

华夏中证 A500 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：招商银行股份有限公司

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。

基金托管人招商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	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
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	16
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
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	16
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	16
§6 中期报告财务会计报告（未经审计）	17
6.1 资产负债表	17
6.2 利润表	18
6.3 净资产变动表	20
6.4 报表附注	21
§7 投资组合报告	51
7.1 期末基金资产组合情况	51
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	51
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	52
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	71
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	72
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	73
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	73
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	73
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	73
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	73
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	73
7.12 本报告期投资基金情况	74
7.13 投资组合报告附注	74

§8 基金份额持有人信息	75
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	75
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	75
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	75
§9 开放式基金份额变动	75
§10 重大事件揭示	75
10.1 基金份额持有人大会决议	75
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	76
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	76
10.4 基金投资策略的改变	76
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	76
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	76
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	76
10.8 其他重大事件	77
§11 影响投资者决策的其他重要信息	78
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	78
§12 备查文件目录	78
12.1 备查文件目录	78
12.2 存放地点	78
12.3 查阅方式	79

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华夏中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	华夏中证 A500ETF
场内简称	A500E（扩位证券简称：A500ETF 华夏）
基金主代码	512050
交易代码	512050
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2024 年 11 月 8 日
基金管理人	华夏基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	13,255,992,187.00 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	2024 年 11 月 15 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。本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。
投资策略	主要投资策略包括完全复制策略，替代性策略，存托凭证投资策略，金融衍生品投资策略，债券投资策略，可转换债券、可交换债券投资策略，资产支持证券投资策略，融资、转融通证券出借业务投资策略等。
业绩比较基准	中证 A500 指数收益率
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期风险和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	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李彬	张姗
	联系电话	400-818-6666	400-61-95555
	电子邮箱	service@ChinaAMC.com	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		400-818-6666	400-61-95555

传真	010-63136700	0755-83195201
注册地址	北京市顺义区安庆大街甲3号院	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
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	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
邮政编码	100101	518040
法定代表人	邹迎光	缪建民

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
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

§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	3,298,961,204.47
本期利润	3,110,775,682.78
加权平均基金份额本期利润	0.1326
本期加权平均净值利润率	10.68%
本期基金份额净值增长率	12.66%
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	3,698,626,928.83
期末可供分配基金份额利润	0.2790
期末基金资产净值	17,722,552,386.34
期末基金份额净值	1.3369
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	33.69%

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

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

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

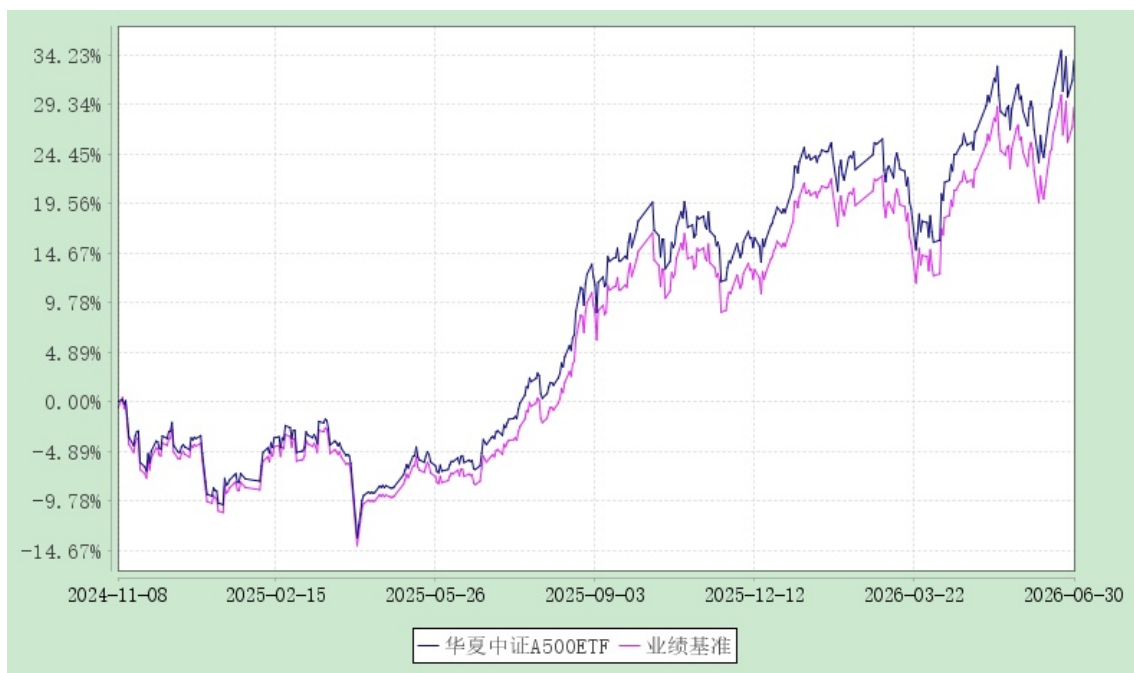
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	14.99%	1.40%	14.26%	1.41%	0.73%	-0.01%
过去六个月	12.66%	1.28%	11.91%	1.29%	0.75%	-0.01%
过去一年	38.63%	1.14%	36.38%	1.14%	2.25%	0.00%
自基金合同生效起至今	33.69%	1.12%	29.05%	1.13%	4.64%	-0.01%

