

华夏中证 500 指数增强型证券投资基金
2020 年中期报告
2020 年 6 月 30 日

基金管理人：华夏基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：二〇二〇年八月二十九日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 8 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2020 年 3 月 25 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	1
§2 基金简介.....	3
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	4
3.1 主要会计数据和财务指标.....	4
3.2 基金净值表现.....	5
§4 管理人报告.....	6
§5 托管人报告.....	13
§6 中期报告财务会计报告（未经审计）.....	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	16
§7 投资组合报告.....	37
7.1 期末基金资产组合情况.....	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	38
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	43
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	48
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	48
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	49
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	49
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	49
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	49
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	49
7.12 投资组合报告附注.....	50
§8 基金份额持有人信息.....	50
§9 开放式基金份额变动.....	51
§10 重大事件揭示.....	51
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	54
§12 备查文件目录.....	54

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华夏中证 500 指数增强型证券投资基金	
基金简称	华夏中证 500 指数增强	
基金主代码	007994	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 3 月 25 日	
基金管理人	华夏基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	219,399,190.33 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 500 指数增强 A	华夏中证 500 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	007994	007995
报告期末下属分级基金的份额总额	210,387,044.77 份	9,012,145.56 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金力争实现超越标的指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。同时力争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%。
投资策略	本基金为指数基金，大类资产配置不作为本基金的核心策略。一般情况下将保持各类资产配置的基本稳定。在综合考量系统性风险、各类资产收益风险比值、股票资产估值、流动性要求、申购赎回以及分红等因素后，对基金资产配置做出适当调整。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率×95%+人民币活期存款税后利率×5%。
风险收益特征	本基金是一只股票指数增强型基金，属于中高风险、中高收益的证券投资基金品种，其预期风险与预期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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李彬	贺倩
	联系电话	400-818-6666	010-66060069
	电子邮箱	service@ChinaAMC.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-818-6666	95599
传真		010-63136700	010-68121816
注册地址		北京市顺义区安庆大街甲3号院	北京市东城区建国门内大街69号
办公地址		北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座8层	北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座F9
邮政编码		100033	100031

法定代表人	杨明辉	周慕冰
-------	-----	-----

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.chinaamc.com
基金中期报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2020 年 3 月 25 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日)	
	华夏中证 500 指数增强 A	华夏中证 500 指数增强 C
本期已实现收益	57,294,705.96	1,314,427.86
本期利润	66,290,000.37	1,446,215.21
加权平均基金份额本期利润	0.1574	0.1731
本期加权平均净值利润率	15.03%	16.26%
本期基金份额净值增长率	17.56%	17.43%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020 年 6 月 30 日)	
	华夏中证 500 指数增强 A	华夏中证 500 指数增强 C
期末可供分配利润	33,357,513.01	1,417,984.04
期末可供分配基金份额利润	0.1586	0.1573
期末基金资产净值	247,322,972.64	10,583,272.72
期末基金份额净值	1.1756	1.1743
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020 年 6 月 30 日)	
	华夏中证 500 指数增强 A	华夏中证 500 指数增强 C
基金份额累计净值增长率	17.56%	17.43%

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）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

④本基金合同于 2020 年 3 月 25 日生效。

3.2 基金净值表现

华夏中证 500 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
过去一个月	10.33%	0.88%	8.04%	0.84%	2.29%	0.04%
过去三个月	18.63%	1.06%	15.47%	1.08%	3.16%	-0.02%
自基金合同生效起至今	17.56%	1.03%	14.30%	1.11%	3.26%	-0.08%

华夏中证 500 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
过去一个月	10.29%	0.88%	8.04%	0.84%	2.25%	0.04%
过去三个月	18.51%	1.06%	15.47%	1.08%	3.04%	-0.02%
自基金合同生效起至今	17.43%	1.03%	14.30%	1.11%	3.13%	-0.08%

3.2.1 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 500 指数增强型证券投资基金

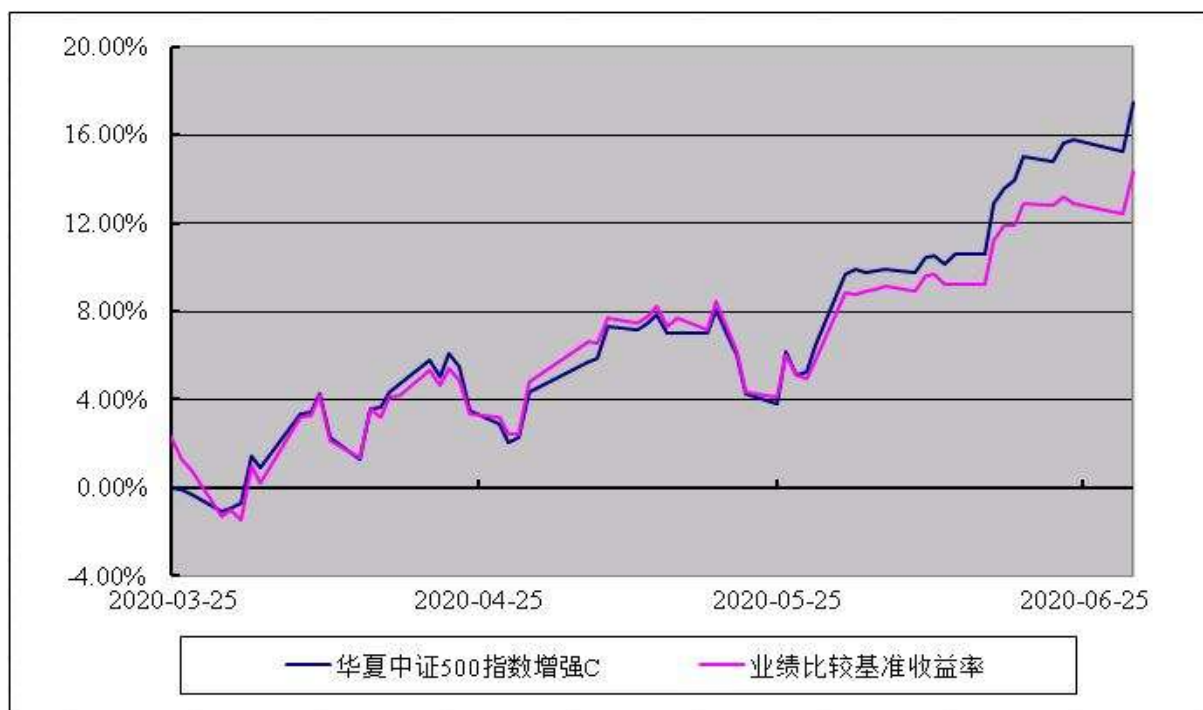
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2020 年 3 月 25 日至 2020 年 6 月 30 日)

华夏中证 500 指数增强 A



华夏中证 500 指数增强 C



注：①本基金合同于 2020 年 3 月 25 日生效。

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

§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、广州和青岛设有分公司，在香港、深圳、上海设有子公司。公司是首批全国社保基金管理人、首批企业年金基金管理人、境内首批 QDII 基金管理人、境内首只 ETF 基金管理人、境内首只沪港通 ETF 基金管理人、首批内地与香港基金互认基金管理人、首批基本养老保险基金投资管理人资格、首家加入联合国责任投资原则组织的公募基金公司、首批公募 FOF 基金管理人、首批公募养老目标基金管理人、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，以及特定客户资产管理人、保险资金投资管理人，香港子公司是首批 RQFII 基金管理人。华夏基金是业务领域最广泛的基金管理公司之一。

