

华夏中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
2026 年中期报告
2026 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：中国建设银行股份有限公司

送出日期：二〇二六年八月三十一日

§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。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 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 2026 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	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	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
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	15
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	15
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	15
§6 中期报告财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表	16
6.2 利润表	17
6.3 净资产变动表	19
6.4 报表附注	20
§7 投资组合报告	47
7.1 期末基金资产组合情况	47
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	47
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细	48
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	67
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	68
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	69
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	69
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	69
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	69
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	69
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	69
7.12 本报告期投资基金情况	70
7.13 投资组合报告附注	70

§8 基金份额持有人信息	70
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	70
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	71
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情况	71
§9 开放式基金份额变动	71
§10 重大事件揭示	71
10.1 基金份额持有人大会决议	71
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	71
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	71
10.4 基金投资策略的改变	72
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	72
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	72
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	72
10.8 其他重大事件	74
§11 影响投资者决策的其他重要信息	74
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	74
§12 备查文件目录	75
12.1 备查文件目录	75
12.2 存放地点	75
12.3 查阅方式	75

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华夏中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	华夏中证 500ETF
场内简称	中证 500（扩位证券简称：中证 500ETF 华夏）
基金主代码	512500
交易代码	512500
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2015 年 5 月 5 日
基金管理人	华夏基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,559,208,794 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2015 年 5 月 29 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	主要投资策略包括组合复制策略、替代性策略、存托凭证投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略等。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为“中证 500 指数”。
风险收益特征	本基金属于股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股，在股票基金中属于较高风险、较高收益的产品。

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	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李彬	王小飞
	联系电话	400-818-6666	021-6063 7103
	电子邮箱	service@ChinaAMC.com	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		400-818-6666	021-60637228
传真		010-63136700	021-60635778

注册地址	北京市顺义区安庆大街甲3号院	北京市西城区金融大街25号
办公地址	北京市朝阳区北辰西路6号院北辰中心C座5层	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码	100101	100033
法定代表人	邹迎光	张金良

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.ChinaAMC.com
基金中期报告置备地点	基金管理人和/或基金托管人的住所/办公地址

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号
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（2026 年 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	4,989,984,804.11
本期利润	3,070,563,735.67
加权平均基金份额本期利润	1.0339
本期加权平均净值利润率	22.49%
本期基金份额净值增长率	22.39%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2026年6月30日）
期末可供分配利润	828,539,180.63
期末可供分配基金份额利润	0.5314
期末基金资产净值	7,951,891,846.81
期末基金份额净值	5.1000
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2026年6月30日）
基金份额累计净值增长率	11.64%

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

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

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

④基金管理人以 2015 年 5 月 22 日为基金份额折算日对本基金进行了份额折算，折算结果详情请参见 2015 年 5 月 26 日发布的《华夏基金管理有限公司关于华夏中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金份额折算结果的公告》。

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

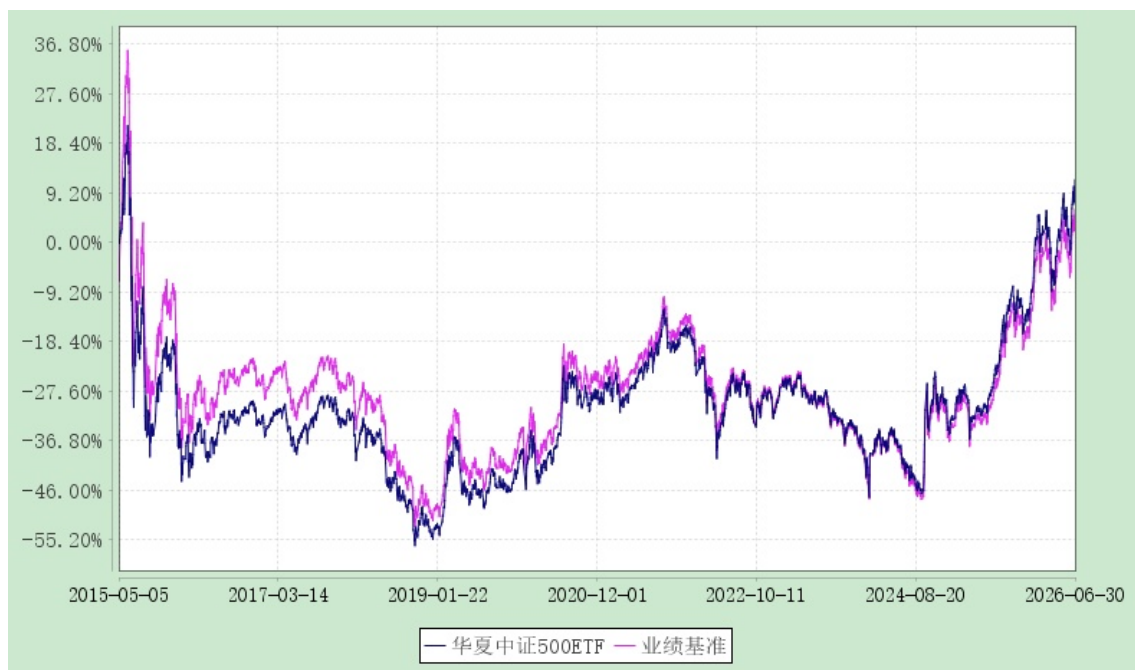
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	19.90%	1.64%	18.56%	1.65%	1.34%	-0.01%
过去六个月	22.39%	1.66%	20.97%	1.66%	1.42%	0.00%
过去一年	55.78%	1.42%	52.68%	1.42%	3.10%	0.00%
过去三年	57.72%	1.48%	50.55%	1.49%	7.17%	-0.01%
过去五年	43.79%	1.36%	32.65%	1.36%	11.14%	0.00%
过去七年	105.94%	1.36%	82.43%	1.36%	23.51%	0.00%
过去十年	72.75%	1.34%	47.49%	1.35%	25.26%	-0.01%
自基金合同生效起至今	11.64%	1.57%	6.12%	1.60%	5.52%	-0.03%

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

华夏中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

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

（2015 年 5 月 5 日至 2026 年 6 月 30 日）



§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、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、首批浮动管理费基金管理人、首批公募 REITs 指数基金管理人，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 ETF 基金资产管理规模最大的基金管理公司之一，在 ETF 基金管理方面积累了丰富的经验，形成了覆盖宽基指数、港股（QDII）指数、港股（港股通）指数、行业主题指数、策略指数、跨境指数、固收指数、商品指数等较为完整的产品线。

华夏基金以深入的投资研究为基础，尽力捕捉市场机会，为投资人谋求良好的回报。根据银河证券基金研究中心《中国基金业绩评价报告》，截至 2026 年 6 月 30 日，华夏基金旗下多只产品近 1 年同类排名靠前（基金排名不作为产品未来表现的保证）：

主动权益产品：在混合型 FOF(权益资产 30%-60%)(A 类)中，华夏聚源优选三个月持有混合（FOF）(A 类)排名第 1/25；在低碳环保行业股票型基金(A 类)中，华夏节能环保股票(A 类)排名第 1/10；在 TMT 与信息技术行业偏股型基金(A 类)中，华夏数字产业混合(A 类)排名第 2/64；在低碳环保偏股型基金(A 类)中，华夏低碳经济一年持有混合(A 类)排名第 3/32；在债券型 FOF(A 类)中，华夏聚顺优选六个月持有债券（FOF）(A 类)排名第 3/24；在养老目标日期 FOF(2045)(A 类)中，华夏养老 2045 三年持有混合（FOF）(A 类)排名第 3/18；在养老目标日期 FOF(2050)(A 类)中，华夏养老 2050 五年持有混合（FOF）(A 类)排名第 3/15；在 QDII 混合基金(A 类)中，华夏移动互联混合（QDII）排名第 3/56、华夏新时代混合（QDII）排名第 5/56、华夏全球科技先锋混合（QDII）排名第 7/56；在偏股型基金(股票上限 80%)(A 类)中，华夏成长混合排名第 13/149；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 15/89；在偏股型基金(股票上限 95%)(A 类)中，华夏线上经济主题精选混合排名第 25/220；在标准股票型基金(A 类)中，华夏创新前沿股票(A 类)排名第 43/354、华夏领先股票排名第 49/354、华夏经济转型股票排名第 57/354、华夏潜龙精选股票排名第 66/354；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 35/397、华夏新锦程混合(A 类)排名第 62/397、华夏稳增混合排名第 79/397；在灵活配置型基金(基准股票比例 60%-100%)(A 类)中，华夏高端制造混合(A 类)排名第 36/478；在偏股型基金(股票上下限 60%-95%)(A 类)中，华夏先进制造龙头混合(A 类)排名第 23/1941、华夏科技创新混合(A 类)排名第 78/1941、华夏成长先锋一年持有混合(A 类)排名第 116/1941、华夏核心科技 6 个月定开混合(A 类)排名第 191/1941、华夏产业升级混合(A 类)排名第 212/1941、华夏国企创新混合发起式（A 类）排名第 249/1941、华夏成长机会一年持有混合排名第 268/1941、华夏创业板两年定开混合排名第 276/1941、华夏盛世混合排名第 292/1941、华夏创新驱动混合(A 类)排名第 365/1941、华夏科技前沿 6 个月定开混合(A 类)排名第 372/1941、华夏行业景气混合(A 类)排名第 374/1941。

固收与固收+产品：在可转换债券型基金(A 类)中，华夏可转债增强债券 A 排名第 1/38；在普通债券型基金(可投转债)(A 类)中，华夏双债债券 A 排名第 1/280、华夏聚利债券 A 排名第 4/280、华夏债券 AB 排名第 74/280；在普通偏债型基金(股票上限不高于 30%)(A 类)中，华夏永康添福混合 A 排名第 2/307、华夏兴源稳健一年持有混合 A 排名第 17/307、华夏永顺一年持有混合 A 排名第 31/307；在短期纯债债券型基金(A 类)中，华夏安益短债债券 A 排名第 7/133、华夏 30 天滚动短债债券发起式 A 排名第 8/133；在利率债纯债债券型基金(A 类)中，华夏鼎昭利率债债券 A 排名第 7/98；