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

华夏中证 A500 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
(2024 年 11 月 8 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		
李俊	本基金的基金经理	2024-11-08	-	18 年	硕士。曾任职于北京市金杜律师事务所证券部。2008 年 12 月加入华夏基金管理有限公司。历任数量投资部研究员、基金经理助理、华夏新趋势灵活配置混合型证券投资基金基金经理(2018 年 1 月 17 日至 2021 年 5 月 26 日期间)、华夏新锦绣灵活配置混合型证券投资基金基金经理(2019 年 1 月 31 日至 2021 年 5 月 26

					日期间)、华夏中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金基金经理(2019 年 9 月 17 日至 2021 年 12 月 13 日期间)、华夏中证全指证券公司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 3 日至 2021 年 12 月 13 日期间)、上证金融地产交易型开放式指数发起式证券投资基金基金经理 (2017 年 12 月 11 日至 2022 年 3 月 14 日期间)、华夏中证智能汽车主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理(2021 年 5 月 13 日至 2022 年 8 月 22 日期间)、上证医药卫生交易型开放式指数发起式证券投资基金基金经理 (2021 年 5 月 27 日至 2022 年 8 月 22 日期间)、华夏中证农业主题交易型开放式
--	--	--	--	--	---

					指数证券投资基金基金经理 (2021 年 12 月 29 日至 2024 年 5 月 31 日期间)、华夏中证新能源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 (2022 年 12 月 27 日至 2024 年 5 月 31 日期间)、华夏中证物联网主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理(2021 年 7 月 22 日至 2024 年 11 月 7 日期间)、华夏中证 A500 指数证券投资基金基金经理 (2024 年 10 月 31 日至 2024 年 11 月 17 日期间)、华夏中证全指房地产交易型开放式指数证券投资基金基金经理(2019 年 11 月 28 日至 2025 年 6 月 3 日期间)、华夏中证全指房地产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 11
--	--	--	--	--	--

					月 28 日至 2025 年 6 月 3 日期间)、华夏中证光伏产业指数发起式证券投资基金基金经理（2021 年 8 月 17 日至 2025 年 12 月 2 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《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，本基金管理人旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的交易共有 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 A500 指数，该指数从各行业选取市值较大、流动性较好的 500 只证券作为指数样本，以反映各行业最具代表性上市公司证券的整体表现。本基金主要采用完全复制法，即按照标的指数成份股及其权重构建基金的股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动对股票投资组合进行相应地调整。