华夏基金是境内 ETF 基金资产管理规模最大的基金管理公司之一，在 ETF 基金管理方面积累了丰富的经验，目前旗下管理华夏上证 50ETF、华夏沪深 300ETF、华夏 MSCI 中国 A 股国际通 ETF、华夏中证 500ETF、华夏中小板 ETF、华夏创业板 ETF、华夏中证央企 ETF、华夏中证四川国改 ETF、华夏战略新兴成指 ETF、华夏中证 5G 通信主题 ETF、华夏中证人工智能主题 ETF、华夏国证半导体芯片 ETF、华夏中证新能源汽车 ETF、华夏粤港澳大湾区创新 100ETF、华夏消费 ETF、华夏金融 ETF、华夏医药 ETF、华夏中证全指证券公司 ETF、华夏中证银行 ETF、华夏中证全指房地产 ETF、华夏创蓝筹 ETF、华夏创成长 ETF、华夏恒生 ETF、华夏沪港通恒生 ETF、华夏野村日经 225ETF、华夏 3-5 年中高级可质押信用债 ETF、华夏饲料豆粕期货 ETF 和华夏黄金 ETF，初步形成了覆盖大盘蓝筹、宽基指数、中小创指数、主题指数、行业指数、Smart Beta 策略、海外市场指数、信用债指数、商品指数等较为完整的产品线。

华夏基金以深入的投资研究为基础，尽力捕捉市场机会，为投资人谋求良好的回报。根据银河证券基金研究中心基金业绩统计报告，2020 年在基金分类排名中（截至 2020 年 6 月 30 日数据），华夏双债债券(C 类)在“债券基金-普通债券型基金-普通债券型基金（可投转债）（非 A 类）”中排序 1/123；华夏鼎利债券 (A 类)和华夏鼎沛债券 (A 类)在“债券基金-普通债券型基金-普通债券型基金（二级）（A 类）”中分别排序 2/248 和 6/248；华夏鼎琪三个月定开债券在“债券基金-定期开放式纯债债券型基金-定期开放式纯债债券型基金（A 类）”中排序 2/345；华夏恒融定开债券在“债券基金-定期开放式普通债券型基金-定期开放式普通债券型基金（二级）（A 类）”中排序 9/22；华夏创新前沿股票和华夏经济转型股票在“股票基金-标准股票型基金-标准股票型基金（A 类）”中排序 2/203 和 10/203；华夏科技成长股票在“股票基金-行业主题股票型基金-TMT 与信息技术行业股票型基金（A 类）”中排序 1/10；华夏医疗健康混合(A 类)在“混合基金-偏股型基金-普通偏股型基金（A 类）”中排

序 5/225；华夏乐享健康混合在“混合基金-灵活配置型基金-灵活配置型基金（股票上下限 0-95%+基准股票比例 30%-60%）（A 类）”中排序 5/490；华夏磐泰混合(LOF)在“混合基金-偏债型基金-偏债型基金（A 类）”中分别排序 6/125；华夏移动互联混合（QDII）和华夏新时代混合（QDII）在“QDII 基金-QDII 混合基金-QDII 混合基金（A 类）”中分别排序 4/36 和 7/36；华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数(C 类)在“股票基金-标准指数股票型基金-标准策略指数股票型基金（非 A 类）”中排序 6/21，华夏创业板 ETF 在“股票基金-股票 ETF 基金-规模指数股票 ETF 基金”中排序 3/78；华夏消费 ETF 及华夏医药 ETF 在“股票基金-股票 ETF 基金-行业指数股票 ETF 基金”中分别排序 7/35 和 4/35；华夏战略新兴成指 ETF 在“股票基金-股票 ETF 基金-主题指数股票 ETF 基金”中排序 5/53；华夏创成长 ETF 及华夏创蓝筹 ETF 在“股票基金-股票 ETF 基金-策略指数股票 ETF 基金”中分别排序 1/17 和 3/17；华夏创业板 ETF 联接及华夏中小板 ETF 联接在“股票基金-股票 ETF 联接基金-规模指数股票 ETF 联接基金（A 类）”中分别排序 1/61 和 9/61；华夏战略新兴成指 ETF 联接在“股票基金-股票 ETF 联接基金-主题指数股票 ETF 联接基金（非 A 类）”中排序 3/28。

公司及旗下基金荣膺由基金评价机构颁发的多项奖项。在中国证券报举办的第十七届中国基金业金牛奖评选活动中，华夏基金荣获“被动投资金牛基金公司”奖，华夏上证 50ETF 荣获“三年期开放式指数型持续优胜金牛基金”奖。在证券时报社主办，在晨星资讯、上海证券和济安金信提供数据和研究支持的第十五届中国基金业明星基金奖评选中，华夏基金荣获“ETF 管理明星基金公司”，华夏回报混合荣获“五年持续回报绝对收益策略明星基金”。

在客户服务方面，2020 年上半年度，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）华夏基金管家客户端部分基金上线定投止盈功能，同时对资料上传功能进行升级优化，为广大投资者管理定期定额交易、以及业务办理提供了便利；（2）华夏基金微信公众号上线货币基金收益播报推送功能，方便客户及时了解持有的货币基金收益变动情况；（3）与苏州农商银行、渤海银行、中天证券等代销机构合作，拓宽了客户交易的渠道，提高了交易便利性；（4）开展“难忘，因为不用记”、“凡是家人，都有户口本”、“人未动，心已跳”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		
张弘弢	本基金的基金经理、董事总经理	2020-03-25	-	20 年	硕士。2000 年 4 月加入华夏基金管理有限公司，曾任研究发展部总经

					理、数量投资部副总经理，上证能源交易型开放式指数发起式证券投资基金基金经理（2013 年 3 月 28 日至 2016 年 3 月 28 日期间）、恒生交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2012 年 8 月 9 日至 2017 年 11 月 10 日期间）、MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2015 年 2 月 12 日至 2017 年 11 月 10 日期间）、华夏沪港通恒生交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2014 年 12 月 23 日至 2017 年 11 月 10 日期间）、华夏沪港通恒生交易型开放式指数证券投资基金联接基金经理（2015 年 1 月 13 日至 2017 年 11 月 10 日期间）、MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金
--	--	--	--	--	---

					经理（2015 年 2 月 12 日至 2017 年 11 月 10 日期间）、恒生交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（2012 年 8 月 21 日至 2017 年 11 月 10 日期间）、华夏睿磐泰利六个月定期开放混合型证券投资基金基金经理（2017 年 12 月 27 日至 2019 年 2 月 26 日期间）等。
孙蒙	本基金的基金经理、数量投资部副总裁	2020-04-17	-	6 年	理学硕士。曾任中信建投证券股份有限公司研究员、投资经理等。2017 年 7 月加入华夏基金管理有限公司，曾任数量投资部研究员、基金经理助理等。

注：①上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

②证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，本基金出现 1 次涉及本基金的交易所公开竞价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 5% 的情况，为投资策略需要所致，该次交易基金经理已根据基金管理要求提供决策依据。

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 500 指数，业绩比较基准为：中证 500 指数收益率*95%+银行活期存款利率(税后)*5%。中证 500 指数成份股由全部 A 股中剔除沪深 300 指数成份股及总市值排名前 300 名的股票后，总市值排名靠前的 500 只股票组成，综合反映中国 A 股市场中一批中小市值公司的股票价格表现。本基金作为增强型的指数基金，一方面采用指数化被动投资以追求有效跟踪标的指数，另一方面采用量化模型调整投资组合力求超越标的指数表现。

上半年，新冠肺炎疫情在全球多点暴发，世界经济遭受重创，为应对严重的市场压力，多国政府和央行迅速采取了大刀阔斧的行动，推出了一揽子财政刺激计划和宽松货币政策。国内方面，面对新冠肺炎疫情带来的严峻考验和复杂多变的国内外环境，全国各地区统筹推进疫情防控和经济社会发展，在一系列政策作用下，疫情防控形势不断向好，复工复产、复商复市加快推进，上半年我国经济先降后升，2 季度经济增长由负转正，主要指标恢复性增长，整体经济稳步复苏态势明显。

