股份	2,900	27,666.00	0.18
109	300278	华昌达	4,700	27,495.00	0.17
110	688548	广钢气体	2,600	26,182.00	0.17
111	002584	西陇科学	3,600	25,884.00	0.16

112	300469	信息发展	1,100	25,850.00	0.16
113	002270	华明装备	1,500	25,335.00	0.16
114	300174	元力股份	1,700	25,024.00	0.16
115	603881	数据港	1,100	24,915.00	0.16
116	600757	长江传媒	2,600	24,882.00	0.16
117	600575	淮河能源	6,200	24,614.00	0.16
118	002961	瑞达期货	1,600	22,992.00	0.15
119	002585	双星新材	4,300	22,962.00	0.15
120	300129	泰胜风能	3,200	22,560.00	0.14
121	300772	运达股份	1,700	22,508.00	0.14
122	600846	同济科技	2,600	22,412.00	0.14
123	301339	通行宝	1,100	22,374.00	0.14
124	600428	中远海特	3,000	21,900.00	0.14
125	002139	拓邦股份	1,600	21,776.00	0.14
126	300738	奥飞数据	1,500	21,750.00	0.14
127	600710	苏美达	2,300	21,390.00	0.14
128	002467	二六三	3,800	20,976.00	0.13
129	600391	航发科技	1,000	19,850.00	0.13
130	300768	迪普科技	1,100	19,250.00	0.12
131	003006	百亚股份	800	19,192.00	0.12
132	000422	湖北宜化	1,500	18,930.00	0.12
133	603995	甬金股份	1,000	18,290.00	0.12
134	688205	德科立	200	18,200.00	0.12
135	300415	伊之密	900	18,054.00	0.11
136	600477	杭萧钢构	7,000	17,990.00	0.11
137	002434	万里扬	2,900	17,980.00	0.11
138	002020	京新药业	1,400	17,920.00	0.11
139	300079	数码视讯	3,300	17,853.00	0.11
140	603920	世运电路	600	17,640.00	0.11
141	601963	重庆银行	1,900	17,632.00	0.11
142	688400	凌云光	800	17,536.00	0.11
143	002635	安洁科技	1,100	17,512.00	0.11
144	301101	明月镜片	400	17,152.00	0.11
145	688336	三生国健	800	17,136.00	0.11
146	002396	星网锐捷	900	17,091.00	0.11
147	002421	达实智能	4,900	16,807.00	0.11
148	603071	物产环能	1,300	16,796.00	0.11
149	300869	康泰医学	1,200	16,728.00	0.11
150	600691	阳煤化工	7,500	16,650.00	0.11
151	000685	中山公用	1,800	16,614.00	0.11
152	000049	德赛电池	700	16,457.00	0.10
153	603169	兰石重装	3,000	16,350.00	0.10
154	605333	沪光股份	500	16,315.00	0.10
155	003005	竞业达	600	16,272.00	0.10