2026 年，国际地缘政治格局急剧升温。美国率先对委内瑞拉发动军事打击，并强行控制该国总统，随后将冲突矛头转向中东，引爆美、以、伊三方直接对抗，地区战事迅速升级。进入 2 季度，地缘叙事虽由“冲突主导”切换为“谈判驱动”，但市场对安全局势走向仍保持高度警惕。在此轮冲突中，伊朗通过封锁霍尔木兹海峡推升油价，意图拉升美国通胀，客观上亦将全球拖入一场石油供应危机，对亚洲、欧洲等主要经济体形成明显冲击。受此影响，市场对美联储年内多次降息的预期迅速收敛，美联储政策立场也出现关键转折，6 月 FOMC 声明删除有关降息的前瞻指引，加息选项重新进入政策讨论范畴，但最终是否落地仍需综合权衡通胀走势、就业韧性及中期选举带来的政治压力三重变量。

国内方面，上半年经济运行总体平稳，但结构上延续外需偏强、内需偏弱的分化格局。1 季度中东局势持续升级对全球能源安全造成冲击，而我国电力供应以煤炭和新能源为主体，在此次石油危机中受到的直接冲击相对有限；但作为全球最大油气消费国之一，油气价格上涨仍将推升整体经济运行成本。2 季度随着中东转入谈判轨道，紧张局势有所缓解。当前经济运行的核心症结仍在于内需疲弱，而其深层根源依然指向就业压力与预期偏弱。4 月政治局会议明确“更加积极的财政政策”和“适度宽松的货币政策”的政策基调；汇率方面，人民币对一篮子货币保持稳中有升态势。

市场方面，年初在春季躁动情绪带动下，A 股持续上行，成交活跃，但在积累较大涨幅后资金开始流出，板块轮动特征显著。中东地缘局势升级后，滞涨隐忧与美联储降息预期减弱共同对市场形成较大压制。2 季度 A 股呈现极致分化格局，AI 科技主线条持续主导行情，资金向科技龙头高度集中抱团，对其他板块形成持续抑制，反映出增量资金局限于少数赛道，并造成明显的资金“抽水效应”，个别赛道交易拥挤度显著抬升。

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标的指数的投资策略。报告期内，本基金在紧密跟踪标的指数的基础上，认真应对投资者日常申购、赎回及成份股调整等工作。

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财通证券股份有限公司、长江证券股份有限公司、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、东吴证券股份有限公司、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、国泰海通证券股份有限公司、国投证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、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、中泰证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、华安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 1.3369 元，本报告期份额净值增长率为 12.66%，同期业绩比较基准增长率 11.91%。本基金本报告期跟踪偏离度为+0.75%，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

展望未来，国际格局正经历深刻调整，世界秩序的解构与重构不可逆转。外部环境的复杂性与不确定性显著上升，当此变局，中国经济的核心命题在于如何系统性提升自身抗风险能力与战略韧性，于动荡中筑牢发展之基。

国内方面，内需持续走弱的时间已较长，其内在原因值得深入剖析。若消费疲软仅为经济周期波动引发的阶段性现象，常规逆周期调节政策可逐步修复；但值得警惕的是，本轮消费低迷持续时间显著长于以往，这要求我们突破传统的供需调节框架，将视野拓展至社会预期管理、法治根基夯实以及长期发展动能的培育上。

与此同时，需高度警惕政策的“等效性”问题。历史经验表明，经济承压时期宽松政策的正面效应，常因行业监管或其他专项治理等领域政策的同步加码而被显著稀释。当下内需偏弱，尤其需要关注其他政策与稳增长之间的节奏错位，强化跨部门协调，确保宽松政策效能切实传导至实体经济。

当前人工智能发展如火如荼，但在技术爆发的前夜，最关键的因素并非某一家巨头的单点突破，而是能否构建一个足够庞大、活跃且具备自进化能力的创新生态。技术突破可以诞生于实验室，但产业革命必须根植于真实的市场土壤之中。在全球科技革命这场不进则退的竞赛中，若不能尽快扭转当前社会风险偏好偏低的状态，无法重燃市场主体敢于探索、勇于试错的冒险精神，无论是 AI 的产业化，还是产业的 AI 化，均有可能错失本轮产业革命的重大窗口期，并在激烈国际竞争中陷于被动。