市场方面，全球新冠疫情发展态势和复工复产推进情况是影响上半年 A 股走势的主要因素。年初受前期中美第一阶段经贸协议达成一致的影响，并叠加新一轮科技周期的预期，投资者情绪高涨，市场迎来明显的上涨。虽然春节期间疫情在国内率先暴发，但隔离政策成效显著，A 股节后开盘首日深度调整到位，随后延续了前期高涨的投资热情，形成 V 型反转走势。3 月以来，疫情在全球范围的蔓延加剧了市场对未来全球经济不确定性的担忧，投资者风险偏好显著降低，市场随之深度调整。但伴随海外疫情边际积极变化、国内疫情基本得到控制、复工复产稳步推进等多重积极信号下，过度悲观预期修正，市场信心明显得到提升，2 季度市场整体呈现出稳步上行的态势。

基金投资运作方面，本基金于 2020 年 3 月 25 日成立，基金管理人在建仓期内实施完成组合调

整，逐步实现仓位建立。报告期内，本基金以多因子量化投资策略为主，在控制基金与标的指数跟踪偏离度的基础上，力争获取更高的超额收益。同时，本基金秉承尽职尽责的态度，应对投资者日常申购、赎回等可能对基金带来收益冲击的工作。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2020 年 6 月 30 日，华夏中证 500 指数增强 A 基金份额净值为 1.1756 元，本报告期份额净值增长率为 17.56%；华夏中证 500 指数增强 C 基金份额净值为 1.1743 元，本报告期份额净值增长率为 17.43%，同期业绩比较基准增长率为 14.30%。本基金本报告期 A 类份额跟踪偏离度为+3.26%，C 类份额跟踪偏离度为+3.13%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，国内上半年经济稳步复苏为下半年持续恢复打下了较为坚实的基础；疫情期间催生了很多诸如远程办公、云计算、人工智能等新业态新模式，为经济回升继续提供有力支撑；财税金融以及就业支持方面的宏观政策效应将进一步显现。当前境外疫情仍在快速蔓延扩散，世界经济重启举步维艰，国内需求恢复仍将受到一定制约，稳企业、保就业仍面临较大压力，但总体来看，下半年以及下一阶段我国经济运行会继续维持向好的态势。

市场方面，由于经济景气确定性上行，盈利向上趋势确定，风险偏好易上难下，A 股市场整体胜率较高，预计下半年将呈现价值风格优于成长风格的局面。

投资策略上，我们将继续坚持量化投资的理念，基于量化模型，在控制组合风险的基础上，持续为投资者实现超越基准指数的超额回报。

珍惜基金份额持有人的每一分投资和每一份信任，本基金将继续奉行华夏基金管理有限公司“为信任奉献回报”的经营理念，规范运作，审慎投资，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求长期、稳定的回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及基金合同约定，本基金管理人为准确、及时进行基金估值和份额净值计价，制定了基金估值和份额净值计价的业务管理制度，建立了估值委员会，使用可靠的估值业务系统，设有完善的风险监测、控制和报告机制。本基金托管人审阅本基金管理人采用的估值原则及技术，并复核、审查基金资产净值和基金份额申购、赎回价格。会计师事务所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。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—华夏基金管理有限公司 2020 年 3 月 25 日至 2020 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，华夏基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，华夏基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§6 中期报告财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华夏中证 500 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日
----	-----	------------------------

资产：		
银行存款	6.4.7.1	19,263,634.73
结算备付金		6,346,968.02
存出保证金		1,491,947.82
交易性金融资产	6.4.7.2	229,594,546.14
其中：股票投资		229,389,901.92
基金投资		-
债券投资		204,644.22
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	4,000,000.00
应收证券清算款		-
应收利息	6.4.7.5	7,793.35
应收股利		-
应收申购款		7,874,164.55
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		268,579,054.61
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日
负债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		2,980,149.91
应付赎回款		6,340,064.84
应付管理人报酬		170,916.49
应付托管费		21,364.55
应付销售服务费		3,042.36
应付交易费用	6.4.7.7	1,040,346.02
应交税费		14,629.42
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	102,295.66
负债合计		10,672,809.25
所有者权益：		
实收基金	6.4.7.9	219,399,190.33

未分配利润	6.4.7.10	38,507,055.03
所有者权益合计		257,906,245.36
负债和所有者权益总计		268,579,054.61

注：①报告截止日 2020 年 6 月 30 日，华夏中证 500 指数增强 A 基金份额净值 1.1756 元，华夏中证 500 指数增强 C 基金份额净值 1.1743 元；华夏中证 500 指数增强基金份额总额 219,399,190.33 份（其中 A 类 210,387,044.77 份，C 类 9,012,145.56 份）。

②本基金合同于 2020 年 3 月 25 日生效，本报告期自 2020 年 3 月 25 日至 2020 年 6 月 30 日。

6.2 利润表

会计主体：华夏中证 500 指数增强型证券投资基金

本报告期：2020 年 3 月 25 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020 年 3 月 25 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		71,835,199.00
1.利息收入		241,327.32
其中：存款利息收入	6.4.7.11	241,068.05
债券利息收入		81.46
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		177.81
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		62,205,190.26
其中：股票投资收益	6.4.7.12	57,676,948.08
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	35,322.54
资产支持证券投资收益	6.4.7.14	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-
衍生工具收益	6.4.7.16	2,403,805.83
股利收益	6.4.7.17	2,089,113.81
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	9,127,081.76
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	261,599.66
减：二、费用		4,098,983.42
1.管理人报酬		940,046.20
2.托管费		117,505.75
3.销售服务费		9,479.91
4.交易费用	6.4.7.20	2,908,507.37

5.利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6.税金及附加		7,211.68
7.其他费用	6.4.7.21	116,232.51
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		67,736,215.58
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		67,736,215.58

注：本基金合同于 2020 年 3 月 25 日生效，本报告期自 2020 年 3 月 25 日至 2020 年 6 月 30 日。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华夏中证 500 指数增强型证券投资基金

本报告期：2020 年 3 月 25 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 3 月 25 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	716,719,322.76	-	716,719,322.76
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	67,736,215.58	67,736,215.58
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-497,320,132.43	-29,229,160.55	-526,549,292.98
其中：1.基金申购款	58,247,432.98	6,415,834.87	64,663,267.85
2.基金赎回款	-555,567,565.41	-35,644,995.42	-591,212,560.83
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	219,399,190.33	38,507,055.03	257,906,245.36

注：本基金合同于 2020 年 3 月 25 日生效，本报告期自 2020 年 3 月 25 日至 2020 年 6 月 30 日。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：杨明辉，主管会计工作负责人：朱威，会计机构负责人：朱威

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华夏中证 500 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[2019] 1666 号《关于准予华夏中证 500 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》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《华夏中证 500 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 2020 年 3 月 4 日至 2020 年 3 月 20 日共募集 716,388,490.71 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（2020）验字第 60739337_A19 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华夏中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》于 2020 年 3 月 25 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 716,719,322.76 份基金份额，其中认购资金利息折合 330,832.05 份基金份额。本基金的基金管理人为华夏基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

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(包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票)、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、公开发行的次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转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、国债期货、股票期权等)、货币市场工具(含同业存单)、资产支持证券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。在符合法律法规规定的情况下，本基金可以参与融资和转融通证券出借业务。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布和修订的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会发布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》和中国证监会、中国基金业协会允许的如财务报表附注 6.4.4 所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本会计报表的实际编制期间为 2020 年 3 月 25 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

1、金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金目前暂无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

2、金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债包括交易性金融负债及衍生金融负债等。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利、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，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及金融负债按照公允价值进行后续计量，应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