156	300319	麦捷科技	1,300	16,224.00	0.10
157	300263	隆华科技	2,200	16,060.00	0.10
158	603118	共进股份	1,800	16,020.00	0.10
159	002946	新乳业	1,100	15,961.00	0.10
160	300685	艾德生物	700	15,960.00	0.10
161	300443	金雷股份	800	15,936.00	0.10
162	600508	上海能源	1,200	15,876.00	0.10
163	600210	紫江企业	2,400	15,864.00	0.10
164	600163	中闽能源	2,600	15,834.00	0.10
165	600602	云赛智联	1,000	15,820.00	0.10
166	300369	绿盟科技	2,200	15,818.00	0.10
167	603693	江苏新能	1,600	15,760.00	0.10
168	688337	普源精电	400	15,600.00	0.10
169	600509	天富能源	2,400	15,528.00	0.10
170	603055	台华新材	1,400	15,512.00	0.10
171	688088	虹软科技	400	15,424.00	0.10
172	000672	上峰水泥	2,000	15,300.00	0.10
173	300634	彩讯股份	700	15,260.00	0.10
174	300323	华灿光电	1,800	14,904.00	0.09
175	600664	哈药股份	3,600	14,868.00	0.09
176	000059	华锦股份	3,100	14,849.00	0.09
177	600211	西藏药业	400	14,776.00	0.09
178	600877	电科芯片	1,100	14,509.00	0.09
179	300102	乾照光电	1,400	14,504.00	0.09
180	688596	正帆科技	400	14,220.00	0.09
181	605198	安德利	500	13,785.00	0.09
182	002779	中坚科技	200	13,600.00	0.09
183	688029	南微医学	200	13,518.00	0.09
184	300618	寒锐钴业	400	13,508.00	0.09
185	603699	纽威股份	600	13,302.00	0.08
186	688789	宏华数科	200	13,276.00	0.08
187	300737	科顺股份	2,600	13,182.00	0.08
188	603983	丸美生物	400	12,904.00	0.08
189	600869	远东股份	2,700	12,825.00	0.08
190	000065	北方国际	1,300	12,714.00	0.08
191	300381	溢多利	1,800	12,636.00	0.08
192	300363	博腾股份	800	12,616.00	0.08
193	000913	钱江摩托	700	12,607.00	0.08
194	603368	柳药集团	700	12,502.00	0.08
195	002651	利君股份	1,700	12,461.00	0.08
196	300638	广和通	600	12,090.00	0.08
197	300143	盈康生命	1,300	11,960.00	0.08
198	002332	仙琚制药	1,200	11,928.00	0.08
199	000019	深粮控股	1,800	11,826.00	0.08

200	603113	金能科技	2,100	11,823.00	0.08
201	688372	伟测科技	200	11,704.00	0.07
202	300183	东软载波	600	11,610.00	0.07
203	688232	新点软件	400	11,596.00	0.07
204	002003	伟星股份	800	11,336.00	0.07
205	002649	博彦科技	900	10,908.00	0.07
206	688127	蓝特光学	400	10,840.00	0.07
207	300432	富临精工	700	10,766.00	0.07
208	300072	海新能科	3,000	10,650.00	0.07
209	301087	可孚医疗	300	10,608.00	0.07
210	601678	滨化股份	2,800	10,528.00	0.07
211	688409	富创精密	200	10,314.00	0.07
212	601126	四方股份	600	10,176.00	0.06
213	000801	四川九洲	700	10,017.00	0.06
214	688315	诺禾致源	800	10,000.00	0.06
215	002895	川恒股份	400	9,840.00	0.06
216	000603	盛达资源	800	9,592.00	0.06
217	688252	天德钰	400	9,580.00	0.06
218	300303	聚飞光电	1,400	9,548.00	0.06
219	603609	禾丰股份	1,100	9,482.00	0.06
220	002991	甘源食品	100	9,352.00	0.06
221	301202	朗威股份	200	9,338.00	0.06
222	603466	风语筑	1,000	9,320.00	0.06
223	688322	奥比中光	200	9,300.00	0.06
224	301180	万祥科技	600	9,282.00	0.06
225	300226	上海钢联	400	9,148.00	0.06
226	000415	渤海租赁	2,400	9,048.00	0.06
227	601200	上海环境	1,100	8,987.00	0.06
228	601022	宁波远洋	1,100	8,833.00	0.06
229	688201	信安世纪	1,000	8,830.00	0.06
230	002077	大港股份	600	8,802.00	0.06
231	688658	悦康药业	600	8,646.00	0.06
232	688261	东微半导	200	8,398.00	0.05
233	600986	浙文互联	1,400	8,372.00	0.05
234	002250	联化科技	1,500	8,265.00	0.05
235	688392	骄成超声	200	8,160.00	0.05
236	300770	新媒股份	200	8,082.00	0.05
237	600171	上海贝岭	200	7,936.00	0.05
238	600861	北京人力	400	7,740.00	0.05
239	688239	航宇科技	200	7,460.00	0.05
240	600320	振华重工	1,900	7,448.00	0.05
241	600507	方大特钢	1,800	7,290.00	0.05
242	301039	中集车辆	800	7,240.00	0.05
243	002135	东南网架	1,700	7,225.00	0.05