在普通债券型基金(二级)(A 类)中, 华夏鼎沛债券 A 排名第 10/540、华夏鼎清债券 A 排名第 12/540、华夏鼎利债券 A 排名第 47/540; 在普通偏债型基金(股票上限高于 30%)(A 类)中, 华夏永鑫六个月持有混合 A 排名第 17/245、华夏永泓一年持有混合 A 排名第 28/245; 在长期纯债债券型基金(A 类)中, 华夏鼎富债券 A 排名第 61/1041、华夏鼎航债券 A 排名第 67/1041、华夏鼎信债券 A 排名第 115/1041、华夏纯债债券 A 排名第 234/1041、华夏鼎茂债券 A 排名第 268/1041; 在标准偏债型基金(股票上下限 10%-30%)(A 类)中, 华夏稳进增益一年持有混合 A 排名第 11/71。

在客户服务方面, 2026 年上半年, 华夏基金继续以客户需求为导向, 努力提高客户使用的便利性和服务体验: (1) 华夏基金管家客户端优化基金详情展示, 增强信息可读性, 从客户投资需求出发, 进一步提升使用体验; (2) 与国贸期货、新华信通等代销机构合作, 拓展更加丰富的客户理财渠道; (3) 开展“未来, 我们继续一起走过”、“选择难度大? 给你支个招”、“当前科技股的三国博弈”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		
荣膺	本基金的基金经理、投委会成员	2016-10-20	-	16 年	硕士。2010 年 7 月加入华夏基金管理有限公司。历任研究发展部高级产品经理, 数量投资部研究员、投资经理、基金经理助理, 华夏中证央企结构调整交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理 (2018 年 11 月 14 日至 2021 年 10 月 21 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(2016 年 10 月 20 日至 2018 年 9 月 16 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 (2016 年 10 月 20 日至 2018 年 9 月 16 日期间)、上证主要消费交易型开放式指数发起式证券投资基金基金经理(2015 年 11 月 6 日至 2020 年 3 月 18 日期间)、华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金基金经理(2018 年 3 月 6 日至 2020 年 3 月 18 日期间)、华夏 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金经理 (2018 年 9 月 17 日至 2021 年 10 月 21 日期间)、华夏 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理 (2018 年 9 月 17 日至
--	--	--	--	--	---

					2021 年 10 月 21 日期间)、华夏创业板低波价值交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理 (2019 年 6 月 26 日至 2021 年 10 月 21 日期间)、华夏沪港通上证 50AH 优选指数证券投资基金 (LOF) 基金经理 (2016 年 10 月 27 日至 2022 年 8 月 22 日期间)、华夏创业板动量成长交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理(2019 年 6 月 26 日至 2022 年 8 月 22 日期间)、华夏饲料豆粕期货交易型开放式证券投资基金发起式联接基金基金经理 (2020 年 1 月 13 日至 2022 年 8 月 22 日期间)、华夏粤港澳大湾区创新 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理 (2020 年 2
--	--	--	--	--	--

					月 25 日至 2022 年 8 月 22 日期间)、华夏粤港澳大湾区创新 100 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理 (2020 年 4 月 29 日至 2022 年 8 月 22 日期间)等。
--	--	--	--	--	--

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《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，本基金管理人旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 45 次，均为指数量化投资组合因投资策略需要发生的反向交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金跟踪的标的指数为中证 500 指数，中证 500 指数成份股是在扣除沪深 300 指数样本股及最近一年日均总市值排名前 300 名的股票后，选取成交金额及日均总市值排名在前 500 名的股票，中证 500 指数综合反映中国 A 股市场中一批中小市值公司的股票价格表现。本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。

上半年，国内 GDP 同比增长 4.7%，CPI 持续正增长，PPI 同比由负转正。结构分化，冷热不均。人工智能为代表的高科技产业利润爆发式增长，传统行业如房地产低位运行，汽车行业利润有所下滑。各类资产表现共同反映了这种分化。长债超长债几乎呈现单边震荡走牛的趋势，主要交易内需及传统行业的预期。股票在一季度流动性主导的跨年春季行情里几乎普涨，但二季度更贴近基本面之后开始分化，通信半导体为代表的人工智能产业表现优异，诸多与内需相关的传统行业表现不佳。市场赚钱效应分化，个股投资难度增大。

基金投资运作方面，作为被动指数基金，本基金主要采取复制指数的投资策略，报告期内，本基金在做好跟踪标的指数的基础上，认真应对投资者日常申购、赎回和成份股调整等工作。

为促进本基金的市场流动性和平稳运行，经上海证券交易所同意，部分证券公司被确认为本基金的流动性服务商。目前，本基金的流动性服务商包括东方财富证券股份有限公司、东方证券股份有限公司、东莞证券股份有限公司、东海证券股份有限公司、方正证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、国金证券股份有限公司、国泰海通证券股份有限公司、国投证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、申万宏源证券有限公司、西部证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、浙商证券股份有限公司、中国国际金融股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、财通证券股份有限公司、长江证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、华安证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司等。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2026 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 5.1000 元，本报告期份额净值增长率为 22.39%，同期业绩比较基准增长率 20.97%。本基金本报告期跟踪偏离度为+1.42%，与业绩比较基准产生偏离的主要原因为日常运作费用、指数结构调整、申购赎回、成份股分红等产生的差异。

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，宏观经济有望完成“十五五”开局之年的既定目标，总量经济平稳有助于稳住权益资产基本盘。人工智能及其应用依旧是市场最需要关注的方向，尤其是人工智能应用层面是否会出现现象级爆款。需要留意的是人工智能方向的交易拥挤度。非人工智能方向有同样很多值得关注

的行业，像新能源、创新药、券商、红利等。事件方面，关注 11 月深圳 APEC 峰会，年底中美元首会晤，以及美国在四季度中期选举之后的政策连贯性。

本基金将会根据基金合同要求，在紧密跟踪标的指数的基础上，做好相关投资工作。

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

本基金本报告期未进行利润分配，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

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

§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 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	104,667,650.06	61,001,886.44
结算备付金		70,997,240.78	220,801,792.17
存出保证金		27,126,197.66	36,135,087.23
交易性金融资产	6.4.7.2	7,749,588,125.13	17,776,658,592.98
其中：股票投资		7,748,174,070.47	17,774,743,563.60
基金投资		-	-
债券投资		1,414,054.66	1,915,029.38
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		34,979,800.71	50,523,390.44
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		7,987,359,014.34	18,145,120,749.26
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 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		-	-
应付清算款		12,291,483.42	31,581,292.76
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		938,447.10	2,157,323.89
应付托管费		312,815.70	719,107.97
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		10,824.89	327,839.51
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	21,913,596.42	25,515,226.13
负债合计		35,467,167.53	60,300,790.26
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	7,123,352,666.18	19,827,628,819.06
未分配利润	6.4.7.8	828,539,180.63	-1,742,808,860.06
净资产合计		7,951,891,846.81	18,084,819,959.00
负债和净资产总计		7,987,359,014.34	18,145,120,749.26

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额净值 5.1000 元，基金份额总额 1,559,208,794.00 份。

6.2 利润表

会计主体：华夏中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		3,084,502,540.18	655,858,453.56
1.利息收入		1,184,225.80	654,313.39

其中：存款利息收入	6.4.7.9	1,184,225.80	654,313.39
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）		4,994,161,204.50	523,363,808.50
其中：股票投资收益	6.4.7.10	4,878,687,357.68	404,431,148.21
基金投资收益	6.4.7.11	-	-
债券投资收益	6.4.7.12	868,465.82	821,674.63
资产支持证券投资收益	6.4.7.13	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	62,886,823.16	-694,340.44
股利收益	6.4.7.16	51,718,557.84	118,805,326.10
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-1,919,421,068.44	127,874,090.17
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	8,578,178.32	3,966,241.50
减：二、营业总支出		13,938,804.51	13,849,563.36
1.管理人报酬		10,208,422.28	9,613,299.23
2.托管费		3,402,807.43	3,204,433.06
3.销售服务费		-	-
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.信用减值损失	6.4.7.20	-	-
7.税金及附加		226,461.29	21,975.73
8.其他费用	6.4.7.21	101,113.51	1,009,855.34
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		3,070,563,735.67	642,008,890.20
减：所得税费用		-	-

四、净利润(净亏损以“-”号填列)		3,070,563,735.67	642,008,890.20
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		3,070,563,735.67	642,008,890.20

6.3 净资产变动表

会计主体：华夏中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	19,827,628,819.06	-1,742,808,860.06	18,084,819,959.00
二、本期期初净资产	19,827,628,819.06	-1,742,808,860.06	18,084,819,959.00
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-12,704,276,152.88	2,571,348,040.69	-10,132,928,112.19
（一）、综合收益总额	-	3,070,563,735.67	3,070,563,735.67
（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）	-12,704,276,152.88	-499,215,694.98	-13,203,491,847.86
其中：1.基金申购款	8,051,645,673.62	59,815,578.67	8,111,461,252.29
2.基金赎回款	-20,755,921,826.50	-559,031,273.65	-21,314,953,100.15
（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	7,123,352,666.18	828,539,180.63	7,951,891,846.81
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	19,860,522,515.61	-6,218,542,591.25	13,641,979,924.36
二、本期期初净资产	19,860,522,515.61	-6,218,542,591.25	13,641,979,924.36
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-1,505,800,282.29	1,016,508,672.75	-489,291,609.54
（一）、综合收益总额	-	642,008,890.20	642,008,890.20
（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）	-1,505,800,282.29	374,499,782.55	-1,131,300,499.74

其中：1.基金申购款	6,604,323,073.56	-2,052,131,509.14	4,552,191,564.42
2.基金赎回款	-8,110,123,355.85	2,426,631,291.69	-5,683,492,064.16
（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	18,354,722,233.32	-5,202,033,918.50	13,152,688,314.82