6.4.4.5 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。

6.4.4.6 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。

6.4.4.7 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。

6.4.4.8 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基金净值比例计算的金额。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基金净值比例计算的金额。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。

6.4.4.9 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。境内债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在适用情况下由债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利息收入。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利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除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利息收入。

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。

6.4.4.10 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。

6.4.4.11 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所有者权益转出。

6.4.4.12 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(可转换债券和私募债券除外)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《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度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(可转换债券和私募债券除外)，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。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

根据财税[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]103 号《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81 号《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]125 号《财政部、国家税务总局、证监会关于内地与香港基金互认有关税收政策的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《财政部、国家税务总局关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《财政部、国家税务总局关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发 教育辅助服务等增值

税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

（1）以发行基金方式募集资金不属于增值税征收范围，不征收增值税。

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

（3）基金买卖股票、债券的差价收入免征增值税，暂不征收企业所得税。

（4）存款利息收入不征收增值税。

（5）国债、地方政府债利息收入，金融同业往来利息收入免征增值税。

（6）对基金取得的债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

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

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

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

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

（11）本基金分别按实际缴纳的增值税额的 5%、3%、2% 缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
活期存款	19,263,634.73
定期存款	-
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	-
合计	19,263,634.73

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	220,635,624.38	229,389,901.92	8,754,277.54
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	204,644.22	18,044.22
	银行间市场	-	-
	合计	204,644.22	18,044.22
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	220,822,224.38	229,594,546.14	8,772,321.76

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 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	9,915,600.00	-	-	-
其中：股指期货	9,915,600.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	9,915,600.00	-	-	-

注：期货投资采用当日无负债结算制度，相关价值已包含在结算备付金中，具体投资情况详见

下表（买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示）：

代码	名称	持仓量 (买/卖) (单位: 手)	合约市值	公允价值变动	风险说明
IC2007	中证 500 股指期货 IC2007 合约	4	4,639,520.00	141,840.00	买入股指期货合约的目的是进行更有效地流动性管理，实现投资目标。
IC2009	中证 500 股指期货 IC2009 合约	4	4,531,520.00	194,880.00	买入股指期货合约的目的是进行更有效地流动性管理，实现投资目标。
IC2012	中证 500 股指期货 IC2012 合约	1	1,099,320.00	18,040.00	买入股指期货合约的目的是进行更有效地流动性管理，实现投资目标。
公允价值变动总额合计					354,760.00
股指期货投资本期收益					2,403,805.83
股指期货投资本期公允价值变动					354,760.00

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	4,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	4,000,000.00	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	3,859.54
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	3,761.80

应收债券利息	55.21
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	116.80
合计	7,793.35

6.4.7.6 其他资产

无。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	1,040,346.02
银行间市场应付交易费用	-
合计	1,040,346.02

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	168.48
应付证券出借违约金	-
预提费用	52,127.18
应付指数使用费	50,000.00
合计	102,295.66

6.4.7.9 实收基金

华夏中证 500 指数增强 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2020年3月25日（基金合同生效日）至2020年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	708,992,340.49	708,992,340.49
本期申购	52,947,988.23	52,947,988.23
本期赎回（以“-”号填列）	-551,553,283.95	-551,553,283.95
本期末	210,387,044.77	210,387,044.77

华夏中证 500 指数增强 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2020年3月25日（基金合同生效日）至2020年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	7,726,982.27	7,726,982.27
本期申购	5,299,444.75	5,299,444.75
本期赎回（以“-”号填列）	-4,014,281.46	-4,014,281.46
本期末	9,012,145.56	9,012,145.56

注：本基金在募集期间共募集有效净认购资金 716,388,490.71 元，根据本基金招募说明书的规定，认购资金在募集期间产生的利息 330,832.05 元在本基金合同生效后，折算为 330,832.05 份基金份额，计入基金份额持有人账户。

6.4.7.10 未分配利润

华夏中证 500 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
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	57,294,705.96	8,995,294.41	66,290,000.37
本期基金份额交易产生的变动数	-23,937,192.95	-5,416,879.55	-29,354,072.50
其中：基金申购款	5,714,259.82	236,258.29	5,950,518.11
基金赎回款	-29,651,452.77	-5,653,137.84	-35,304,590.61
本期已分配利润	-	-	-
本期末	33,357,513.01	3,578,414.86	36,935,927.87

华夏中证 500 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
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	1,314,427.86	131,787.35	1,446,215.21
本期基金份额交易产生的变动数	103,556.18	21,355.77	124,911.95
其中：基金申购款	450,136.19	15,180.57	465,316.76
基金赎回款	-346,580.01	6,175.20	-340,404.81
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,417,984.04	153,143.12	1,571,127.16

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 3 月 25 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30

	日
活期存款利息收入	194,735.91
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	45,594.33
其他	737.81
合计	241,068.05

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 3 月 25 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	1,377,459,272.53
减：卖出股票成本总额	1,319,782,324.45
买卖股票差价收入	57,676,948.08

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年3月25日（基金合同生效日）至2020年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	168,351.40
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	133,000.00
减：应收利息总额	28.86
买卖债券差价收入	35,322.54

6.4.7.14 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.15 贵金属投资收益

6.4.7.15.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.15.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.15.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.15.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.16 衍生工具收益

6.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年3月25日（基金合同生效日）至2020年6月30日
股指期货投资收益	2,403,805.83
合计	2,403,805.83

6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年3月25日（基金合同生效日）至2020年6月30日
股票投资产生的股利收益	2,089,113.81
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	2,089,113.81

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年3月25日（基金合同生效日）至2020年6月30日
1.交易性金融资产	8,772,321.76
——股票投资	8,754,277.54
——债券投资	18,044.22
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	354,760.00
——权证投资	-
——期货投资	354,760.00
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	9,127,081.76

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2020年3月25日（基金合同生效日）至2020年6月30日
基金赎回费收入	261,599.66
合计	261,599.66

6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年3月25日（基金合同生效日）至2020年6月30日
交易所市场交易费用	2,908,507.37
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	2,908,507.37

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年3月25日（基金合同生效日）至2020年6月30日
审计费用	17,375.40
信息披露费	34,751.78
证券出借违约金	-
银行费用	9,859.18
指数使用费	53,846.15
其他	400.00
合计	116,232.51

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华夏基金管理有限公司	基金管理人
中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”）	基金托管人
中信证券股份有限公司（“中信证券”）	基金管理人的股东

上海华夏财富投资管理有限公司（“华夏财富”）	基金管理人的子公司
中信证券华南股份有限公司（“中信证券（华南）”）	基金管理人股东控股的公司

注：①根据中信证券股份有限公司 2020 年 1 月 14 日发布的公告，经证监会广东监管局核准，广州证券股份有限公司已更名为中信证券华南股份有限公司。

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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

无。

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 债券交易

无。

6.4.10.1.4 债券回购交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020年3月25日（基金合同生效日）至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	940,046.20
其中：支付销售机构的客户维护费	626,365.82

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

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

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020年3月25日（基金合同生效日）至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	117,505.75

注：①支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值 0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

②基金托管费计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.10%/当年天数。

6.4.10.2.3 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 2020年3月25日（基金合同生效日）至2020年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华夏中证 500 指数增 强 A	华夏中证 500 指数增强 C	合计
华夏基金管理有限公司	-	5,189.38	5,189.38
华夏财富	-	190.62	190.62
中信证券（华南）	-	22.58	22.58
中信证券	-	4.62	4.62
合计	-	5,407.20	5,407.20

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

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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年3月25日（基金合同生效日）至2020年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国农业银行活期存款	19,263,634.73	194,735.91

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

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配事项。

6.4.12 期末（2020 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	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
688106	金宏气体	2020-06-09	2020-12-16	新发流通受限	15.48	41.36	15,347	237,571.56	634,751.92	-
688505	复旦张	2020-06-10	2020-12-21	新发流	8.95	24.78	17,673	158,173.35	437,936.94	-