市场方面，如果能切实出台稳定社会预期的政策，在未来人工智能的浪潮中，中国经济将有效激活内生潜力，凭借完备的产业链优势和庞大的数据资源禀赋，在全球 AI 竞争中抢占先机，实现从“技术追赶”向“生态引领”的跨越，切实将科技革命的潜力转化为国家竞争力和民生福祉的全面提升。届时，我们相信，无论是基于产业投资的 AI 相关板块，还是整体市场都会出现较好的投资机会。否则，如果整体社会风险偏好持续低迷，市场将面临较大压力，而业已拥挤的板块也终将难以持续。

我们将继续有效控制基金的跟踪偏离度和跟踪误差，以实现投资者获取指数投资收益及其他模式盈利的投资目标。同时，我们也将积极争取推动产品的进一步创新，充分发挥指数基金的功能，为各类投资者提供更多、更好的投资机会。

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

4.6 管理人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

托管人声明：

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

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

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

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

本中期报告中利润分配情况真实、准确。

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

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

§6 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 A500 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	421,781,192.55	339,164,210.57
结算备付金		86,163,046.47	35,577,186.92
存出保证金		59,790,868.80	25,481,584.80
交易性金融资产	6.4.7.2	17,193,356,037.62	41,742,461,593.73
其中：股票投资		17,192,478,997.25	41,742,461,593.73
基金投资		-	-
债券投资		877,040.37	-
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		-	3,023,717.48
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		17,761,091,145.44	42,145,708,293.50
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		26,307.02	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		2,250,771.69	3,573,443.94
应付托管费		750,257.24	1,191,147.98
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		748,305.98	62,134.97
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	34,763,117.17	107,181,668.92
负债合计		38,538,759.10	112,008,395.81
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	13,255,992,187.00	35,419,992,187.00
未分配利润	6.4.7.8	4,466,560,199.34	6,613,707,710.69
净资产合计		17,722,552,386.34	42,033,699,897.69
负债和净资产总计		17,761,091,145.44	42,145,708,293.50

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.3369 元，基金份额总额 13,255,992,187.00 份。

6.2 利润表

会计主体：华夏中证 A500 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		3,140,182,463.18	239,749,898.68
1.利息收入		406,349.34	151,584.43

其中：存款利息收入	6.4.7.9	406,349.34	151,584.43
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		3,292,237,437.77	-139,258,151.27
其中：股票投资收益	6.4.7.10	3,077,821,910.14	-339,888,619.12
基金投资收益	6.4.7.11	-	-
债券投资收益	6.4.7.12	39.11	213,472.71
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	36,876,244.32	-2,610,035.43
股利收益	6.4.7.16	177,539,244.20	203,027,030.57
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	-188,185,521.69	372,510,044.22
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	35,724,197.76	6,346,421.30
减：二、营业总支出		29,406,780.40	18,210,524.55
1.管理人报酬		21,864,468.46	13,512,508.71
2.托管费		7,288,156.15	4,504,169.57
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		132,961.71	3,198.38
8.其他费用	6.4.7.21	121,194.08	190,647.89
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		3,110,775,682.78	221,539,374.13
减：所得税费用		-	-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		3,110,775,682.78	221,539,374.13
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		3,110,775,682.78	221,539,374.13

6.3 净资产变动表

会计主体：华夏中证 A500 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	35,419,992,187.00	6,613,707,710.69	42,033,699,897.69
二、本期期初净资产	35,419,992,187.00	6,613,707,710.69	42,033,699,897.69
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-22,164,000,000.00	-2,147,147,511.35	-24,311,147,511.35
（一）、综合收益总额	-	3,110,775,682.78	3,110,775,682.78
（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）	-22,164,000,000.00	-5,257,923,194.13	-27,421,923,194.13
其中：1.基金申购款	20,133,000,000.00	4,859,839,192.59	24,992,839,192.59
2.基金赎回款	-42,297,000,000.00	-10,117,762,386.72	-52,414,762,386.72
（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	13,255,992,187.00	4,466,560,199.34	17,722,552,386.34
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	19,396,992,187.00	-985,380,436.85	18,411,611,750.15
二、本期期初净资产	19,396,992,187.00	-985,380,436.85	18,411,611,750.15
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-2,859,000,000.00	396,431,598.73	-2,462,568,401.27
（一）、综合收益总额	-	221,539,374.13	221,539,374.13
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-2,859,000,000.00	174,892,224.60	-2,684,107,775.40