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：邹迎光，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 交易型开放式指数证券投资基金（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[2015]113 号《关于准予华夏中证 500 交易型开放式指数证券投资基金及联接基金注册的批复》，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 交易型开放式指数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。本基金为交易型开放式，存续期限为不定期。本基金自 2015 年 4 月 8 日至 2015 年 4 月 28 日期间共募集 2,134,343,230 元（不含认购资金利息），业经德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）德师报（验）字（15）第 0537 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华夏中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2015 年 5 月 5 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 2,134,473,505 份基金份额，其中认购资金利息折合 130,275 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，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《华夏中证 500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》，基金管理人华夏基金管理有限公司确定 2015 年 5 月 22 日为基金份额折算日，折算后的基金份额净值与 2015 年 5 月 22 日中证 500 指数收盘值的两千万分之一基本一致。折算前基金份额总额为 2,134,473,505 份，本次基金份额折算比例为 0.21889230，折算后基金份额总额为 467,208,794 份。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华夏中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股、替代性股票。为更好地实现投资目标，基金还可投资于非成份股、债券（含中小企业私募债券）、股指期货、国债期货、权证、货币市场工具、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。本基金投资范围中的股票包含存托凭证。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布和修订的《企业会计准则——基本准则》、各项具体会计准则(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《公开募集证券投资基金信息披露内容与格式准则第 2 号——定期报告的内容与格式》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的《公开募集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》编制,同时在信息披露方面也参考了中国证监会、中国基金业协会发布的基金行业实务操作的其他有关规定。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

根据财税[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]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[2023]39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财政部税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、中华人民共和国主席令第四十

一号《中华人民共和国增值税法》、中华人民共和国国务院令第 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》及财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税交易，资管产品管理人为纳税人。自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3% 的规定征收率计算缴纳增值税。

(2) 自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，对公募证券投资基金（封闭式证券投资基金、开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入免征增值税；对证券投资基金从证券市场中取得的买卖股票、债券的差价收入，暂不征收企业所得税。

(3) 存款利息收入不征收增值税。

(4) 自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，金融同业往来利息收入免征增值税。

(5) 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。

(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附加。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	104,667,650.06
等于：本金	104,657,236.47
加：应计利息	10,413.59
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	104,667,650.06

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	6,549,363,441.14	-	7,748,174,070.47	1,198,810,629.33
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债 交易所市场	1,414,000.00	54.66	1,414,054.66	-

券	银行间市场	-	-	-	-
	合计	1,414,000.00	54.66	1,414,054.66	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		6,550,777,441.14	54.66	7,749,588,125.13	1,198,810,629.33

注：①股票投资的估值增值和股票投资的公允价值均包含可退替代款的估值增值。

②股票投资的成本、公允价值及公允价值变动均包含中国存托凭证的成本、公允价值及公允价值变动。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2026 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	183,638,698.46	-	-	-
其中：股指期货	183,638,698.46	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	183,638,698.46	-	-	-

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IC2609	中证 500 期货 IC2609 合约	99	173,475,720.00	7,631,400.00
IC2607	中证 500 期货 IC2607 合约	11	19,642,040.00	1,847,661.54
合计	-	-	-	9,479,061.54
减：可抵销期货暂收	-	-	-	9,479,061.54

款				
净额	-	-	-	-

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

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 其他资产

无。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	2,182,998.25
其中：交易所市场	2,182,998.25
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	171,699.25
可退替代款	1,072,359.51
应退替代款	18,486,539.41
合计	21,913,596.42

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
----	---------------------------------------

	基金份额（份）	账面金额
上年度末	4,340,008,794.00	19,827,628,819.06
本期申购	1,762,400,000.00	8,051,645,673.62
本期赎回（以“-”号填列）	-4,543,200,000.00	-20,755,921,826.50
本期末	1,559,208,794.00	7,123,352,666.18

注：①申购含红利再投（如有）、转换入份额（如有），赎回含转换出份额（如有）。

②基金管理人以 2015 年 5 月 22 日为基金份额折算日对本基金进行了份额折算，折算结果详情请参见 2015 年 5 月 26 日发布的《华夏基金管理有限公司关于华夏中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金份额折算结果的公告》。

6.4.7.8 未分配利润

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	2,003,487,018.29	-3,746,295,878.35	-1,742,808,860.06
本期期初	2,003,487,018.29	-3,746,295,878.35	-1,742,808,860.06
本期利润	4,989,984,804.11	-1,919,421,068.44	3,070,563,735.67
本期基金份额交易产生的变动数	-3,321,681,417.59	2,822,465,722.61	-499,215,694.98
其中：基金申购款	2,314,375,233.02	-2,254,559,654.35	59,815,578.67
基金赎回款	-5,636,056,650.61	5,077,025,376.96	-559,031,273.65
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,671,790,404.81	-2,843,251,224.18	828,539,180.63

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	97,573.43
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	1,082,330.23
其他	4,322.14
合计	1,184,225.80

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	3,256,442,740.78
股票投资收益——赎回差价收入	1,622,244,616.90
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	4,878,687,357.68

6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	14,652,916,342.59
减：卖出股票成本总额	11,385,506,451.56
减：交易费用	10,967,150.25
买卖股票差价收入	3,256,442,740.78

6.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	21,314,953,100.15
减：现金支付赎回款总额	11,322,626,788.12
减：赎回股票成本总额	8,370,081,695.13
减：交易费用	-
赎回差价收入	1,622,244,616.90

6.4.7.10.4 股票投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.10.5 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.11 基金投资收益

无。

6.4.7.12 债券投资收益

6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	428.14
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	868,037.68
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	868,465.82

6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	2,783,564.58
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,915,000.00
减：应计利息总额	415.53
减：交易费用	111.37
买卖债券差价收入	868,037.68

6.4.7.13 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.14 贵金属投资收益

无。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
----	----------------------------

股指期货投资收益	62,886,823.16
----------	---------------

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资产生的股利收益	51,718,557.84
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	51,718,557.84

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
1.交易性金融资产	-1,916,272,529.98
——股票投资	-1,916,272,529.98
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-3,148,538.46
——权证投资	-
——期货投资	-3,148,538.46
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-1,919,421,068.44

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	8,578,141.52

其他	36.80
合计	8,578,178.32

6.4.7.19 持有基金产生的费用

无。

6.4.7.20 信用减值损失

无。

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
审计费用	37,191.88
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	708.14
指数使用费	-
存托服务费	3,706.12
合计	101,113.51

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、关联关系

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
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人
华夏中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(“华夏中证 500ETF 联接”)	该基金是本基金的联接基金

中信证券股份有限公司（“中信证券”）	基金管理人的股东
--------------------	----------

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日		上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交 总额的比例	成交金额	占当期股票成交总 额的比例
中信证券	10,564,652,700.07	46.45%	-	-

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日		上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交 总额的比例	成交金额	占当期债券成交总 额的比例
中信证券	2,783,564.58	100.00%	-	-

6.4.10.1.4 债券回购交易

无。

6.4.10.1.5 基金交易

无。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日			
	当期 佣金	占当期佣金总 量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
中信证券	1,013,433.50	46.45%	1,013,433.50	46.42%
关联方名称	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总 量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例

中信证券	-	-	-	-
------	---	---	---	---

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。

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 2026年1月1日至2026年6月 30日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	10,208,422.28	9,613,299.23
其中：应支付销售机构的客户维护费	221,303.09	49,615.08
应支付基金管理人的净管理费	9,987,119.19	9,563,684.15

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 0.15%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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30 日	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	3,402,807.43	3,204,433.06

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 0.05%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。

6.4.10.2.3 销售服务费

无。

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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
华夏中证 500ETF 联接	463,406,583.00	29.72%	489,076,423.00	11.27%
中信证券	151,177.00	0.01%	6,247.00	0.00%

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金相关的费用按基金合同及相关法律文件有关规定支付。

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 2026年1月1日至2026年6月30日		上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行活期存款	104,667,650.06	97,573.43	214,525,671.05	124,968.32

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

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位： 股/张）	总金额
中信证券	001248	华润新能源	新股发行	84,104	850,291.44
中信证券	688820	盛合晶微	新股发行	23,902	470,391.36
中信证券	688808	联讯仪器	新股发行	1,624	132,973.12
中信证券	688785	恒运昌	新股发行	1,155	106,467.90
中信证券	688797	臻宝科技	新股发行	2,070	92,239.20
中信证券	301683	慧谷新材	新股发行	952	74,617.76
中信证券	688811	有研复材	新股发行	8,337	53,440.17
中信证券	301669	高特电子	新股发行	5,455	38,621.40
中信证券	001312	福恩股份	新股发行	1,333	24,500.54
上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位： 股/张）	总金额
中信证券	688775	影石创新	新股发行	5,725	270,620.75
中信证券	688583	思看科技	新股发行	1,742	58,287.32
中信证券	688755	汉邦科技	新股发行	2,023	46,063.71
中信证券	301662	宏工科技	新股发行	1,429	38,011.40
中信证券	603257	中国瑞林	新股发行	780	16,005.60
中信证券	603124	江南新材	新股发行	879	9,264.66

6.4.10.8 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（2026 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	成功 认购日	受限期	流 通	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

	名称			受限类型						
688525	佰维存储	2026-04-22	6 个月	大宗转让流通受限	248.37	442.55	40,000	9,934,800.00	17,702,000.00	-
688525	佰维存储	2026-04-24	6 个月	大宗转让流通受限	237.87	442.11	40,000	9,514,800.00	17,684,400.00	-
300757	罗博特科	2026-05-25	6 个月	大宗转让流通受限	541.13	546.21	15,000	8,116,950.00	8,193,150.00	-
688795	摩尔线程	2025-11-26	9 个月	新发流通受限	114.28	676.94	10,828	1,237,423.84	7,329,906.32	-
300395	菲利华	2026-05-28	6 个月	非公开流通受限	86.72	117.98	57,656	4,999,928.32	6,802,254.88	-
688599	天合光能	2026-03-06	6 个月	非公开流	17.31	13.49	400,000	6,924,000.00	5,396,000.00	-

				通 受 限						
688234	天 岳 先 进	2026-04-22	6 个月	非 公 开 流 通 受 限	82.32	155.45	23,453	1,930,650.96	3,645,768.85	-
688802	沐 曦 股 份	2025-12-09	9 个月	新 发 流 通 受 限	104.66	768.89	3,994	418,012.04	3,070,946.66	-
688783	西 安 奕 材	2025-10-20	9 个月	新 发 流 通 受 限	8.62	57.42	44,370	382,469.40	2,547,725.40	-
300679	电 连 技 术	2026-06-16	6 个月	大 宗 转 让 流 通 受 限	56.93	53.91	40,000	2,277,200.00	2,156,400.00	-
688615	合 合 信 息	2026-06-05	6 个月	非 公 开 流 通 受 限	113.75	104.72	15,000	1,706,250.00	1,570,800.00	-
688765	禾 元 生 物	2025-10-16	9 个月	新 发 流 通 受 限	29.06	48.56	16,470	478,618.20	799,783.20	-
001248	华 润	2026-06-24	6 个月	新 发	10.11	10.11	58,873	595,206.03	595,206.03	-