	江			通受限						
688365	光云科技	2020-04-22	2020-10-29	新发流通受限	10.80	43.22	8,249	89,089.20	356,521.78	-
688568	中科星图	2020-06-30	2020-07-08	新发流通受限	16.21	16.21	10,675	173,041.75	173,041.75	-
688277	天智航	2020-06-24	2020-07-07	新发流通受限	12.04	12.04	8,810	106,072.40	106,072.40	-
688027	国盾量子	2020-06-30	2020-07-09	新发流通受限	36.18	36.18	2,830	102,389.40	102,389.40	-
688528	秦川物联	2020-06-19	2020-07-01	新发流通受限	11.33	11.33	8,337	94,458.21	94,458.21	-
688600	皖仪科技	2020-06-23	2020-07-03	新发流通受限	15.50	15.50	5,468	84,754.00	84,754.00	-
300847	中船汉光	2020-06-29	2020-07-09	新发流通受限	6.94	6.94	1,420	9,854.80	9,854.80	-

				限						
300845	捷安高科	2020-06-24	2020-07-03	新发流通受限	17.63	17.63	470	8,286.10	8,286.10	-
300843	胜蓝股份	2020-06-23	2020-07-02	新发流通受限	10.01	10.01	751	7,517.51	7,517.51	-
300840	酷特智能	2020-06-30	2020-07-08	新发流通受限	5.94	5.94	1,185	7,038.90	7,038.90	-

注：以上“可流通日”是根据上市公司公告估算的流通日期，最终日期以上市公司公告为准。

6.4.12.2 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（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
000662	*ST 天夏	2020-06-30	重大事项	2.48	2020-07-01	2.36	831,200	2,301,595.04	2,061,376.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的风险管理政策是使基金投资风险可测、可控、可承担。本基金管理人建立了由风险管

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

6.4.13.3 流动性风险

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

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

如遭遇极端市场情形或投资者非预期巨额赎回情形，基金管理人将采用本基金合同约定的赎回

申请处理方式及其他各类流动性风险管理工具，控制极端情况下的潜在流动性风险。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

本基金为指数增强型基金，以中证 500 指数为标的指数，基金股票投资方面将主要采用指数增强量化投资策略。因此，利率风险不是本基金的主要风险。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	229,389,901.92	88.94
交易性金融资产—基金投资	-	-
交易性金融资产—债券投资	204,644.22	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	229,594,546.14	89.02

注：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。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中证 500 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 2020 年 6 月 30 日
	+5%	10,112,388.45
	-5%	-10,112,388.45

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

（1）金融工具公允价值计量的方法

根据企业会计准则的相关规定，以公允价值计量的金融工具，其公允价值的计量可分为三个层次：

第一层次：对存在活跃市场报价的金融工具，可以相同资产/负债在活跃市场上的报价确定公允价值。

第二层次：对估值日活跃市场无报价的金融工具，可以类似资产/负债在活跃市场上的报价为依据做必要调整确定公允价值；对估值日不存在活跃市场的金融工具，可以相同或类似资产/负债在非活跃市场上的报价为依据做必要调整确定公允价值。

第三层次：对无法获得相同或类似资产可比市场交易价格的金融工具，可以其他反映市场参与者对资产/负债定价时所使用的参数为依据确定公允价值。

（2）各层次金融工具公允价值

截至 2020 年 6 月 30 日止，本基金持有的以公允价值计量的金融工具第一层次的余额为 228,165,335.50 元，第二层次的余额为 1,429,210.64 元，第三层次的余额为 0 元。

（3）公允价值所属层次间的重大变动

对于特殊事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)的股票，本基金将相关股票公允价值所属层次于其进行估值调整之日起从第一层次转入第二层次或第三层次，于股票复牌能体现公允价值并恢复市价估值之日起从第二层次或第三层次转入第一层次。对于持有的非公开发行股票，本基金于限售期内将相关股票公允价值所属层次列入第二层次，于限售期满并恢复市价估值之日起从第二层次转入第一层次。

（4）第三层次公允价值本期变动金额

本基金持有的以公允价值计量的金融工具第三层次公允价值本期未发生变动。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	229,389,901.92	85.41
	其中：股票	229,389,901.92	85.41
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	204,644.22	0.08
	其中：债券	204,644.22	0.08
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	4,000,000.00	1.49
	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	25,610,602.75	9.54
8	其他各项资产	9,373,905.72	3.49
9	合计	268,579,054.61	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

7.2.1.1 指数投资期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	8,680,486.00	3.37
C	制造业	96,999,333.27	37.61
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,442,417.69	1.33
E	建筑业	2,850,375.00	1.11
F	批发和零售业	10,340,224.40	4.01
G	交通运输、仓储和邮政业	6,984,202.00	2.71
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	13,359,041.31	5.18
J	金融业	17,481,561.05	6.78
K	房地产业	10,780,866.00	4.18
L	租赁和商务服务业	4,543,989.00	1.76
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	555,960.00	0.22
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	6,566,370.75	2.55
S	综合	-	-
	合计	182,584,826.47	70.80

7.2.1.2 积极投资期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	2,036,351.00	0.79
B	采矿业	-	-
C	制造业	29,678,542.10	11.51
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,766.32	0.00
E	建筑业	2,159,639.40	0.84
F	批发和零售业	-	-
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	6,969,071.63	2.70
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	3,712,812.00	1.44
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	182,993.00	0.07
S	综合	2,052,900.00	0.80
	合计	46,805,075.45	18.15

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	603444	吉比特	10,631	5,836,525.31	2.26
2	000739	普洛药业	227,800	5,305,462.00	2.06
3	600486	扬农化工	63,000	5,197,500.00	2.02
4	603338	浙江鼎力	66,118	5,009,760.86	1.94
5	603866	桃李面包	96,735	4,922,844.15	1.91

6	600639	浦东金桥	303,100	4,843,538.00	1.88
7	002818	富森美	369,430	4,543,989.00	1.76
8	002423	中粮资本	522,202	4,543,157.40	1.76
9	603816	顾家家居	94,400	4,248,944.00	1.65
10	603228	景旺电子	116,108	4,085,840.52	1.58
11	600908	无锡银行	780,900	3,834,219.00	1.49
12	603939	益丰药房	40,820	3,714,620.00	1.44
13	601811	新华文轩	327,500	3,330,675.00	1.29
14	300630	普利制药	44,700	3,305,565.00	1.28
15	600201	生物股份	111,100	3,093,024.00	1.20
16	002414	高德红外	98,860	2,894,620.80	1.12
17	000090	天健集团	412,500	2,850,375.00	1.11
18	600845	宝信软件	47,600	2,812,208.00	1.09
19	603233	大参林	34,020	2,763,104.40	1.07
20	601799	星宇股份	21,600	2,743,200.00	1.06
21	000547	航天发展	196,900	2,691,623.00	1.04
22	002557	洽洽食品	49,200	2,666,148.00	1.03
23	600325	华发股份	377,100	2,662,326.00	1.03
24	300357	我武生物	41,600	2,589,600.00	1.00
25	603328	依顿电子	245,000	2,555,350.00	0.99
26	600782	新钢股份	624,900	2,549,592.00	0.99
27	300296	利亚德	407,000	2,470,490.00	0.96
28	601179	中国西电	504,200	2,440,328.00	0.95
29	002583	海能达	318,700	2,418,933.00	0.94
30	600633	XD 浙数文	243,400	2,380,452.00	0.92
31	002203	海亮股份	268,700	2,351,125.00	0.91
32	600557	康缘药业	168,900	2,351,088.00	0.91
33	600901	江苏租赁	446,200	2,324,702.00	0.90
34	600339	中油工程	1,022,100	2,320,167.00	0.90
35	000975	银泰黄金	147,200	2,308,096.00	0.89
36	600823	世茂股份	510,900	2,283,723.00	0.89
37	603556	海兴电力	157,900	2,280,076.00	0.88
38	002670	国盛金控	248,000	2,269,200.00	0.88
39	600428	中远海特	721,900	2,223,452.00	0.86
40	002920	德赛西威	36,100	2,214,013.00	0.86
41	603885	吉祥航空	239,600	2,180,360.00	0.85
42	000898	鞍钢股份	886,500	2,171,925.00	0.84
43	601019	山东出版	340,631	2,128,943.75	0.83
44	600751	海航科技	677,300	2,119,949.00	0.82
45	600315	上海家化	44,200	2,117,180.00	0.82
46	600597	XD 光明乳	140,800	2,092,288.00	0.81
47	000543	皖能电力	500,600	2,012,412.00	0.78
48	300474	景嘉微	29,600	1,992,080.00	0.77