其中：1.基金申购款	12,933,000,000.00	-803,161,977.35	12,129,838,022.65
2.基金赎回款	-15,792,000,000.00	978,054,201.95	-14,813,945,798.05
（三）、本期向基金份额持有人分配 利润产生的净资产变动(净资产减少 以“-”号填列)	-	-	-
四、本期期末净资产	16,537,992,187.00	-588,948,838.12	15,949,043,348.88

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 A500 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〔2024〕1521 号文《关于准予华夏中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》，由华夏基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《华夏中证 A500 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。本基金于 2024 年 11 月 5 日共募集 1,999,992,187.00 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）验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华夏中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2024 年 11 月 8 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,999,992,187.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 0.00 份基金份额。本基金的基金管理人为华夏基金管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和本基金基金合同的有关规定，本基金的标的指数为中证 A500 指数。本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，基金还可投资于非成份股（含科创板、创业板、存托凭证及其他中国证监会注册或核准上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、地方政府债券、可转换债券、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、金融衍生品（包括股指期货、股票期权、国债期货）、资产支持证券、货币市场工具（含同业存单、债券回购等）、银行存款以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金可根据法律法规的规定参与融资、转融通证券出借业务。

基金的投资组合比例为：本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%。本基金在每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金。其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布和修订的《企业会计准则——基本准则》、各项具体会计准则(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《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 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	10,105,289.11
等于：本金	10,104,565.25
加：应计利息	723.86
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	411,675,903.44
等于：本金	411,670,756.84
加：应计利息	5,146.60
合计	421,781,192.55

注：其他存款为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

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		15,667,824,750.87	-	17,192,478,997.25	1,524,654,246.38
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	877,000.00	40.37	877,040.37	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	877,000.00	40.37	877,040.37	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		15,668,701,750.87	40.37	17,193,356,037.62	1,524,654,246.38

注：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。

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	492,142,374.25	-	-	-
其中：股指期货	492,142,374.25	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	492,142,374.25	-	-	-

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
IF2607	沪深 300 期货 IF2607 合约	201	296,796,600.00	1,586,419.37
IC2607	中证 500 期货 IC2607 合约	39	69,639,960.00	3,160,936.38

IF2609	沪深 300 期货 IF2609 合约	40	58,197,600.00	-45,060.00
IF2608	沪深 300 期货 IF2608 合约	18	26,347,680.00	88,860.00
IC2609	中证 500 期货 IC2609 合约	15	26,284,200.00	816,120.00
IC2608	中证 500 期货 IC2608 合约	7	12,384,960.00	344,840.00
IM2608	中证 1000 期货 IM2608 合约	4	6,868,320.00	89,880.00
IM2607	中证 1000 期货 IM2607 合约	1	1,737,920.00	72,870.00
合计	-	-	-	6,114,865.75
减: 可抵销期货暂收款	-	-	-	6,114,865.75
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	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	171,699.25
可退替代款	3,182,464.45
应退替代款	30,881,298.42
其他	527,655.05
合计	34,763,117.17

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	35,419,992,187.00	35,419,992,187.00
本期申购	20,133,000,000.00	20,133,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-42,297,000,000.00	-42,297,000,000.00
本期末	13,255,992,187.00	13,255,992,187.00

注：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）。

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	4,558,351,607.95	2,055,356,102.74	6,613,707,710.69
本期期初	4,558,351,607.95	2,055,356,102.74	6,613,707,710.69
本期利润	3,298,961,204.47	-188,185,521.69	3,110,775,682.78
本期基金份额交易产生的变动数	-4,158,685,883.59	-1,099,237,310.54	-5,257,923,194.13