	新 能 源			流 通 受 限						
301666	大 普 微	2026-04-08	6 个月	新发 流通 受限	46.08	463.33	1,220	56,217.60	565,262.60	-
688759	必 贝 特	2025-10-21	9 个月	新发 流通 受限	17.78	30.65	12,552	223,174.56	384,718.80	-
688820	盛 合 晶 微	2026-04-13	6 个月	新发 流通 受限	19.68	141.49	2,391	47,054.88	338,302.59	-
688790	昂 瑞 微	2025-12-09	9 个月	新发 流通 受限	83.06	126.45	2,319	192,616.14	293,237.55	-
688781	视 涯 科 技	2026-03-18	9 个月	新发 流通 受限	22.68	42.16	6,335	143,677.80	267,083.60	-
688808	联 讯 仪 器	2026-04-16	6 个月	新发 流通 受限	81.88	1,584.33	163	13,346.44	258,245.79	-
001248	华 润 新 能 源	2026-06-24	1 个月 内(含)	新发 流通 受	10.11	10.11	25,231	255,085.41	255,085.41	-

				限						
001399	惠科股份	2026-06-16	6 个月	新发流通受限	10.12	27.73	6,488	65,658.56	179,912.24	-
688818	电科蓝天	2026-02-03	6 个月	新发流通受限	9.47	70.14	1,717	16,259.99	120,430.38	-
301682	宏明电子	2026-03-18	6 个月	新发流通受限	69.66	160.06	714	49,737.24	114,282.84	-
688797	臻宝科技	2026-06-16	6 个月	新发流通受限	44.56	468.67	207	9,223.92	97,014.69	-
688712	北芯生命	2026-01-28	6 个月	新发流通受限	17.52	35.92	1,500	26,280.00	53,880.00	-
688785	恒运昌	2026-01-20	6 个月	新发流通受限	92.18	463.15	116	10,692.88	53,725.40	-
688813	泰金新能	2026-03-24	6 个月	新发流通受限	26.28	172.09	234	6,149.52	40,269.06	-
688635	长	2026-05-20	6 个月	新	40.98	308.19	128	5,245.44	39,448.32	-

	进光子			发流通受限						
001257	盛龙股份	2026-03-24	6 个月	新发流通受限	7.82	20.74	1,743	13,630.26	36,149.82	-
603459	红板科技	2026-03-31	6 个月	新发流通受限	17.70	84.32	330	5,841.00	27,825.60	-
001365	天海电子	2026-05-11	6 个月	新发流通受限	27.19	31.31	719	19,549.61	22,511.89	-
688811	有研复材	2026-04-01	6 个月	新发流通受限	6.41	24.13	834	5,345.94	20,124.42	-
301696	三瑞智能	2026-03-31	6 个月	新发流通受限	24.68	86.80	216	5,330.88	18,748.80	-
001237	惠康科技	2026-05-15	6 个月	新发流通受限	53.26	58.74	285	15,179.10	16,740.90	-
301669	高特电子	2026-06-02	6 个月	新发流通	7.08	28.40	546	3,865.68	15,506.40	-

				受限						
301687	新广益	2025-12-24	6 个月	新发流通受限	21.93	77.78	195	4,276.35	15,167.10	-
001393	维通利	2026-05-08	6 个月	新发流通受限	30.38	38.99	387	11,757.06	15,089.13	-
301531	春光集团	2026-04-28	6 个月	新发流通受限	13.30	51.56	290	3,857.00	14,952.40	-
301599	理奇智能	2026-04-22	6 个月	新发流通受限	13.91	32.47	433	6,023.03	14,059.51	-
601112	振石股份	2026-01-21	6 个月	新发流通受限	11.18	17.59	775	8,664.50	13,632.25	-
301680	固德电材	2026-02-27	6 个月	新发流通受限	58.00	112.16	117	6,786.00	13,122.72	-
301683	慧谷新材	2026-03-24	6 个月	新发流通受限	78.38	121.77	96	7,524.48	11,689.92	-

688816	易思维	2026-02-04	6 个月	新发流通受限	55.95	57.10	177	9,903.15	10,106.70	-
603407	长裕集团	2026-04-29	6 个月	新发流通受限	13.86	73.46	137	1,898.82	10,064.02	-
301513	尚水智能	2026-04-10	6 个月	新发流通受限	26.66	50.96	138	3,679.08	7,032.48	-
920136	永励精密	2026-06-25	1 个月内(含)	新发流通受限	19.28	19.28	300	5,784.00	5,784.00	-
603435	嘉德利	2026-05-15	6 个月	新发流通受限	15.76	46.71	104	1,639.04	4,857.84	-
603352	至信股份	2026-01-08	6 个月	新发流通受限	21.88	25.52	112	2,450.56	2,858.24	-
920193	吉和昌	2026-06-18	1 个月内(含)	新发流通受限	8.52	8.52	300	2,556.00	2,556.00	-
603293	埃泰克	2026-04-09	6 个月	新发流	33.49	33.93	72	2,411.28	2,442.96	-

				通受限						
001312	福恩股份	2026-04-14	6 个月	新发流通受限	18.38	16.78	134	2,462.92	2,248.52	-
920189	康美特	2026-06-30	1 个月内(含)	新发流通受限	8.14	8.14	200	1,628.00	1,628.00	-
603284	林平发展	2026-02-03	6 个月	新发流通受限	37.88	34.87	46	1,742.48	1,604.02	-
001220	世盟股份	2026-01-27	6 个月	新发流通受限	28.00	27.78	57	1,596.00	1,583.46	-

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113704	春风转债	2026-06-10	1 个月内(含)	新发流通受限	100.00	100.00	10,480	1,048,000.00	1,048,048.24	期末估值单价为含息价

										格
118071	华峰转债	2026-06-23	1 个月内(含)	新发流通受限	100.00	100.00	3,660	366,000.00	366,006.42	期末估值单价为含息价格

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

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

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

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

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

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，本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股，如需对组合进行调整时，由于投资标的流动性较好，市场冲击成本较小，基金投资组合收益偏离投资目标收益的风险较小。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，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。

本基金为指数型基金，采用完全复制策略。本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。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。

本基金为指数型基金，采用完全复制策略。本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。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 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 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	7,748,174,070.47	97.44	17,774,743,563.60	98.29
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	1,414,054.66	0.02	1,915,029.38	0.01
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	7,749,588,125.13	97.46	17,776,658,592.98	98.30

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

②由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中证 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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
	-5%	-409,460,976.00	-892,296,986.80
	+5%	409,460,976.00	892,296,986.80

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026 年 6 月 30 日
第一层次	7,667,325,909.86
第二层次	2,274,314.10
第三层次	79,987,901.17
合计	7,749,588,125.13

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券等投资，若出现交易不活跃（包括重大事项停牌、境内证券涨跌停等导致的交易不活跃）和非公开发行等导致流通受限的情况，本基金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所属层次。本基金政策以导致各层次之间转换的事项发生日作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

截至 2026 年 6 月 30 日止，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，其账面价值与公允价值差异很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元			
序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	7,748,174,070.47	97.01
	其中：股票	7,748,174,070.47	97.01
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,414,054.66	0.02
	其中：债券	1,414,054.66	0.02
	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	175,664,890.84	2.20
8	其他各项资产	62,105,998.37	0.78
9	合计	7,987,359,014.34	100.00

注：股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值。

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

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	25,140,925.04	0.32
B	采矿业	236,799,294.28	2.98
C	制造业	5,846,478,196.41	73.52
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	187,792,969.14	2.36
E	建筑业	45,177,906.09	0.57
F	批发和零售业	145,468,284.82	1.83
G	交通运输、仓储和邮政业	93,179,572.36	1.17
H	住宿和餐饮业	5,575,101.00	0.07
I	信息传输、软件和信息技术服务业	496,208,337.04	6.24
J	金融业	420,769,709.33	5.29
K	房地产业	30,885,171.39	0.39
L	租赁和商务服务业	78,606,642.28	0.99
M	科学研究和技术服务业	55,680,636.06	0.70
N	水利、环境和公共设施管理业	26,481,798.22	0.33
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	17,946,798.12	0.23
R	文化、体育和娱乐业	35,952,756.03	0.45
S	综合	-	-
	合计	7,748,144,097.61	97.44

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

7.3.1 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

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	688498	源杰科技	67,816	127,900,976.00	1.61
2	300604	长川科技	302,400	103,245,408.00	1.30
3	001309	德明利	108,100	101,927,490.00	1.28
4	688347	华虹宏力	277,629	93,366,632.70	1.17
5	688120	华海清科	269,482	86,821,710.76	1.09

6	002281	光迅科技	329,615	84,691,278.10	1.07
7	002008	大族激光	560,800	84,181,688.00	1.06
8	300857	协创数据	233,308	79,301,389.20	1.00
9	300136	信维通信	658,800	78,561,900.00	0.99
10	688361	中科飞测	166,893	71,763,990.00	0.90
11	300475	香农芯创	223,800	67,140,000.00	0.84
12	300223	北京君正	263,214	65,513,964.60	0.82
13	002436	兴森科技	1,157,300	58,964,435.00	0.74
14	300285	国瓷材料	543,105	56,037,573.90	0.70
15	300054	鼎龙股份	519,071	55,005,953.87	0.69
16	600105	永鼎股份	796,400	53,741,072.00	0.68
17	300666	江丰电子	144,497	53,261,594.20	0.67
18	688777	中控技术	431,017	50,644,497.50	0.64
19	688200	华峰测控	95,798	50,303,529.80	0.63
20	000021	深科技	753,100	48,401,737.00	0.61
21	300757	罗博特科	79,921	48,379,249.00	0.61
22	688037	芯源微	109,827	48,219,544.35	0.61
23	002851	麦格米特	277,100	46,325,578.00	0.58
24	601869	长飞光纤	83,000	45,309,700.00	0.57
25	300548	长芯博创	160,500	44,619,000.00	0.56
26	002409	雅克科技	195,223	43,827,563.50	0.55
27	300346	南大光电	470,632	43,604,054.80	0.55
28	300567	精测电子	133,300	42,336,080.00	0.53
29	688019	安集科技	123,916	42,064,525.36	0.53
30	600498	烽火通信	554,890	40,839,904.00	0.51
31	002407	多氟多	810,600	40,716,438.00	0.51
32	002185	华天科技	1,810,317	40,388,172.27	0.51
33	002138	顺络电子	548,990	40,131,169.00	0.50
34	688313	仕佳光子	215,424	39,778,041.60	0.50
35	688002	睿创微纳	255,984	39,598,164.96	0.50