49	603025	大豪科技	260,414	1,893,209.78	0.73
50	002128	露天煤业	244,100	1,891,775.00	0.73
51	000937	冀中能源	617,700	1,865,454.00	0.72
52	000513	丽珠集团	34,000	1,632,340.00	0.63
53	600811	东方集团	335,600	1,483,352.00	0.58
54	600643	爱建集团	174,200	1,384,890.00	0.54
55	600125	铁龙物流	235,900	1,316,322.00	0.51
56	002138	顺络电子	52,400	1,307,380.00	0.51
57	600380	健康元	78,200	1,269,968.00	0.49
58	002901	大博医疗	10,400	1,240,616.00	0.48
59	600572	康恩贝	218,400	1,201,200.00	0.47
60	002353	杰瑞股份	37,800	1,171,800.00	0.45
61	000600	建投能源	229,341	1,167,345.69	0.45
62	002925	盈趣科技	20,000	1,158,800.00	0.45
63	000750	国海证券	263,900	1,145,326.00	0.44
64	002807	江阴银行	275,700	1,083,501.00	0.42
65	600216	浙江医药	54,600	1,051,596.00	0.41
66	601928	凤凰传媒	152,900	1,039,720.00	0.40
67	300285	国瓷材料	29,200	978,492.00	0.38
68	300166	东方国信	74,200	920,822.00	0.36
69	002831	裕同科技	30,715	844,969.65	0.33
70	000686	东北证券	97,497	823,849.65	0.32
71	000301	东方盛虹	123,600	687,216.00	0.27
72	002233	塔牌集团	55,100	662,853.00	0.26
73	300418	昆仑万维	26,400	658,944.00	0.26
74	600017	日照港	256,900	639,681.00	0.25
75	000807	云铝股份	142,500	621,300.00	0.24
76	601200	上海环境	46,330	555,960.00	0.22
77	002212	南洋股份	20,000	531,600.00	0.21
78	000718	苏宁环球	169,900	524,991.00	0.20
79	601333	广深铁路	230,000	517,500.00	0.20
80	002544	杰赛科技	36,600	481,290.00	0.19
81	300618	寒锐钴业	7,500	465,150.00	0.18
82	600657	信达地产	99,800	411,176.00	0.16
83	002434	万里扬	39,400	341,992.00	0.13
84	000623	吉林敖东	19,300	303,589.00	0.12
85	601958	金钼股份	43,700	270,066.00	0.10
86	300212	易华录	4,800	268,800.00	0.10
87	000598	兴蓉环境	57,100	262,660.00	0.10
88	002242	九阳股份	6,400	238,528.00	0.09
89	601869	长飞光纤	6,271	193,209.51	0.07
90	002152	广电运通	11,600	150,104.00	0.06
91	600704	物产中大	34,900	146,929.00	0.06

92	603056	德邦股份	7,900	106,887.00	0.04
93	000717	韶钢松山	24,300	92,340.00	0.04
94	600765	中航重机	7,200	73,584.00	0.03
95	000563	陕国投 A	19,600	72,716.00	0.03
96	000681	视觉中国	3,600	67,032.00	0.03
97	600582	天地科技	21,200	62,116.00	0.02
98	000078	海王生物	13,600	56,984.00	0.02
99	002416	爱施德	7,700	55,286.00	0.02
100	000402	金融街	8,300	55,112.00	0.02
101	600875	东方电气	4,800	42,480.00	0.02
102	600985	淮北矿业	3,200	24,928.00	0.01
103	600060	海信视像	2,000	24,300.00	0.01

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	300617	安靠智电	124,500.00	4,183,200.00	1.62
2	603200	上海洗霸	90,800.00	3,712,812.00	1.44
3	300588	熙菱信息	378,440.00	3,591,395.60	1.39
4	002950	奥美医疗	89,750.00	2,547,105.00	0.99
5	002532	新界泵业	287,800.00	2,288,010.00	0.89
6	300462	华铭智能	99,600.00	2,258,928.00	0.88
7	300715	凯伦股份	59,800.00	2,229,344.00	0.86
8	300445	康斯特	159,140.00	2,189,766.40	0.85
9	603955	大千生态	137,820.00	2,159,639.40	0.84
10	000662	天夏智慧	831,200.00	2,061,376.00	0.80
11	600455	博通股份	90,000.00	2,052,900.00	0.80
12	002679	福建金森	205,900.00	2,036,351.00	0.79
13	300155	安居宝	329,100.00	1,971,309.00	0.76
14	603041	美思德	113,900.00	1,571,820.00	0.61
15	603566	普莱柯	53,900.00	1,492,491.00	0.58
16	300584	海辰药业	54,200.00	1,370,176.00	0.53
17	002846	英联股份	74,500.00	1,244,150.00	0.48
18	603856	东宏股份	61,700.00	888,480.00	0.34
19	300690	双一科技	34,080.00	852,340.80	0.33
20	603189	网达软件	30,600.00	721,242.00	0.28
21	603158	腾龙股份	31,900.00	718,707.00	0.28
22	603666	亿嘉和	7,840.00	688,038.40	0.27
23	688106	金宏气体	15,347.00	634,751.92	0.25
24	300196	长海股份	46,500.00	491,970.00	0.19
25	688505	复旦张江	17,673.00	437,936.94	0.17
26	300689	澄天伟业	12,000.00	419,160.00	0.16

27	688365	光云科技	8,249.00	356,521.78	0.14
28	002861	瀛通通讯	9,800.00	267,246.00	0.10
29	603696	安记食品	13,800.00	198,996.00	0.08
30	603096	新经典	3,100.00	182,993.00	0.07
31	688568	中科星图	10,675.00	173,041.75	0.07
32	300162	雷曼光电	18,900.00	128,142.00	0.05
33	300695	兆丰股份	1,500.00	114,675.00	0.04
34	688277	天智航	8,810.00	106,072.40	0.04
35	688027	国盾量子	2,830.00	102,389.40	0.04
36	688528	秦川物联	8,337.00	94,458.21	0.04
37	688600	皖仪科技	5,468.00	84,754.00	0.03
38	300532	今天国际	6,392.00	57,208.40	0.02
39	300717	华信新材	3,300.00	49,434.00	0.02
40	300842	帝科股份	455.00	18,527.60	0.01
41	600956	新天绿能	2,533.00	12,766.32	0.00
42	300839	N 博汇	502.00	11,751.82	0.00
43	300847	中船汉光	1,420.00	9,854.80	0.00
44	300845	捷安高科	470.00	8,286.10	0.00
45	300843	胜蓝股份	751.00	7,517.51	0.00
46	300840	酷特智能	1,185.00	7,038.90	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例（%）
1	600338	西藏珠峰	14,038,805.40	5.44
2	603444	吉比特	13,943,576.92	5.41
3	600329	中新药业	13,654,932.61	5.29
4	300418	昆仑万维	13,500,111.32	5.23
5	002414	高德红外	13,127,846.00	5.09
6	002925	盈趣科技	13,101,478.00	5.08
7	002353	杰瑞股份	12,881,724.10	4.99
8	300207	欣旺达	12,497,964.00	4.85
9	603659	璞泰来	12,311,394.18	4.77
10	600266	城建发展	11,856,167.08	4.60
11	601019	山东出版	11,656,269.24	4.52
12	603707	健友股份	11,418,480.50	4.43
13	601799	星宇股份	11,216,977.24	4.35
14	601689	拓普集团	11,052,257.07	4.29
15	000761	本钢板材	10,999,163.00	4.26
16	300529	健帆生物	10,818,923.39	4.19
17	300552	万集科技	10,765,550.37	4.17