244	002726	龙大美食	900	7,128.00	0.05
245	688209	英集芯	400	7,068.00	0.04
246	000923	河钢资源	500	6,950.00	0.04
247	002367	康力电梯	1,000	6,870.00	0.04
248	001301	尚太科技	100	6,855.00	0.04
249	301078	孩子王	600	6,828.00	0.04
250	688680	海优新材	200	6,756.00	0.04
251	688362	甬矽电子	200	6,736.00	0.04
252	603187	海容冷链	600	6,714.00	0.04
253	002688	金河生物	1,500	6,705.00	0.04
254	000404	长虹华意	900	6,660.00	0.04
255	688697	纽威数控	400	6,656.00	0.04
256	002588	史丹利	900	6,642.00	0.04
257	603158	腾龙股份	800	6,464.00	0.04
258	603162	海通发展	700	6,440.00	0.04
259	603766	隆鑫通用	700	6,370.00	0.04
260	001208	华菱线缆	700	6,356.00	0.04
261	600216	浙江医药	400	6,344.00	0.04
262	600218	全柴动力	800	6,320.00	0.04
263	688488	艾迪药业	800	6,288.00	0.04
264	605507	国邦医药	300	6,249.00	0.04
265	600073	光明肉业	900	6,246.00	0.04
266	002093	国脉科技	800	6,240.00	0.04
267	603966	法兰泰克	800	6,176.00	0.04
268	601900	南方传媒	400	6,044.00	0.04
269	603093	南华期货	500	5,950.00	0.04
270	002533	金杯电工	600	5,904.00	0.04
271	601609	金田股份	1,000	5,900.00	0.04
272	600237	铜峰电子	900	5,895.00	0.04
273	688207	格灵深瞳	400	5,696.00	0.04
274	002749	国光股份	400	5,688.00	0.04
275	300447	全信股份	400	5,668.00	0.04
276	688158	优刻得	400	5,592.00	0.04
277	600488	津药药业	1,300	5,512.00	0.04
278	002539	云图控股	700	5,474.00	0.03
279	002666	德联集团	1,200	5,232.00	0.03
280	300439	美康生物	500	5,225.00	0.03
281	300332	天壕能源	900	5,211.00	0.03
282	600035	楚天高速	1,100	5,060.00	0.03
283	301511	德福科技	400	5,024.00	0.03
284	002967	广电计量	300	4,920.00	0.03
285	603039	泛微网络	100	4,900.00	0.03
286	300021	大禹节水	1,200	4,884.00	0.03
287	301090	华润材料	700	4,858.00	0.03