36	300620	光库科技	101,800	38,500,760.00	0.48
37	600879	航天电子	1,797,157	38,261,472.53	0.48
38	300395	菲利华	286,368	37,387,910.64	0.47
39	300390	天华新能	396,011	37,030,988.61	0.47
40	688017	绿的谐波	87,378	36,511,771.08	0.46
41	688469	芯联集成	3,424,564	36,334,624.04	0.46
42	301526	国际复材	770,243	35,947,240.81	0.45
43	688525	佰维存储	80,000	35,386,400.00	0.45
44	300373	扬杰科技	222,000	34,905,060.00	0.44
45	300058	蓝色光标	2,444,559	33,637,131.84	0.42
46	002273	水晶光电	944,351	33,505,573.48	0.42
47	300037	新宙邦	359,320	33,362,862.00	0.42
48	603256	宏和科技	123,200	32,688,656.00	0.41
49	688702	盛科通信	83,748	32,660,882.52	0.41
50	688172	燕东微	388,815	32,528,262.90	0.41
51	300751	迈为股份	114,000	32,200,440.00	0.40
52	605358	立昂微	403,326	31,298,097.60	0.39
53	301377	鼎泰高科	56,000	30,850,400.00	0.39
54	600988	赤峰黄金	1,132,886	29,817,559.52	0.37
55	688099	晶晨股份	288,230	29,658,867.00	0.37
56	605589	圣泉集团	461,100	29,312,127.00	0.37
57	600885	宏发股份	842,959	29,073,655.91	0.37
58	002738	中矿资源	490,480	28,933,415.20	0.36
59	002126	银轮股份	576,500	28,709,700.00	0.36
60	000960	锡业股份	672,198	28,696,132.62	0.36
61	600392	盛和资源	954,757	28,423,115.89	0.36
62	600601	方正科技	2,035,563	28,172,191.92	0.35
63	000831	中国稀土	505,700	28,061,293.00	0.35
64	001389	广合科技	116,122	27,549,944.50	0.35
65	600141	兴发集团	572,814	26,905,073.58	0.34

66	002812	恩捷股份	401,200	26,844,292.00	0.34
67	300570	太辰光	108,300	26,718,693.00	0.34
68	600378	昊华科技	349,700	26,360,386.00	0.33
69	301358	湖南裕能	344,500	26,137,215.00	0.33
70	601179	中国西电	1,745,117	26,037,145.64	0.33
71	002195	岩山科技	3,860,968	25,250,730.72	0.32
72	688234	天岳先进	147,867	25,232,841.99	0.32
73	002850	科达利	131,900	24,968,670.00	0.31
74	600497	驰宏锌锗	2,058,893	24,933,194.23	0.31
75	002261	拓维信息	857,800	24,026,978.00	0.30
76	600157	永泰能源	14,855,301	23,917,034.61	0.30
77	688629	华丰科技	125,553	23,542,443.03	0.30
78	600711	盛屯矿业	2,104,328	23,084,478.16	0.29
79	002340	格林美	3,474,100	22,963,801.00	0.29
80	600909	华安证券	2,052,596	22,804,341.56	0.29
81	600143	金发科技	1,456,120	22,497,054.00	0.28
82	688052	纳芯微	77,636	22,383,235.16	0.28
83	002821	凯莱英	137,000	22,194,000.00	0.28
84	003031	中瓷电子	122,820	22,144,446.00	0.28
85	300017	网宿科技	1,699,300	22,107,893.00	0.28
86	000783	长江证券	2,259,100	22,026,225.00	0.28
87	002131	利欧股份	4,610,800	21,901,300.00	0.28
88	688411	海博思创	74,538	21,705,465.60	0.27
89	600352	浙江龙盛	1,772,192	21,461,245.12	0.27
90	601555	东吴证券	2,706,441	21,435,012.72	0.27
91	002203	海亮股份	936,300	21,394,455.00	0.27
92	301611	珂玛科技	118,500	21,338,295.00	0.27
93	688220	翱捷科技	170,887	21,244,671.84	0.27
94	688027	国盾量子	42,082	21,209,748.82	0.27
95	301200	大族数控	58,760	21,191,794.00	0.27

96	002966	苏州银行	3,043,970	21,186,031.20	0.27
97	601233	桐昆股份	971,870	21,040,985.50	0.26
98	603659	璞泰来	727,279	21,040,181.47	0.26
99	300339	润和软件	542,300	20,883,973.00	0.26
100	688213	思特威	191,746	20,530,244.22	0.26
101	300759	康龙化成	703,300	20,346,469.00	0.26
102	688578	艾力斯	183,837	20,075,000.40	0.25
103	688235	百济神州	78,339	19,945,892.79	0.25
104	603308	应流股份	323,600	19,545,440.00	0.25
105	688122	西部超导	309,640	19,448,488.40	0.24
106	002472	双环传动	461,700	19,165,167.00	0.24
107	601108	财通证券	2,213,336	19,145,356.40	0.24
108	300207	欣旺达	1,006,300	19,109,637.00	0.24
109	300001	特锐德	503,102	19,032,348.66	0.24
110	002517	恺英网络	1,163,800	18,911,750.00	0.24
111	002797	第一创业	2,858,200	18,778,374.00	0.24
112	002601	龙佰集团	1,136,400	18,727,872.00	0.24
113	603129	春风动力	73,203	18,725,327.40	0.24
114	300458	全志科技	473,636	18,689,676.56	0.24
115	601958	金钼股份	659,104	18,527,413.44	0.23
116	688387	信科移动	931,104	18,473,103.36	0.23
117	688385	复旦微电	257,082	18,327,375.78	0.23
118	300115	长盈精密	646,300	18,057,622.00	0.23
119	688322	奥比中光	137,837	17,994,620.35	0.23
120	601198	东兴证券	1,320,510	17,945,730.90	0.23
121	601991	大唐发电	2,532,052	17,926,928.16	0.23
122	002155	湖南黄金	744,819	17,778,829.53	0.22
123	000703	恒逸石化	1,292,513	17,539,401.41	0.22
124	600563	法拉电子	91,877	17,530,131.60	0.22
125	688301	奕瑞科技	141,066	17,492,184.00	0.22

126	002465	海格通信	1,351,900	17,263,763.00	0.22
127	300454	深信服	176,300	16,960,060.00	0.21
128	601665	齐鲁银行	2,932,990	16,923,352.30	0.21
129	603179	新泉股份	340,452	16,903,441.80	0.21
130	002056	横店东磁	553,800	16,879,824.00	0.21
131	603156	养元饮品	343,281	16,844,798.67	0.21
132	600884	杉杉股份	1,225,245	16,602,069.75	0.21
133	300024	机器人	852,800	16,484,624.00	0.21
134	603650	彤程新材	167,847	16,445,649.06	0.21
135	600707	彩虹股份	973,400	16,440,726.00	0.21
136	002130	沃尔核材	857,800	16,263,888.00	0.20
137	002402	和而泰	627,377	16,205,147.91	0.20
138	601162	天风证券	4,801,400	16,180,718.00	0.20
139	000060	中金岭南	2,116,700	16,023,419.00	0.20
140	002429	兆驰股份	1,541,200	16,013,068.00	0.20
141	688676	金盘科技	187,835	15,898,354.40	0.20
142	300012	华测检测	1,144,400	15,861,384.00	0.20
143	688331	荣昌生物	121,161	15,782,431.86	0.20
144	603379	三美股份	207,789	15,769,107.21	0.20
145	000878	云南铜业	990,800	15,733,904.00	0.20
146	002432	九安医疗	222,100	15,698,028.00	0.20
147	601099	太平洋	4,641,128	15,640,601.36	0.20
148	300496	中科创达	251,500	15,540,185.00	0.20
149	600109	国金证券	1,766,000	15,505,480.00	0.19
150	002271	东方雨虹	1,301,043	15,443,380.41	0.19
151	000893	亚钾国际	377,500	15,435,975.00	0.19
152	002414	高德红外	1,163,200	15,424,032.00	0.19
153	000034	神州数码	553,780	15,367,395.00	0.19
154	300623	捷捷微电	339,935	15,293,675.65	0.19
155	603688	石英股份	184,389	15,232,375.29	0.19

156	689009	九号公司	398,311	15,195,564.65	0.19
157	002444	巨星科技	487,968	15,175,804.80	0.19
158	002335	科华数据	356,275	15,123,873.75	0.19
159	002487	大金重工	260,600	15,106,982.00	0.19
160	300474	景嘉微	249,106	15,065,930.88	0.19
161	600256	广汇能源	3,046,500	15,049,710.00	0.19
162	603979	金诚信	254,861	15,044,444.83	0.19
163	600298	安琪酵母	413,648	14,974,057.60	0.19
164	000733	振华科技	264,116	14,959,530.24	0.19
165	688728	格科微	706,659	14,868,105.36	0.19
166	600060	海信视像	533,060	14,856,382.20	0.19
167	000661	长春高新	222,300	14,805,180.00	0.19
168	301536	星辰科技	114,800	14,775,908.00	0.19
169	688266	泽璟制药	126,164	14,718,292.24	0.19
170	300763	锦浪科技	162,606	14,691,452.10	0.18
171	002756	永兴材料	256,930	14,552,515.20	0.18
172	600021	上海电力	960,506	14,474,825.42	0.18
173	601128	常熟银行	2,484,003	14,456,897.46	0.18
174	300748	金力永磁	466,060	14,377,951.00	0.18
175	600699	均胜电子	665,275	14,376,592.75	0.18
176	601696	中银证券	1,134,900	14,356,485.00	0.18
177	601577	长沙银行	1,642,884	14,309,519.64	0.18
178	002078	太阳纸业	1,141,572	14,258,234.28	0.18
179	601615	明阳智能	1,231,900	14,253,083.00	0.18
180	300073	当升科技	296,456	14,241,746.24	0.18
181	002025	航天电器	185,814	14,162,743.08	0.18
182	002157	正邦科技	5,038,600	14,158,466.00	0.18
183	300142	沃森生物	1,088,900	14,144,811.00	0.18
184	603920	世运电路	294,397	14,142,831.88	0.18
185	300432	富临精工	698,500	14,032,865.00	0.18