其中：基金申购款	3,637,714,772.40	1,222,124,420.19	4,859,839,192.59
基金赎回款	-7,796,400,655.99	-2,321,361,730.73	-10,117,762,386.72
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,698,626,928.83	767,933,270.51	4,466,560,199.34

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	12,614.56
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	68,909.47
结算备付金利息收入	324,825.31
其他	-
合计	406,349.34

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

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	2,375,029,070.74
股票投资收益——赎回差价收入	702,792,839.40
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	3,077,821,910.14

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	30,307,280,086.94
减：卖出股票成本总额	27,905,045,538.48

减：交易费用	27,205,477.72
买卖股票差价收入	2,375,029,070.74

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	52,414,762,386.72
减：现金支付赎回款总额	24,448,257,268.97
减：赎回股票成本总额	27,263,712,278.35
减：交易费用	-
赎回差价收入	702,792,839.40

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	39.11
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-
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	39.11

6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

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	36,876,244.32

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	177,539,244.20
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	177,539,244.20

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	-189,771,582.62
——股票投资	-189,771,582.62
——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	1,586,060.93
——权证投资	-
——期货投资	1,586,060.93

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	-188,185,521.69

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	35,724,197.76
合计	35,724,197.76

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	24,494.83
合计	121,194.08

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
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	基金托管人
华夏中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（“华夏中证 A500ETF 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
中信中证资本管理有限公司（“中信中证资本”）	基金管理人第一大股东的子公司
中信证券（山东）有限责任公司（“中信证券（山东）”）	基金管理人第一大股东的子公司

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（山东）	48,195,455,604.73	100.00%	15,734,789,269.32	100.00%

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（山东）	-	-	814,589.98	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（山东）	8,961,214.02	100.00%	-	-
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（山东）	2,925,951.86	100.00%	-	-

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	21,864,468.46	13,512,508.71
其中：应支付销售机构的客户维护费	278,991.02	591,777.69
应支付基金管理人的净管理费	21,585,477.44	12,920,731.02

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	7,288,156.15	4,504,169.57

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 A500ETF 联接	5,237,809,801.00	39.51%	6,216,849,523.00	17.55%
中信证券	22,384,282.00	0.17%	6,573,246,277.00	18.56%
中信中证资本	431,500.00	0.00%	3,806,336.00	0.01%

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		上年度可比期间	
	2026年1月1日至2026年6月30日		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
招商银行活期存款	10,105,289.11	12,614.56	3,495,677.89	6,388.79
中信证券（山东）券商存款	411,675,903.44	68,909.47	163,579,027.88	43,385.67

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

中信证券（山东）券商存款为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金，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

于 2026 年 6 月 30 日，本基金（因指数成份股包括中信证券而被动）持有的中信证券股票估值总额为 145,225,553.20 元，占基金资产净值的比例为 0.82%（2025 年 12 月 31 日，本基金（因指数成份股包括中信证券而被动）持有的中信证券股票估值总额为 408,573,790.02 元，占基金资产净值的比例为 0.97%）。

于 2026 年 6 月 30 日，本基金（因指数成份股包括招商银行而被动）持有的招商银行股票估值总额为 227,575,235.00 元，占基金资产净值的比例为 1.28%（2025 年 12 月 31 日，本基金（因指数成份股包括招商银行而被动）持有的招商银行股票估值总额为 759,061,526.50 元，占基金资产净值的比例为 1.81%）。

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	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
603986	兆易创新	2026-06-08	6 个月	大宗转让流通受限	452.68	725.31	25,000	11,317,000.00	18,132,750.00	-
688012	中微公司	2026-01-12	6 个月	大宗转让流	320.72	457.75	37,250	8,018,000.00	17,051,187.50	含证券送配