288	603890	春秋电子	400	4,700.00	0.03
289	688233	神工股份	200	4,690.00	0.03
290	300696	爱乐达	300	4,659.00	0.03
291	002990	盛视科技	200	4,634.00	0.03
292	600266	城建发展	900	4,590.00	0.03
293	000920	沃顿科技	500	4,460.00	0.03
294	002033	丽江股份	500	4,435.00	0.03
295	600366	宁波韵升	600	4,416.00	0.03
296	600828	茂业商业	1,000	4,370.00	0.03
297	300272	开能健康	700	4,305.00	0.03
298	002245	蔚蓝锂芯	400	4,276.00	0.03
299	000823	超声电子	400	4,128.00	0.03
300	688066	航天宏图	200	4,080.00	0.03
301	601137	博威合金	200	4,060.00	0.03
302	603969	银龙股份	600	4,056.00	0.03
303	600063	皖维高新	1,000	4,000.00	0.03
304	603258	电魂网络	200	3,978.00	0.03
305	002225	濮耐股份	800	3,976.00	0.03
306	002148	北纬科技	600	3,966.00	0.03
307	301149	隆华新材	400	3,956.00	0.03
308	301062	上海艾录	300	3,930.00	0.03
309	300083	创世纪	600	3,906.00	0.02
310	002746	仙坛股份	600	3,804.00	0.02
311	000517	荣安地产	1,700	3,791.00	0.02
312	001323	慕思股份	100	3,781.00	0.02
313	300170	汉得信息	300	3,720.00	0.02
314	300783	三只松鼠	100	3,687.00	0.02
315	300985	致远新能	200	3,682.00	0.02
316	688579	山大地纬	400	3,676.00	0.02
317	002891	中宠股份	100	3,570.00	0.02
318	603109	神驰机电	200	3,550.00	0.02
319	688510	航亚科技	200	3,484.00	0.02
320	002546	新联电子	800	3,464.00	0.02
321	601279	英利汽车	900	3,447.00	0.02
322	000555	神州信息	300	3,360.00	0.02
322	600268	国电南自	500	3,360.00	0.02
323	301389	隆扬电子	200	3,344.00	0.02
324	688313	仕佳光子	200	3,278.00	0.02
325	300659	中孚信息	200	3,238.00	0.02
326	000682	东方电子	300	3,213.00	0.02
327	600531	豫光金铅	500	3,210.00	0.02
328	601089	福元医药	200	3,200.00	0.02
329	000607	华媒控股	800	2,968.00	0.02
330	688238	和元生物	600	2,964.00	0.02

331	688007	光峰科技	200	2,958.00	0.02
332	603687	大胜达	400	2,916.00	0.02
333	601949	中国出版	400	2,872.00	0.02
334	002314	南山控股	1,200	2,856.00	0.02
335	002987	京北方	200	2,846.00	0.02
336	600888	新疆众和	400	2,840.00	0.02
337	688588	凌志软件	200	2,760.00	0.02
338	300258	精锻科技	300	2,673.00	0.02
339	300161	华中数控	100	2,634.00	0.02
340	002446	盛路通信	400	2,620.00	0.02
341	601107	四川成渝	500	2,615.00	0.02
342	002912	中新赛克	100	2,559.00	0.02
343	603936	博敏电子	300	2,526.00	0.02
344	603690	至纯科技	100	2,511.00	0.02
345	002609	捷顺科技	300	2,478.00	0.02
346	688327	云从科技	200	2,420.00	0.02
347	600310	广西能源	500	2,280.00	0.01
348	300219	鸿利智汇	300	2,247.00	0.01
349	002707	众信旅游	300	2,217.00	0.01
350	300241	瑞丰光电	400	2,196.00	0.01
351	605228	神通科技	200	2,158.00	0.01
352	600184	光电股份	200	2,064.00	0.01
353	300507	苏奥传感	300	2,010.00	0.01
354	002479	富春环保	400	1,896.00	0.01
355	002404	嘉欣丝绸	300	1,857.00	0.01
356	002004	华邦健康	400	1,808.00	0.01
357	600742	一汽富维	200	1,770.00	0.01
358	002419	天虹股份	300	1,758.00	0.01
359	002398	垒知集团	400	1,756.00	0.01
360	300138	晨光生物	200	1,744.00	0.01
361	002255	海陆重工	300	1,668.00	0.01
362	603043	广州酒家	100	1,663.00	0.01
363	002243	力合科创	200	1,612.00	0.01
364	600206	有研新材	100	1,567.00	0.01
365	002441	众业达	200	1,556.00	0.01
366	300560	中富通	100	1,548.00	0.01
367	002491	通鼎互联	300	1,542.00	0.01
368	600449	宁夏建材	100	1,502.00	0.01
369	601038	一拖股份	100	1,478.00	0.01
370	002772	众兴菌业	200	1,474.00	0.01
371	601801	皖新传媒	200	1,468.00	0.01
372	300250	初灵信息	100	1,410.00	0.01
373	600278	东方创业	200	1,398.00	0.01
374	600601	方正科技	300	1,317.00	0.01