186	688343	云天励飞	171,393	13,995,952.38	0.18
187	603606	东方电缆	336,940	13,986,379.40	0.18
188	300919	中伟新材	319,360	13,972,000.00	0.18
189	000423	东阿阿胶	306,900	13,920,984.00	0.18
190	603087	甘李药业	244,000	13,849,440.00	0.17
191	002252	上海莱士	3,142,200	13,637,148.00	0.17
192	688608	恒玄科技	80,403	13,442,577.57	0.17
193	688169	石头科技	141,221	13,411,758.37	0.17
194	300724	捷佳伟创	189,700	13,392,820.00	0.17
195	000728	国元证券	1,782,729	13,352,640.21	0.17
196	300953	震裕科技	99,570	13,312,509.00	0.17
197	688599	天合光能	957,005	13,260,910.60	0.17
198	002064	华峰化学	1,351,588	12,826,570.12	0.16
199	603119	浙江荣泰	193,200	12,816,888.00	0.16
200	688375	国博电子	121,744	12,697,899.20	0.16
201	000786	北新建材	695,400	12,579,786.00	0.16
202	001203	大中矿业	417,500	12,504,125.00	0.16
203	002831	裕同科技	350,894	12,477,790.64	0.16
204	603290	斯达半导	81,484	12,462,162.96	0.16
205	688180	君实生物	365,276	12,353,634.32	0.16
206	600171	上海贝岭	386,100	12,332,034.00	0.16
207	688018	乐鑫科技	95,753	12,248,723.76	0.15
208	300677	英科医疗	312,100	12,224,957.00	0.15
209	688187	时代电气	177,487	12,186,257.42	0.15
210	300383	光环新网	979,100	12,180,004.00	0.15
211	000519	中兵红箭	568,895	11,986,617.65	0.15
212	603806	福斯特	710,438	11,928,254.02	0.15
213	300679	电连技术	202,500	11,904,775.00	0.15
214	600177	雅戈尔	1,573,997	11,852,197.41	0.15
215	002673	西部证券	1,825,955	11,850,447.95	0.15

216	600516	方大炭素	1,918,874	11,839,452.58	0.15
217	688188	柏楚电子	110,455	11,785,548.50	0.15
218	688065	凯赛生物	245,556	11,749,854.60	0.15
219	603160	汇顶科技	190,322	11,744,770.62	0.15
220	000559	万向钱潮	902,989	11,675,647.77	0.15
221	300972	万辰集团	67,226	11,657,660.66	0.15
222	600642	申能股份	1,332,940	11,636,566.20	0.15
223	601699	潞安环能	814,776	11,635,001.28	0.15
224	000623	吉林敖东	651,487	11,550,864.51	0.15
225	002624	完美世界	929,600	11,545,632.00	0.15
226	600637	东方明珠	1,373,372	11,412,721.32	0.14
227	688568	中科星图	275,102	11,408,479.94	0.14
228	001696	宗申动力	545,770	11,357,473.70	0.14
229	300699	光威复材	396,242	11,352,333.30	0.14
230	603225	新凤鸣	571,168	11,223,451.20	0.14
231	002085	万丰奥威	1,012,000	11,223,080.00	0.14
232	603345	安井食品	139,800	11,210,562.00	0.14
233	000983	山西焦煤	1,932,776	11,210,100.80	0.14
234	000750	国海证券	3,043,743	11,200,974.24	0.14
235	300558	贝达药业	171,900	11,185,533.00	0.14
236	002318	久立特材	465,700	11,130,230.00	0.14
237	002739	儒意电影	1,150,300	11,042,880.00	0.14
238	600100	同方股份	1,596,838	10,938,340.30	0.14
239	600369	西南证券	2,714,718	10,913,166.36	0.14
240	002065	东华软件	1,527,800	10,908,492.00	0.14
241	600499	科达制造	783,500	10,812,300.00	0.14
242	002266	浙富控股	2,132,213	10,788,997.78	0.14
243	600595	中孚实业	1,910,200	10,735,324.00	0.14
244	600536	中国软件	381,545	10,729,045.40	0.13
245	300627	华测导航	377,776	10,728,838.40	0.13

246	002044	美年健康	2,132,100	10,724,463.00	0.13
247	603596	伯特利	427,838	10,627,495.92	0.13
248	603699	纽威股份	211,100	10,618,330.00	0.13
249	688772	珠海冠宇	539,618	10,592,701.34	0.13
250	000629	钒钛股份	3,163,007	10,564,443.38	0.13
251	000155	川能动力	879,900	10,541,202.00	0.13
252	603444	吉比特	29,400	10,537,548.00	0.13
253	000400	许继电气	485,500	10,535,350.00	0.13
254	002223	鱼跃医疗	409,619	10,510,823.54	0.13
255	688617	惠泰医疗	57,819	10,497,617.64	0.13
256	300002	神州泰岳	1,339,398	10,460,698.38	0.13
257	300003	乐普医疗	878,600	10,411,410.00	0.13
258	601016	节能风电	2,673,601	10,373,571.88	0.13
259	000032	深桑达 A	413,700	10,321,815.00	0.13
260	002430	杭氧股份	333,000	10,309,680.00	0.13
261	600985	淮北矿业	733,600	10,307,080.00	0.13
262	000415	渤海租赁	2,526,600	10,283,262.00	0.13
263	600521	华海药业	713,585	10,275,624.00	0.13
264	600862	中航高科	569,098	10,260,836.94	0.13
265	601216	君正集团	2,298,144	10,249,722.24	0.13
266	601212	白银有色	2,016,687	10,244,769.96	0.13
267	601717	中创智领	734,994	10,223,766.54	0.13
268	601997	贵阳银行	1,991,475	10,216,266.75	0.13
269	000683	博源化工	1,771,500	10,203,840.00	0.13
270	300487	蓝晓科技	173,313	10,199,470.05	0.13
271	000039	中集集团	1,254,290	10,172,291.90	0.13
272	600863	华能蒙电	2,133,915	10,029,400.50	0.13
273	603766	隆鑫通用	838,991	10,009,162.63	0.13
274	600704	物产中大	2,112,555	9,971,259.60	0.13
275	601001	晋控煤业	569,800	9,908,822.00	0.12

276	000050	深天马 A	995,100	9,861,441.00	0.12
277	601990	南京证券	1,497,800	9,840,546.00	0.12
278	600873	梅花生物	1,336,513	9,823,370.55	0.12
279	002841	视源股份	284,400	9,820,332.00	0.12
280	600312	平高电气	554,307	9,789,061.62	0.12
281	688538	和辉光电	3,758,875	9,773,075.00	0.12
282	603077	和邦生物	4,209,364	9,765,724.48	0.12
283	000729	燕京啤酒	958,352	9,708,105.76	0.12
284	603605	珀莱雅	161,758	9,692,539.36	0.12
285	000887	中鼎股份	537,800	9,621,242.00	0.12
286	000967	盈峰环境	912,589	9,609,562.17	0.12
287	600332	白云山	478,700	9,593,148.00	0.12
288	600765	中航重机	739,923	9,559,805.16	0.12
289	688297	中无人机	229,798	9,548,106.90	0.12
290	688692	达梦数据	38,592	9,427,639.68	0.12
291	600166	福田汽车	3,234,516	9,412,441.56	0.12
292	600348	华阳股份	1,228,147	9,395,324.55	0.12
293	600153	建发股份	1,184,508	9,393,148.44	0.12
294	000830	鲁西化工	777,900	9,334,800.00	0.12
295	002410	广联达	1,124,800	9,178,368.00	0.12
296	002939	长城证券	1,098,800	9,163,992.00	0.12
297	601611	中国核建	820,800	9,151,920.00	0.12
298	002683	广东宏大	310,463	9,093,461.27	0.11
299	002007	华兰生物	745,894	9,092,447.86	0.11
300	600901	江苏金租	1,577,418	9,070,153.50	0.11
301	000062	深圳华强	284,900	9,065,518.00	0.11
302	600737	中粮糖业	725,353	8,943,602.49	0.11
303	688615	合合信息	80,071	8,930,330.10	0.11
304	688582	芯动联科	136,769	8,889,985.00	0.11
305	600578	京能电力	1,367,531	8,820,574.95	0.11

306	601799	星宇股份	97,300	8,817,326.00	0.11
307	002926	华西证券	1,072,300	8,760,691.00	0.11
308	688114	华大智造	170,159	8,691,721.72	0.11
309	600363	联创光电	242,200	8,665,916.00	0.11
310	603728	鸣志电器	142,000	8,650,640.00	0.11
311	000921	海信家电	315,050	8,607,166.00	0.11
312	603568	伟明环保	558,938	8,596,466.44	0.11
313	000737	北方铜业	648,500	8,573,170.00	0.11
314	000591	太阳能	1,861,100	8,561,060.00	0.11
315	600398	海澜之家	1,635,064	8,551,384.72	0.11
316	002603	以岭药业	568,800	8,532,000.00	0.11
317	603298	杭叉集团	356,760	8,512,293.60	0.11
318	000528	柳工	1,109,560	8,377,178.00	0.11
319	601000	唐山港	2,017,424	8,372,309.60	0.11
320	600486	扬农化工	165,127	8,371,938.90	0.11
321	600208	衢州发展	2,896,783	8,197,895.89	0.10
322	000738	航发控制	447,767	8,189,658.43	0.10
323	600316	洪都航空	292,957	8,185,218.58	0.10
324	603341	龙旗科技	192,156	8,164,708.44	0.10
325	600008	首创环保	2,998,907	8,157,027.04	0.10
326	000932	华菱钢铁	2,332,920	8,095,232.40	0.10
327	600435	北方导航	720,843	8,073,441.60	0.10
328	600170	上海建工	3,630,222	8,059,092.84	0.10
329	600998	九州通	1,716,700	8,051,323.00	0.10
330	600995	南网储能	652,873	8,030,337.90	0.10
331	000987	越秀资本	1,024,861	8,014,413.02	0.10
332	603486	科沃斯	157,600	7,998,200.00	0.10
333	688248	南网科技	115,347	7,979,705.46	0.10
334	002152	广电运通	845,393	7,929,786.34	0.10
335	000997	新大陆	482,850	7,870,455.00	0.10