				通受限						
688012	中微公司	2026-01-16	6 个月	大宗转让 流通受限	341.32	455.96	37,250	8,533,000.00	16,984,510.00	含 证 券 送 配
688521	芯原股份	2026-02-03	6 个月	大宗转让 流通受限	201.85	350.71	40,000	8,074,000.00	14,028,400.00	-
688012	中微公司	2026-04-20	6 个月	大宗转让 流通受限	288.88	433.39	29,800	5,777,600.00	12,915,022.00	含 证 券 送 配
300757	罗博特科	2026-04-07	6 个月	大宗转让 流通受限	400.00	564.57	18,000	7,200,000.00	10,162,260.00	-
002938	鹏鼎控股	2026-05-22	6 个月	大宗转让 流通受限	92.59	94.95	100,000	9,259,000.00	9,495,000.00	-
688521	芯原	2026-02-10	6 个月	大宗	210.38	347.62	25,000	5,259,500.00	8,690,500.00	-

	股份			转 让 流 通 受 限						
688008	澜起科技	2026-05-29	6 个月	非公开 流通 受限	250.08	276.82	30,000	7,502,400.00	8,304,600.00	-
300088	长信科技	2026-01-26	6 个月	大宗 转 让 流 通 受 限	6.10	10.87	758,978	4,629,765.80	8,250,090.86	-
300442	润泽科技	2026-01-26	6 个月	大宗 转 让 流 通 受 限	73.26	79.88	100,000	7,326,000.00	7,988,000.00	-
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	-
300442	润泽科技	2026-01-22	6 个月	大宗 转 让 流 通 受 限	71.30	80.15	90,000	6,417,000.00	7,213,500.00	-
688047	龙芯	2026-01-26	6 个月	大宗	163.58	150.67	40,000	6,543,200.00	6,026,800.00	-

	中科			转 让 流 通 受 限						
301236	软 通 动 力	2026-01-13	6 个月	大 宗 转 让 流 通 受 限	48.50	41.27	140,000	6,790,000.00	5,777,800.00	-
300750	宁 德 时 代	2026-04-24	6 个月	非 公 开 流 通 受 限	410.34	373.17	15,000	6,155,100.00	5,597,550.00	-
688599	天 合 光 能	2026-03-06	6 个月	非 公 开 流 通 受 限	17.31	13.49	400,000	6,924,000.00	5,396,000.00	-
002044	美 年 健 康	2026-02-12	6 个月	大 宗 转 让 流 通 受 限	6.62	4.82	1,000,000	6,620,000.00	4,820,000.00	-
603260	合 盛 硅 业	2026-02-12	6 个月	大 宗 转 让 流 通 受 限	44.91	45.73	100,000	4,491,000.00	4,573,000.00	-

688047	龙芯中科	2026-01-30	6 个月	大宗转让流通受限	153.91	150.44	25,000	3,847,750.00	3,761,000.00	-
300383	光环新网	2026-04-09	6 个月	大宗转让流通受限	15.93	11.43	300,000	4,779,000.00	3,429,000.00	-
600233	圆通速递	2026-06-29	6 个月	大宗转让流通受限	14.25	14.93	220,000	3,135,000.00	3,284,600.00	-
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	-
301236	软通动力	2026-01-16	6 个月	大宗转让流通受限	45.50	41.13	60,000	2,730,000.00	2,467,800.00	-

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	华润新能源	2026-06-24	6 个月	新发流通受限	10.11	10.11	58,873	595,206.03	595,206.03	-
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	2026-04-16	6 个月	新发流	81.88	1,584.33	163	13,346.44	258,245.79	-

	器			通受限						
001248	华润新能源	2026-06-24	1 个月内(含)	新发流通受限	10.11	10.11	25,231	255,085.41	255,085.41	-
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	长进光子	2026-05-20	6 个月	新发流通受限	40.98	308.19	128	5,245.44	39,448.32	-
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	2026-05-15	6 个月	新发流	53.26	58.74	285	15,179.10	16,740.90	-

	技			通受限						
301669	高特电子	2026-06-02	6 个月	新发流通受限	7.08	28.40	546	3,865.68	15,506.40	-
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	8.52	8.52	300	2,556.00	2,556.00	-

				通受限						
603293	埃泰克	2026-04-09	6 个月	新发流通受限	33.49	33.93	72	2,411.28	2,442.96	-
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	100.00	100.00	8,770	877,000.00	877,040.37	期末估值