375	600654	中安科	400	1,292.00	0.01
376	002752	昇兴股份	200	1,270.00	0.01
377	002448	中原内配	200	1,252.00	0.01
378	600868	梅雁吉祥	500	1,240.00	0.01
379	300311	任子行	200	1,170.00	0.01
380	002194	武汉凡谷	100	1,122.00	0.01
381	300006	莱美药业	300	1,098.00	0.01
382	300252	金信诺	100	1,076.00	0.01
383	600207	安彩高科	200	892.00	0.01
384	002852	道道全	100	826.00	0.01
385	002615	哈尔斯	100	795.00	0.01
386	600328	中盐化工	100	787.00	0.01
387	300887	谱尼测试	100	764.00	0.00
388	600609	金杯汽车	100	720.00	0.00
389	603987	康德莱	100	718.00	0.00
390	600330	天通股份	100	710.00	0.00
391	600229	城市传媒	100	697.00	0.00

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	002379	宏创控股	17,000.00	152,490.00	0.97
2	605566	福莱茵特	7,000.00	126,000.00	0.80
3	301303	真兰仪表	8,100.00	124,092.00	0.79
4	301468	博盈特焊	5,900.00	123,782.00	0.79
5	002830	名雕股份	9,900.00	123,651.00	0.79
6	600182	S 佳通	7,100.00	122,333.00	0.78
7	003007	直真科技	4,000.00	122,040.00	0.78
8	300190	维尔利	34,600.00	121,446.00	0.77
9	600084	中信尼雅	23,000.00	120,980.00	0.77
10	000623	吉林敖东	7,000.00	120,890.00	0.77
11	600816	建元信托	34,200.00	119,700.00	0.76
12	301190	善水科技	7,300.00	115,267.00	0.73
13	002888	惠威科技	4,600.00	84,732.00	0.54
14	301220	亚香股份	2,000.00	74,040.00	0.47
15	600651	飞乐音响	13,700.00	56,718.00	0.36
16	688610	埃科光电	1,600.00	55,520.00	0.35
17	300937	药易购	2,200.00	55,044.00	0.35
18	300069	金利华电	3,900.00	51,363.00	0.33
19	688525	佰维存储	800.00	49,576.00	0.32
20	689009	九号公司	1,000.00	47,500.00	0.30
21	603950	长源东谷	2,400.00	42,264.00	0.27
22	603332	苏州龙杰	4,700.00	40,467.00	0.26