18	603198	迎驾贡酒	10,644,662.00	4.13
19	300324	旋极信息	10,591,049.87	4.11
20	002366	台海核电	10,582,020.26	4.10
21	603712	七一二	10,461,886.00	4.06
22	603939	益丰药房	10,257,064.70	3.98
23	600486	扬农化工	9,997,774.00	3.88
24	002065	东华软件	9,972,377.33	3.87
25	002387	维信诺	9,590,788.60	3.72
26	600557	康缘药业	9,218,387.00	3.57
27	603338	浙江鼎力	9,129,483.02	3.54
28	603233	大参林	9,094,431.47	3.53
29	002681	*ST 奋达	9,023,752.46	3.50
30	603885	吉祥航空	8,947,032.00	3.47
31	600216	浙江医药	8,822,227.20	3.42
32	603568	伟明环保	8,769,673.97	3.40
33	603883	老百姓	8,531,153.89	3.31
34	300297	蓝盾股份	8,507,285.97	3.30
35	002831	裕同科技	8,439,117.00	3.27
36	002812	恩捷股份	8,399,335.70	3.26
37	603355	莱克电气	8,300,999.24	3.22
38	600901	江苏租赁	8,285,041.71	3.21
39	002544	杰赛科技	8,256,474.00	3.20
40	002818	富森美	8,177,756.28	3.17
41	300072	三聚环保	8,138,931.10	3.16
42	600908	无锡银行	7,983,761.00	3.10
43	002635	安洁科技	7,962,351.00	3.09
44	300113	顺网科技	7,932,522.00	3.08
45	603866	桃李面包	7,921,048.68	3.07
46	002670	国盛金控	7,905,147.09	3.07
47	000686	东北证券	7,865,034.65	3.05
48	601811	新华文轩	7,695,020.87	2.98
49	002028	思源电气	7,613,273.00	2.95
50	002128	露天煤业	7,484,502.00	2.90
51	300012	华测检测	7,416,848.62	2.88
52	601333	广深铁路	7,380,631.00	2.86
53	002176	*ST 江特	7,245,102.40	2.81
54	603596	伯特利	7,199,272.00	2.79
55	600639	浦东金桥	7,199,033.00	2.79
56	600563	法拉电子	7,154,351.00	2.77
57	002482	广田集团	7,141,548.50	2.77
58	601100	恒立液压	7,047,383.14	2.73
59	300702	天宇股份	6,981,131.38	2.71
60	002920	德赛西威	6,958,618.10	2.70

61	601865	福莱特	6,930,363.24	2.69
62	000158	常山北明	6,883,072.41	2.67
63	300709	精研科技	6,824,023.00	2.65
64	000543	皖能电力	6,618,126.00	2.57
65	600339	中油工程	6,559,020.70	2.54
66	002416	爱施德	6,557,869.80	2.54
67	002371	北方华创	6,531,754.27	2.53
68	000090	天健集团	6,488,496.73	2.52
69	600779	水井坊	6,444,213.96	2.50
70	603556	海兴电力	6,434,463.10	2.49
71	000402	金 融 街	6,346,597.90	2.46
72	000825	太钢不锈	6,325,566.00	2.45
73	002064	华峰氨纶	6,275,286.00	2.43
74	600325	华发股份	6,215,600.00	2.41
75	002223	鱼跃医疗	6,161,714.00	2.39
76	300182	捷成股份	6,103,302.25	2.37
77	002049	紫光国微	6,102,209.14	2.37
78	603313	梦百合	6,095,241.10	2.36
79	002936	郑州银行	6,033,514.00	2.34
80	000937	冀中能源	6,017,906.00	2.33
81	002019	亿帆医药	6,010,430.00	2.33
82	300296	利亚德	5,978,208.00	2.32
83	002821	凯莱英	5,824,847.20	2.26
84	300316	晶盛机电	5,805,255.58	2.25
85	002500	山西证券	5,788,796.00	2.24
86	601872	招商轮船	5,776,320.54	2.24
87	300723	一品红	5,775,863.46	2.24
88	300285	国瓷材料	5,760,394.00	2.23
89	603238	诺邦股份	5,669,663.00	2.20
90	002212	南洋股份	5,645,385.00	2.19
91	603328	依顿电子	5,626,864.49	2.18
92	300532	今天国际	5,624,062.96	2.18
93	300546	雄帝科技	5,587,122.50	2.17
94	601200	上海环境	5,574,982.19	2.16
95	300588	熙菱信息	5,566,525.00	2.16
96	600845	宝信软件	5,565,236.91	2.16
97	002679	福建金森	5,549,900.19	2.15
98	002127	南极电商	5,514,024.10	2.14
99	600823	世茂股份	5,484,540.00	2.13
100	000662	*ST 天夏	5,418,180.99	2.10
101	300341	麦克奥迪	5,389,529.00	2.09
102	002368	太极股份	5,388,395.00	2.09
103	600862	中航高科	5,339,644.76	2.07

104	603378	亚士创能	5,194,295.32	2.01
-----	--------	------	--------------	------

注：“买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例（%）
1	600338	西藏珠峰	14,751,348.42	5.72
2	600329	中新药业	14,590,609.43	5.66
3	300418	昆仑万维	14,530,838.00	5.63
4	002925	盈趣科技	13,589,831.00	5.27
5	603659	璞泰来	13,394,682.04	5.19
6	601689	拓普集团	13,296,476.37	5.16
7	002353	杰瑞股份	13,213,095.82	5.12
8	300207	欣旺达	13,148,223.20	5.10
9	002414	高德红外	13,036,566.83	5.05
10	603707	健友股份	12,200,815.96	4.73
11	600266	城建发展	11,797,252.06	4.57
12	603198	迎驾贡酒	11,721,877.30	4.55
13	603712	七一二	11,588,520.35	4.49
14	300529	健帆生物	11,199,477.24	4.34
15	300552	万集科技	10,752,014.65	4.17
16	000761	本钢板材	10,613,169.00	4.12
17	300324	旋极信息	10,506,670.66	4.07
18	002387	维信诺	10,380,829.20	4.03
19	002065	东华软件	10,079,630.00	3.91
20	002812	恩捷股份	9,881,219.31	3.83
21	002366	台海核电	9,621,780.00	3.73
22	601799	星宇股份	9,398,251.00	3.64
23	603444	吉比特	9,347,019.73	3.62
24	601019	山东出版	9,164,054.91	3.55
25	002635	安洁科技	9,123,196.00	3.54
26	603883	老百姓	9,047,526.23	3.51
27	603568	伟明环保	8,722,722.27	3.38
28	002028	思源电气	8,600,255.58	3.33
29	603355	莱克电气	8,595,926.14	3.33
30	603233	大参林	8,475,589.77	3.29
31	002831	裕同科技	8,174,300.20	3.17
32	300072	三聚环保	8,173,635.66	3.17
33	300113	顺网科技	8,150,511.94	3.16
34	600557	康缘药业	8,032,909.33	3.11
35	300012	华测检测	7,965,972.19	3.09
36	300297	蓝盾股份	7,904,145.38	3.06