336	600820	隧道股份	1,498,500	7,807,185.00	0.10
337	600161	天坛生物	673,202	7,795,679.16	0.10
338	002262	恩华药业	414,958	7,780,462.50	0.10
339	000951	中国重汽	397,900	7,763,029.00	0.10
340	600483	福能股份	757,205	7,715,918.95	0.10
341	600282	南钢股份	1,679,000	7,706,610.00	0.10
342	601106	中国一重	2,334,700	7,704,510.00	0.10
343	000009	中国宝安	1,229,332	7,658,738.36	0.10
344	603885	吉祥航空	743,489	7,650,501.81	0.10
345	600583	海油工程	1,505,200	7,571,156.00	0.10
346	002500	山西证券	1,466,460	7,566,933.60	0.10
347	603816	顾家家居	335,582	7,503,613.52	0.09
348	688778	厦钨新能	137,453	7,477,443.20	0.09
349	603939	益丰药房	412,728	7,420,849.44	0.09
350	688295	中复神鹰	122,559	7,419,721.86	0.09
351	600546	山煤国际	674,900	7,376,657.00	0.09
352	000582	北部湾港	685,500	7,355,415.00	0.09
353	688795	摩尔线程	10,828	7,329,906.32	0.09
354	603338	浙江鼎力	172,370	7,325,725.00	0.09
355	688166	博瑞医药	207,707	7,271,822.07	0.09
356	600329	达仁堂	194,100	7,224,402.00	0.09
357	600763	通策医疗	213,174	7,222,335.12	0.09
358	601666	平煤股份	1,008,800	7,212,920.00	0.09
359	600562	国睿科技	338,200	7,176,604.00	0.09
360	601567	三星电气	478,400	7,147,296.00	0.09
361	600685	中船防务	279,629	7,113,761.76	0.09
362	002312	川发龙蟒	771,200	7,071,904.00	0.09
363	003022	联泓新科	272,800	7,065,520.00	0.09
364	600038	中直股份	279,097	7,058,363.13	0.09
365	600602	云赛智联	438,800	7,055,904.00	0.09

366	600380	健康元	747,463	7,041,101.46	0.09
367	000723	美锦能源	2,098,704	7,030,658.40	0.09
368	603565	中谷物流	714,962	7,013,777.22	0.09
369	300676	华大基因	199,360	6,989,561.60	0.09
370	600390	五矿资本	1,531,300	6,982,728.00	0.09
371	601156	东航物流	432,374	6,969,868.88	0.09
372	688318	财富趋势	97,657	6,963,920.67	0.09
373	000513	丽珠集团	240,243	6,940,620.27	0.09
374	601880	辽港股份	5,014,816	6,920,446.08	0.09
375	601399	国机重装	1,964,580	6,876,030.00	0.09
376	600132	重庆啤酒	164,801	6,806,281.30	0.09
377	601865	福莱特	647,200	6,802,072.00	0.09
378	600535	天士力	508,560	6,728,248.80	0.08
379	600511	国药股份	256,854	6,688,478.16	0.08
380	600906	财达证券	883,700	6,592,402.00	0.08
381	601236	红塔证券	963,500	6,571,070.00	0.08
382	000739	普洛药业	394,414	6,570,937.24	0.08
383	600977	中国电影	508,500	6,569,820.00	0.08
384	600816	建元信托	2,681,136	6,541,971.84	0.08
385	688281	华秦科技	129,911	6,525,429.53	0.08
386	000598	兴蓉环境	1,015,956	6,522,437.52	0.08
387	300100	双林股份	233,700	6,492,186.00	0.08
388	688336	三生国健	122,045	6,480,589.50	0.08
389	002244	滨江集团	847,394	6,440,194.40	0.08
390	002299	圣农发展	423,200	6,415,712.00	0.08
391	600970	中材国际	892,605	6,364,273.65	0.08
392	601155	新城控股	615,661	6,316,681.86	0.08
393	600967	内蒙一机	579,319	6,285,611.15	0.08
394	002120	韵达股份	987,022	6,277,459.92	0.08
395	300735	光弘科技	275,500	6,264,870.00	0.08

396	300146	汤臣倍健	691,131	6,247,824.24	0.08
397	000883	湖北能源	1,446,100	6,247,152.00	0.08
398	300144	宋城演艺	1,072,205	6,229,511.05	0.08
399	300718	长盛轴承	101,700	6,200,649.00	0.08
400	688278	特宝生物	111,171	6,047,702.40	0.08
401	002568	百润股份	356,260	6,027,919.20	0.08
402	000027	深圳能源	971,780	6,025,036.00	0.08
403	000800	一汽解放	1,005,200	5,980,940.00	0.08
404	600131	国网信通	407,956	5,956,157.60	0.07
405	601608	中信重工	1,247,156	5,948,934.12	0.07
406	601866	中远海发	2,655,939	5,869,625.19	0.07
407	688363	华熙生物	163,983	5,865,671.91	0.07
408	600095	湘财股份	778,700	5,863,611.00	0.07
409	603737	三棵树	241,096	5,810,413.60	0.07
410	000088	盐田港	1,416,100	5,791,849.00	0.07
411	601118	海南橡胶	1,165,604	5,734,771.68	0.07
412	003021	兆威机电	65,600	5,730,160.00	0.07
413	002583	海能达	743,000	5,713,670.00	0.07
414	600801	华新建材	366,167	5,712,205.20	0.07
415	600126	杭钢股份	919,807	5,638,416.91	0.07
416	600871	石化油服	2,767,200	5,617,416.00	0.07
417	600754	锦江酒店	309,900	5,575,101.00	0.07
418	600566	济川药业	251,025	5,570,244.75	0.07
419	603000	人民网	376,382	5,566,689.78	0.07
420	002984	森麒麟	423,340	5,533,053.80	0.07
421	600517	国网英大	1,168,022	5,466,342.96	0.07
422	000709	河钢股份	2,815,300	5,461,682.00	0.07
423	600655	豫园股份	1,324,700	5,444,517.00	0.07
424	603589	口子窖	285,100	5,325,668.00	0.07
425	000825	太钢不锈	1,551,400	5,290,274.00	0.07

426	600598	北大荒	484,104	5,247,687.36	0.07
427	603858	步长制药	359,022	5,241,721.20	0.07
428	601598	中国外运	1,053,470	5,225,211.20	0.07
429	001286	陕西能源	510,653	5,178,021.42	0.07
430	301606	绿联科技	84,800	5,174,496.00	0.07
431	002423	中粮资本	627,500	5,164,325.00	0.06
432	603899	晨光股份	249,515	5,147,494.45	0.06
433	002773	康弘药业	250,900	5,130,905.00	0.06
434	600350	山东高速	460,900	5,129,817.00	0.06
435	600004	白云机场	701,900	5,095,794.00	0.06
436	601966	玲珑轮胎	498,200	5,076,658.00	0.06
437	688192	迪哲医药	126,689	5,058,691.77	0.06
438	600663	陆家嘴	803,578	5,046,469.84	0.06
439	600582	天地科技	1,127,100	5,015,595.00	0.06
440	688709	成都华微	130,085	4,954,937.65	0.06
441	688349	三一重能	325,461	4,940,497.98	0.06
442	600848	上海临港	652,060	4,883,929.40	0.06
443	000429	粤高速 A	355,900	4,858,035.00	0.06
444	601098	中南传媒	489,175	4,813,482.00	0.06
445	688563	航材股份	91,919	4,709,010.37	0.06
446	002508	老板电器	321,700	4,703,254.00	0.06
447	603233	大参林	310,132	4,661,283.96	0.06
448	600968	海油发展	1,384,200	4,609,386.00	0.06
449	601928	凤凰传媒	519,782	4,568,883.78	0.06
450	300957	贝泰妮	144,200	4,543,742.00	0.06
451	600062	华润双鹤	282,843	4,536,801.72	0.06
452	003035	南网能源	773,800	4,503,516.00	0.06
453	688561	奇安信	185,813	4,455,795.74	0.06
454	300888	稳健医疗	158,560	4,438,094.40	0.06
455	600688	上海石化	1,497,000	4,386,210.00	0.06

456	688425	铁建重工	1,089,442	4,379,556.84	0.06
457	601808	中海油服	403,181	4,358,386.61	0.05
458	002670	国盛证券	395,286	4,348,146.00	0.05
459	600295	鄂尔多斯	403,548	4,326,034.56	0.05
460	002032	苏泊尔	108,900	4,312,440.00	0.05
461	600098	广州发展	716,100	4,232,151.00	0.05
462	688708	佳驰科技	81,708	4,150,766.40	0.05
463	000539	粤电力 A	606,200	4,128,222.00	0.05
464	000537	绿发电力	559,800	4,092,138.00	0.05
465	600808	马钢股份	1,625,300	4,063,250.00	0.05
466	002153	石基信息	557,529	4,030,934.67	0.05
467	600292	电投水电	328,100	3,950,324.00	0.05
468	600377	宁沪高速	337,800	3,908,346.00	0.05
469	601298	青岛港	477,300	3,842,265.00	0.05
470	603833	欧派家居	124,497	3,748,604.67	0.05
471	000959	首钢股份	1,063,300	3,732,183.00	0.05
472	002265	建设工业	211,025	3,671,835.00	0.05
473	301301	川宁生物	455,500	3,616,670.00	0.05
474	002608	江苏国信	513,700	3,544,530.00	0.04
475	600339	中油工程	1,140,401	3,501,031.07	0.04
476	600606	绿地控股	2,870,760	3,473,619.60	0.04
477	600032	浙江新能	491,215	3,463,065.75	0.04
478	603529	爱玛科技	177,310	3,459,318.10	0.04
479	000785	居然智家	1,695,900	3,391,800.00	0.04
480	603658	安图生物	116,666	3,385,647.32	0.04
481	600764	中国海防	193,600	3,374,448.00	0.04
482	603786	科博达	82,458	3,373,356.78	0.04
483	601139	深圳燃气	587,540	3,325,476.40	0.04
484	301498	乖宝宠物	81,800	3,320,262.00	0.04
485	688520	神州细胞	96,072	3,286,623.12	0.04