23	002887	绿茵生态	5,600.00	39,032.00	0.25
24	605389	长龄液压	1,300.00	34,619.00	0.22
25	688702	盛科通信	400.00	33,600.00	0.21
26	002871	伟隆股份	2,700.00	26,163.00	0.17
27	301529	福赛科技	900.00	25,884.00	0.16
28	301380	挖金客	500.00	24,790.00	0.16
29	688255	凯尔达	800.00	21,368.00	0.14
30	600959	江苏有线	5,700.00	19,095.00	0.12
31	000768	中航西飞	600.00	16,944.00	0.11
32	000528	柳工	1,400.00	16,884.00	0.11
33	300549	优德精密	1,000.00	16,380.00	0.10
34	002266	浙富控股	4,900.00	15,288.00	0.10
35	600887	伊利股份	500.00	15,090.00	0.10
36	600299	安迪苏	1,200.00	15,060.00	0.10
37	600037	歌华有线	2,000.00	14,920.00	0.09
38	688100	威胜信息	400.00	14,480.00	0.09
39	600143	金发科技	1,600.00	13,824.00	0.09
40	000423	东阿阿胶	200.00	12,544.00	0.08
41	301047	义翘神州	200.00	12,370.00	0.08
42	600734	实达集团	3,300.00	11,913.00	0.08
43	603170	宝立食品	700.00	10,654.00	0.07
44	300017	网宿科技	1,000.00	10,570.00	0.07
45	000875	吉电股份	2,000.00	10,520.00	0.07
46	300442	润泽科技	200.00	10,392.00	0.07
47	000951	中国重汽	600.00	10,188.00	0.06
48	600060	海信视像	500.00	9,970.00	0.06
49	600316	洪都航空	300.00	9,636.00	0.06
50	600556	天下秀	1,700.00	8,840.00	0.06
51	002019	亿帆医药	800.00	8,576.00	0.05
52	601399	国机重装	2,700.00	8,316.00	0.05
53	000400	许继电气	300.00	8,259.00	0.05
54	600109	国金证券	900.00	7,857.00	0.05
55	601992	金隅集团	4,400.00	7,832.00	0.05
56	002273	水晶光电	300.00	6,666.00	0.04
57	601002	晋亿实业	1,500.00	6,525.00	0.04
58	000683	远兴能源	1,100.00	6,149.00	0.04
59	600312	平高电气	300.00	5,760.00	0.04
60	600583	海油工程	1,000.00	5,470.00	0.03
61	603079	圣达生物	400.00	5,388.00	0.03
62	300413	芒果超媒	200.00	5,378.00	0.03
63	002065	东华软件	700.00	5,082.00	0.03
64	605358	立昂微	200.00	4,954.00	0.03
65	300115	长盈精密	300.00	4,872.00	0.03
66	300414	中光防雷	600.00	4,776.00	0.03

67	605066	天正电气	700.00	4,214.00	0.03
68	603223	恒通股份	400.00	4,192.00	0.03
69	600246	万通发展	500.00	3,725.00	0.02
70	002938	鹏鼎控股	100.00	3,648.00	0.02
71	600879	航天电子	400.00	3,584.00	0.02
72	002340	格林美	500.00	3,265.00	0.02
73	600718	东软集团	300.00	3,231.00	0.02
74	002500	山西证券	500.00	3,140.00	0.02
75	002678	珠江钢琴	700.00	3,129.00	0.02
76	300437	清水源	300.00	2,694.00	0.02
77	600984	建设机械	800.00	2,552.00	0.02
78	300136	信维通信	100.00	2,544.00	0.02
79	603600	永艺股份	200.00	2,378.00	0.02
80	605589	圣泉集团	100.00	2,358.00	0.02
81	600827	百联股份	200.00	2,186.00	0.01
82	600141	兴发集团	100.00	2,170.00	0.01
83	002551	尚荣医疗	700.00	2,156.00	0.01
84	600668	尖峰集团	200.00	2,030.00	0.01
85	603999	读者传媒	300.00	1,845.00	0.01
86	603298	杭叉集团	100.00	1,789.00	0.01
87	600075	新疆天业	400.00	1,740.00	0.01
88	600267	海正药业	200.00	1,660.00	0.01
89	000776	广发证券	100.00	1,621.00	0.01
90	605299	舒华体育	200.00	1,578.00	0.01
91	002636	金安国纪	200.00	1,548.00	0.01
92	600980	北矿科技	100.00	1,528.00	0.01
93	002107	沃华医药	300.00	1,434.00	0.01
94	688468	科美诊断	200.00	1,370.00	0.01
95	002121	科陆电子	300.00	1,305.00	0.01
96	001330	博纳影业	200.00	1,226.00	0.01
97	002624	完美世界	100.00	1,033.00	0.01
98	600352	浙江龙盛	100.00	1,029.00	0.01
99	688148	芳源股份	200.00	990.00	0.01
100	000686	东北证券	100.00	794.00	0.01
101	600637	东方明珠	100.00	776.00	0.00
102	002414	高德红外	100.00	743.00	0.00
103	300088	长信科技	100.00	654.00	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 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	688507	索辰科技	468,496.46	2.22
2	301345	涛涛车业	462,879.00	2.19
3	002379	宏创控股	448,981.00	2.13
4	301239	普瑞眼科	439,152.00	2.08
5	301117	佳缘科技	438,717.00	2.08
6	300997	欢乐家	429,338.00	2.03
7	300729	乐歌股份	415,649.00	1.97
8	301328	维峰电子	414,415.00	1.96
9	000426	兴业银锡	412,288.00	1.95
10	300049	福瑞股份	412,235.00	1.95
11	300561	汇金科技	408,302.00	1.93
12	003013	地铁设计	404,875.00	1.92
13	603662	柯力传感	404,449.00	1.91
14	301529	福赛科技	394,202.00	1.87
15	301330	熵基科技	392,951.00	1.86
16	301468	博盈特焊	388,875.00	1.84
17	300318	博晖创新	383,031.00	1.81
18	300451	创业慧康	382,692.00	1.81
19	301116	益客食品	379,916.00	1.80
20	000061	农产品	379,837.00	1.80