37	600563	法拉电子	7,869,194.08	3.05
38	601865	福莱特	7,829,103.74	3.04
39	603939	益丰药房	7,791,671.74	3.02
40	603596	伯特利	7,742,266.00	3.00
41	300702	天宇股份	7,665,867.87	2.97
42	300709	精研科技	7,578,405.36	2.94
43	600216	浙江医药	7,469,470.00	2.90
44	002544	杰赛科技	7,379,582.79	2.86
45	000158	常山北明	7,370,796.27	2.86
46	002681	*ST 奋达	7,239,976.13	2.81
47	601100	恒立液压	7,194,746.96	2.79
48	000686	东北证券	7,062,023.00	2.74
49	002371	北方华创	6,972,732.15	2.70
50	002416	爱施德	6,965,312.00	2.70
51	002064	华峰氨纶	6,899,997.58	2.68
52	002482	广田集团	6,894,612.41	2.67
53	603313	梦百合	6,836,776.59	2.65
54	600779	水井坊	6,797,257.68	2.64
55	002223	鱼跃医疗	6,761,289.94	2.62
56	002049	紫光国微	6,740,711.62	2.61
57	601333	广深铁路	6,526,310.15	2.53
58	002019	亿帆医药	6,515,712.00	2.53
59	300182	捷成股份	6,502,337.42	2.52
60	002821	凯莱英	6,485,753.00	2.51
61	603885	吉祥航空	6,439,593.40	2.50
62	000825	太钢不锈	6,357,092.00	2.46
63	000402	金融街	6,292,181.51	2.44
64	002127	南极电商	6,249,829.58	2.42
65	002156	通富微电	6,074,161.00	2.36
66	600901	江苏租赁	6,062,617.00	2.35
67	002936	郑州银行	5,985,712.00	2.32
68	002250	联化科技	5,960,387.00	2.31
69	600862	中航高科	5,933,645.00	2.30
70	300316	晶盛机电	5,887,681.24	2.28
71	300285	国瓷材料	5,883,559.00	2.28
72	002128	露天煤业	5,871,875.46	2.28
73	002176	*ST 江特	5,775,875.00	2.24
74	300341	麦克奥迪	5,743,777.00	2.23
75	300546	雄帝科技	5,741,284.00	2.23
76	601872	招商轮船	5,714,583.00	2.22
77	300723	一品红	5,615,463.38	2.18
78	600298	安琪酵母	5,542,672.00	2.15
79	002500	山西证券	5,507,458.00	2.14

80	603650	彤程新材	5,501,216.81	2.13
81	002368	太极股份	5,484,088.94	2.13
82	600132	重庆啤酒	5,468,401.65	2.12
83	002920	德赛西威	5,441,200.00	2.11
84	603378	亚士创能	5,399,731.00	2.09
85	603238	诺邦股份	5,364,297.00	2.08
86	002670	国盛金控	5,341,176.00	2.07
87	600486	扬农化工	5,340,722.73	2.07
88	002212	南洋股份	5,332,070.85	2.07
89	300532	今天国际	5,216,972.60	2.02

注：“卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,540,417,948.83
卖出股票收入（成交）总额	1,377,459,272.53

注：“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

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）	204,644.22	0.08
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	204,644.22	0.08

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

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	123051	今天转债	1,866	204,644.22	0.08
2	-	-	-	-	-

3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量	合约市值	公允价值变动	风险说明
IC2007	中证 500 股指期货 IC2007 合约	4	4,639,520.00	141,840.00	买入股指期货合约的目的是进行更有效地流动性管理，实现投资目标。
IC2009	中证 500 股指期货 IC2009 合约	4	4,531,520.00	194,880.00	买入股指期货合约的目的是进行更有效地流动性管理，实现投资目标。
IC2012	中证 500 股指期货 IC2012 合约	1	1,099,320.00	18,040.00	买入股指期货合约的目的是进行更有效地流动性管理，实现投资目标。
公允价值变动总额合计					354,760.00
股指期货投资本期收益					2,403,805.83
股指期货投资本期公允价值变动					354,760.00

7.10.2 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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末无国债期货投资。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无国债期货投资。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货投资。

7.12 投资组合报告附注

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

7.12.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,491,947.82
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	7,793.35
5	应收申购款	7,874,164.55
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,373,905.72

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份	持有份额	占总份

				额比例		额比例
华夏中证 500 指数增强 A	5,185	40,576.09	20,000,111.11	9.51%	190,386,933.66	90.49%
华夏中证 500 指数增强 C	4,869	1,850.92	173.51	0.00%	9,011,972.05	100.00%
合计	10,054	21,822.08	20,000,284.62	9.12%	199,398,905.71	90.88%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	华夏中证 500 指数增强 A	96,893.37	0.05%
	华夏中证 500 指数增强 C	5,319.55	0.06%
	合计	102,212.92	0.05%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	华夏中证 500 指数增强 A	0
	华夏中证 500 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 500 指数增强 A	0
	华夏中证 500 指数增强 C	0~10
	合计	0~10

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华夏中证 500 指数增强 A	华夏中证 500 指数增强 C
基金合同生效日（2020 年 3 月 25 日）基金份额总额	708,992,340.49	7,726,982.27
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	52,947,988.23	5,299,444.75
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	551,553,283.95	4,014,281.46
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	210,387,044.77	9,012,145.56

注：本基金合同于 2020 年 3 月 25 日生效。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金管理人于 2020 年 4 月 1 日发布公告，张德根先生担任华夏基金管理有限公司副总经理。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金所聘用的会计师事务所未发生改变。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人报告期内收到北京证监局有关责令改正的行政监管措施，公司已按要求改正并报告。

本报告期内托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	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	
方正证券	2	1,869,232,084.89	64.12%	806,190.91	64.12%	-
东吴证券	2	660,224,543.10	22.65%	284,770.47	22.65%	-
国信证券	2	385,811,718.48	13.23%	166,403.43	13.23%	-

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，在近一年内无重大违规行为。

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 有较强的研究能力，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。

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 对交易单元候选券商的研究服务进行评估

本基金管理人组织相关人员依据交易单元选择标准对交易单元候选券商的服务质量和研究实力进行评估，确定选用交易单元的券商。

ii 协议签署及通知托管人

本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。

③本基金合同于 2020 年 3 月 25 日生效，除本表列示外，本基金还选择了安信证券、渤海证券、财信证券、长城证券、长江证券、东北证券、高华证券、光大证券、广发证券、国泰君安证券、海通证券、华创证券、华泰证券、华西证券、申万宏源西部证券、申万宏源证券、西部证券、新时代证券、粤开证券、中国银河证券、中泰证券、中信建投证券、中银国际证券的交易单元作为本基金交易单元，本报告期无股票交易及应付佣金。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例
方正证券	-	-	-	-
东吴证券	168,351.40	100.00%	5,000,000.00	100.00%
国信证券	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华夏基金管理有限公司关于旗下公募基金 2019 年年报延缓审计与披露的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-03-26
2	华夏中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同生效公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-03-26
3	华夏基金管理有限公司公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-04-01
4	华夏基金管理有限公司关于限制华夏中证 500 指数增强型证券投资基金申购、定期定额申购业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-04-14
5	华夏中证 500 指数增强型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换、定期定额申购业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-04-14

6	华夏基金管理有限公司关于增聘华夏中证 500 指数增强型证券投资基金基金经理的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-04-18
7	华夏基金管理有限公司关于调整华夏中证 500 指数增强型证券投资基金申购、定期定额申购业务上限的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-06-18

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予基金注册的文件；
- 2、《华夏中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》；
- 3、《华夏中证 500 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。

12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

12.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的住所免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

华夏基金管理有限公司

二〇二〇年八月二十九日