486	000937	冀中能源	793,930	3,159,841.40	0.04
487	300140	节能环保	633,000	3,146,010.00	0.04
488	688802	沐曦股份	3,994	3,070,946.66	0.04
489	000898	鞍钢股份	1,625,413	3,039,522.31	0.04
490	603049	中策橡胶	65,481	2,934,203.61	0.04
491	688475	萤石网络	107,239	2,932,986.65	0.04
492	603175	超颖电子	32,800	2,922,152.00	0.04
493	601228	广州港	1,027,400	2,897,268.00	0.04
494	601019	山东出版	426,278	2,728,179.20	0.03
495	688783	西安奕材	44,370	2,547,725.40	0.03
496	002945	华林证券	183,800	2,468,434.00	0.03
497	600927	永安期货	198,200	2,467,590.00	0.03
498	601112	振石股份	130,275	2,374,417.25	0.03
499	002461	珠江啤酒	301,400	2,281,598.00	0.03
500	600299	安迪苏	272,600	2,139,910.00	0.03
501	688819	天能股份	92,664	2,057,140.80	0.03
502	603092	德力佳	24,500	1,322,265.00	0.02
503	001221	悍高集团	27,280	1,097,201.60	0.01
504	001386	马可波罗	73,300	1,037,928.00	0.01
505	001248	华润新能源	84,104	850,291.44	0.01
506	688765	禾元生物	16,470	799,783.20	0.01
507	301666	大普微	1,220	565,262.60	0.01
508	688759	必贝特	12,552	384,718.80	0.00
509	688820	盛合晶微	2,391	338,302.59	0.00
510	688790	昂瑞微	2,319	293,237.55	0.00
511	688781	视涯科技	6,335	267,083.60	0.00
512	688808	联讯仪器	163	258,245.79	0.00
513	001399	惠科股份	6,488	179,912.24	0.00
514	688818	电科蓝天	1,717	120,430.38	0.00
515	301682	宏明电子	714	114,282.84	0.00

516	688797	臻宝科技	207	97,014.69	0.00
517	688712	北芯生命	1,500	53,880.00	0.00
518	688785	恒运昌	116	53,725.40	0.00
519	688813	泰金新能	234	40,269.06	0.00
520	688635	长进光子	128	39,448.32	0.00
521	001257	盛龙股份	1,743	36,149.82	0.00
522	603459	红板科技	330	27,825.60	0.00
523	001365	天海电子	719	22,511.89	0.00
524	688811	有研复材	834	20,124.42	0.00
525	301696	三瑞智能	216	18,748.80	0.00
526	001237	惠康科技	285	16,740.90	0.00
527	301669	高特电子	546	15,506.40	0.00
528	301687	新广益	195	15,167.10	0.00
529	001393	维通利	387	15,089.13	0.00
530	301531	春光集团	290	14,952.40	0.00
531	301599	理奇智能	433	14,059.51	0.00
532	301680	固德电材	117	13,122.72	0.00
533	301683	慧谷新材	96	11,689.92	0.00
534	688816	易思维	177	10,106.70	0.00
535	603407	长裕集团	137	10,064.02	0.00
536	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
537	920136	永励精密	300	5,784.00	0.00
538	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
539	603352	至信股份	112	2,858.24	0.00
540	920193	吉和昌	300	2,556.00	0.00
541	603293	埃泰克	72	2,442.96	0.00
542	001312	福恩股份	134	2,248.52	0.00
543	920189	康美特	200	1,628.00	0.00
544	603284	林平发展	46	1,604.02	0.00
545	001220	世盟股份	57	1,583.46	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	301308	江波龙	149,900,005.57	0.83
2	300751	迈为股份	104,802,633.04	0.58
3	688498	源杰科技	104,397,660.82	0.58
4	688525	佰维存储	102,869,749.79	0.57
5	300604	长川科技	94,730,382.22	0.52
6	001309	德明利	85,667,561.00	0.47
7	002281	光迅科技	77,138,375.50	0.43
8	688037	芯源微	71,532,545.52	0.40
9	002850	科达利	65,373,072.00	0.36
10	002008	大族激光	64,881,571.21	0.36
11	002738	中矿资源	62,505,148.88	0.35
12	300857	协创数据	61,791,531.55	0.34
13	300136	信维通信	61,399,019.46	0.34
14	300570	太辰光	58,652,997.20	0.32
15	001389	广合科技	56,622,821.23	0.31
16	300567	精测电子	54,359,609.48	0.30
17	300058	蓝色光标	50,814,160.68	0.28
18	002353	杰瑞股份	48,301,937.08	0.27
19	300054	鼎龙股份	47,852,636.56	0.26
20	300475	香农芯创	47,690,783.00	0.26

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	301308	江波龙	293,399,964.33	1.62
2	002353	杰瑞股份	200,726,038.54	1.11

3	300604	长川科技	182,215,318.01	1.01
4	002156	通富微电	172,883,468.00	0.96
5	000426	兴业银锡	172,159,187.92	0.95
6	300136	信维通信	165,018,223.57	0.91
7	002202	金风科技	161,483,003.38	0.89
8	300751	迈为股份	159,750,880.89	0.88
9	300857	协创数据	157,044,889.59	0.87
10	002008	大族激光	156,868,386.57	0.87
11	300450	先导智能	152,593,227.96	0.84
12	002281	光迅科技	150,770,747.00	0.83
13	002837	英维克	148,869,480.05	0.82
14	000657	中钨高新	148,303,977.36	0.82
15	002738	中矿资源	138,765,020.50	0.77
16	000933	神火股份	137,459,268.88	0.76
17	600487	亨通光电	134,923,435.39	0.75
18	300058	蓝色光标	133,575,575.44	0.74
19	002532	天山铝业	123,727,092.82	0.68
20	002558	巨人网络	120,544,017.49	0.67

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	8,109,553,368.41
卖出股票收入（成交）总额	14,652,916,342.59

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）	1,414,054.66	0.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,414,054.66	0.02

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	113704	春风转债	10,480	1,048,048.24	0.01
2	118071	华峰转债	3,660	366,006.42	0.00
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 本基金投资股指期货的投资政策

本基金为指数型基金，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，投资于以标的指数或与标的指数相关性较高的其他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 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 本报告期投资基金情况

7.12.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

7.13 投资组合报告附注

7.13.1 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。

7.13.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同约定的备选股票库。

7.13.3 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	27,126,197.66
2	应收清算款	34,979,800.71
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	62,105,998.37

7.13.4 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。

7.13.5 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。

7.13.6 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

持有人	户均持有	持有人结构
-----	------	-------

户数 (户)	的基金份 额	机构投资者		个人投资者		华夏中证 500ETF 联接	
		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额 比例
17,540	88,894.46	916,830,085.00	58.80%	178,972,126.00	11.48%	463,406,583.00	29.72%

注：本章节持有人户数合计按份额级别汇总，未予以合并剔重。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	-	-

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情况

项目	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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015 年 5 月 5 日）基金份额总额	2,134,473,505
本报告期期初基金份额总额	4,340,008,794
本报告期基金总申购份额	1,762,400,000
减：本报告期基金总赎回份额	4,543,200,000
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	1,559,208,794

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期末发生影响基金管理人经营或公募基金运营业务的诉讼。

本报告期无涉及基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

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、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人未受到调查或处罚。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人相关从业人员未受到调查或处罚。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的基金托管业务不涉及受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信证券	18	10,564,652,700.07	46.45%	1,013,433.50	46.45%	-
东吴证券	1	3,761,827,508.94	16.54%	360,779.45	16.54%	-
招商证券	2	2,886,107,745.44	12.69%	276,804.63	12.69%	-
广发证券	1	1,876,920,863.54	8.25%	180,078.80	8.25%	-
中国银河证券	5	1,268,957,625.45	5.58%	121,704.58	5.58%	-
方正证券	1	1,157,923,057.57	5.09%	111,071.76	5.09%	-
华泰证券	3	636,895,123.80	2.80%	61,109.09	2.80%	-
光大证券	5	422,944,611.30	1.86%	40,563.03	1.86%	-
中金公司	5	166,805,052.77	0.73%	15,999.38	0.73%	-

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，本基金还选择了东方证券、国盛证券、国泰海通证券、国投证券、华西证券、申万宏源证券、万联证券、粤开证券、浙商证券、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，东吴证券的交易单元为本基金本期新增的交易单元。本期没有剔除的券商交易单元。

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
中信证券	2,783,564.58	100.00%	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-	-	-

招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中国银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-

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	2026-01-22
2	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-03-26
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	2026-04-03
4	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-04-15
5	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-04-16
6	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-04-18
7	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资非公开发行股票的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-05-30
8	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-06-04
9	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-06-18
10	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-06-26

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比

		达到或者 超过 20% 的时间区 间					
华夏中 证 500ETF 联接	1	2026-04-30 至 2026-06-30	489,076,423.00	176,394,060.00	202,063,900.00	463,406,583.00	29.72%
产品特有风险							
本基金在报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额20%的情形，在市场流动性不足的情况下，如遇投资者巨额赎回或集中赎回，基金管理人可能无法以合理的价格及时变现基金资产，有可能对基金净值产生一定的影响，甚至可能引发基金的流动性风险。 在特定情况下，若持有基金份额占比较高的投资者大量赎回本基金，可能导致在其赎回后本基金资产规模持续低于正常运作水平，面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。							

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予基金注册的文件；
- 2、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。

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
二〇二六年八月三十一日