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	301345	涛涛车业	561,342.00	2.66
2	300997	欢乐家	517,245.00	2.45
3	300969	恒帅股份	486,452.00	2.30
4	000426	兴业银锡	479,036.00	2.27
5	300982	苏文电能	475,251.00	2.25
6	300561	汇金科技	468,003.00	2.22
7	300990	同飞股份	461,959.00	2.19
8	603662	柯力传感	452,821.00	2.14
9	300049	福瑞股份	443,111.00	2.10
10	300636	同和药业	422,738.00	2.00
11	301103	何氏眼科	416,434.50	1.97
12	300729	乐歌股份	405,617.00	1.92
13	301349	信德新材	400,017.00	1.89
14	301330	熵基科技	398,705.00	1.89
15	301239	普瑞眼科	393,904.00	1.86

16	300318	博晖创新	383,986.00	1.82
17	001236	弘业期货	377,647.00	1.79
18	300132	青松股份	375,417.00	1.78
19	000061	农产品	375,277.00	1.78
20	601000	唐山港	364,000.00	1.72

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	147,441,436.51
卖出股票收入（成交）总额	150,879,653.87

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末无股指期货投资。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末无国债期货投资。

8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货投资。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 报告期内，本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求，未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.12.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	2,764.63
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	88,364.25
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	91,128.88

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	002379	宏创控股	152,490.00	0.97	重大事项

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
华夏国证	274	50,057.45	10,116,743.24	73.76%	3,598,997.40	26.24%

2000 指数增强发起式 A						
华夏国证 2000 指数增强发起式 C	662	4,084.85	-	-	2,704,170.20	100.00%
合计	936	17,542.64	10,116,743.24	61.61%	6,303,167.60	38.39%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	华夏国证 2000 指数增强发起式 A	53,644.75	0.39%
	华夏国证 2000 指数增强发起式 C	-	-
	合计	53,644.75	0.33%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	华夏国证 2000 指数增强发起式 A	0
	华夏国证 2000 指数增强发起式 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	华夏国证 2000 指数增强发起式 A	0
	华夏国证 2000 指数增强发起式 C	0
	合计	0

9.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,009,800.10	60.96%	10,000,000.00	60.90%	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	60.96%	10,000,000.00	60.90%	不少于三年

§10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华夏国证 2000 指数增强发起式 A	华夏国证 2000 指数增强发起式 C
基金合同生效日(2023 年 5 月 23 日) 基金份额总额	12,140,412.47	6,879,415.81
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	9,178,651.09	40,360,186.07
减：本报告期基金总赎回份额	8,946,728.68	45,576,094.48
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	13,715,740.64	2,704,170.20

§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，本基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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。

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

为本基金提供审计服务的会计师事务所由普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）更换为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）。本基金本报告期应支付给安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为 7,900.00 元人民币。本基金本报告期内选聘安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）提供首年审计服务。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

措施 1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	管理人
受到稽查或处罚等措施的时间	2024-07-05
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证监会北京监管局
受到的具体措施类型	责令改正并暂停办理相关业务行政监管措施
受到稽查或处罚等措施的原因	部分制度不健全或执行不到位，部分业务管控不严

管理人采取整改措施的情况(如提出整改意见)	基金管理人高度重视, 已按要求完成了整改, 并将整改落实情况报送监管机构
其他	无
措施 2	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	高级管理人员
受到稽查或处罚等措施的时间	2024-08-16
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证监会北京监管局
受到的具体措施类型	警示函
受到稽查或处罚等措施的原因	部分制度不健全或执行不到位, 部分业务管控不严
管理人采取整改措施的情况(如提出整改意见)	不适用
其他	无

11.6.1 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
招商证券	4	137,435,415.79	46.07%	44,356.02	42.46%	-
中信证券	4	102,775,294.72	34.45%	38,275.34	36.64%	-
国投证券	3	58,078,879.87	19.47%	21,828.27	20.90%	-

注：①为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择研究服务证券公司的标准，即：

i 投研部门根据证券公司的总体资质情况、财务状况、研究服务能力、经营行为及风控合规能力等情况，选择证券公司进入交易合作库，并进行跟踪评估，对合作库证券公司进行调整。

ii 投研部门牵头制定证券公司研究服务评价制度，建立健全对证券公司研究服务的定期评价机制。评价指标包括但不限于：业绩贡献、反馈速度、观点或数据质量等。

②为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择交易服务证券公司的标准，即：

i 投资部门根据证券公司的总体资质、财务状况、经营行为和合规风控能力、交易服务能力等情况，选择证券公司进入交易合作库，并进行跟踪监控，对合作库证券公司进行调整。

ii 投资部门牵头制定证券公司交易服务评价制度，建立健全对证券公司交易服务的定期评价机制。

iii 投资部门定期对证券公司的交易服务开展评价，评价指标包括但不限于：交易服务成本、交易服务能力、交易系统稳定性、交易系统支持能力、应急交易能力等。

③证券公司专用交易单元选择程序：

i 投资、研究部门牵头制定规范、合理的合作证券公司管理制度，明确证券公司准入标准、退出程序等。合规管理部门对合作证券公司管理制度进行合规性审查。

ii 投资、研究部门根据上述标准进行评估并确定选用的证券公司。

iii 本基金管理人与被选择的证券公司签订交易单元租用协议/证券经纪服务协议。

④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。

⑤在上述租用的券商交易单元中，华宝证券的部分交易单元为本基金本期剔除的交易单元，本期没有新增的券商交易单元。

⑥本部分的数据统计时间区间与本报告的报告期一致；本公司网站披露的《华夏基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2024 年度）》的报告期为 2024 年 7 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日。敬请投资者关注上述报告统计时间区间的口径差异。

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
招商证券	11,952.05	37.29%	-	-	-	-	-	-
中信证券	3,996.21	12.47%	-	-	-	-	-	-
国投证券	16,103.92	50.24%	-	-	-	-	-	-

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关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-01-16
2	华夏基金管理有限公司关于旗下 102 只基金改聘会计师事务所公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-12-03
3	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-12-26

§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	2024-01-01至 2024-12-31	10,009,800.10	-	-	10,009,800.10	60.96%
产品特有风险							
<p>本基金在报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额20%的情形，在市场流动性不足的情况下，如遇投资者巨额赎回或集中赎回，基金管理人可能无法以合理的价格及时变现基金资产，有可能对基金净值产生一定的影响，甚至可能引发基金的流动性风险。</p> <p>在特定情况下，若持有基金份额占比较高的投资者大量赎回本基金，可能导致在其赎回后本基金资产规模持续低于正常运作水平，面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。</p>							

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予基金注册的文件；
- 2、基金合同；
- 3、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

二〇二五年三月三十一日