				受限						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

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
688072	拓荆科技	2026-06-29	重大事项	832.00	2026-07-13	890.99	102,697	36,786,756.46	85,443,904.00	-

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	17,192,478,997.25	97.01	41,742,461,593.73	99.31
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	877,040.37	0.00	-	-
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	17,193,356,037.62	97.01	41,742,461,593.73	99.31

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

②由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中证 A500 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%	-951,399,451.44	-2,211,627,123.08
	+5%	951,399,451.44	2,211,627,123.08

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	16,904,988,336.01
第二层次	87,181,203.81
第三层次	201,186,497.80
合计	17,193,356,037.62

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	17,192,478,997.25	96.80
	其中：股票	17,192,478,997.25	96.80
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	877,040.37	0.00
	其中：债券	877,040.37	0.00
	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	507,944,239.02	2.86
8	其他各项资产	59,790,868.80	0.34
9	合计	17,761,091,145.44	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	54,137,217.00	0.31
B	采矿业	706,888,146.31	3.99
C	制造业	12,162,996,994.71	68.63
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	374,985,187.16	2.12
E	建筑业	209,238,248.96	1.18
F	批发和零售业	132,480,821.61	0.75
G	交通运输、仓储和邮政业	378,979,861.99	2.14
H	住宿和餐饮业	8,036,357.00	0.05
I	信息传输、软件和信息技术服务业	961,974,409.63	5.43
J	金融业	1,664,180,447.36	9.39
K	房地产业	96,082,672.65	0.54
L	租赁和商务服务业	124,237,336.83	0.70
M	科学研究和技术服务业	205,403,681.18	1.16
N	水利、环境和公共设施管理业	29,498,248.02	0.17
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	5,754,780.00	0.03
Q	卫生和社会工作	33,420,224.48	0.19
R	文化、体育和娱乐业	13,174,430.00	0.07
S	综合	31,064,507.36	0.18
	合计	17,192,533,572.25	97.01

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	300308	中际旭创	578,100	734,187,000.00	4.14
2	300750	宁德时代	1,371,125	538,568,236.25	3.04
3	300502	新易盛	722,704	438,681,328.00	2.48
4	600519	贵州茅台	324,081	384,194,784.69	2.17
5	603986	兆易创新	346,200	279,910,750.00	1.58

6	601318	中国平安	5,521,188	263,581,515.12	1.49
7	688256	寒武纪	162,834	259,809,788.70	1.47
8	600036	招商银行	6,410,570	227,575,235.00	1.28
9	601899	紫金矿业	8,538,836	214,666,337.04	1.21
10	002371	北方华创	224,380	198,477,572.80	1.12
11	000333	美的集团	2,520,600	190,380,918.00	1.07
12	002475	立讯精密	2,643,800	186,123,520.00	1.05
13	688008	澜起科技	594,285	183,176,521.50	1.03
14	688012	中微公司	388,567	180,129,809.00	1.02
15	688041	海光信息	481,957	178,468,677.10	1.01
16	002384	东山精密	664,600	174,357,810.00	0.98
17	688981	中芯国际	1,056,147	167,737,266.54	0.95
18	600900	长江电力	6,334,863	167,683,823.61	0.95
19	000725	京东方 A	18,843,900	163,565,052.00	0.92
20	603259	药明康德	1,282,102	159,634,520.02	0.90
21	600030	中信证券	5,054,840	145,225,553.20	0.82
22	601166	兴业银行	8,768,333	145,203,594.48	0.82
23	300059	东方财富	6,561,600	133,725,408.00	0.75
24	600183	生益科技	755,169	130,946,304.60	0.74
25	600276	恒瑞医药	2,313,780	120,409,111.20	0.68
26	300274	阳光电源	752,336	119,636,470.72	0.68
27	601398	工商银行	16,755,816	118,463,619.12	0.67
28	300408	三环集团	695,398	116,061,926.20	0.65
29	002594	比亚迪	1,408,400	112,249,480.00	0.63
30	600487	亨通光电	1,022,894	111,843,229.96	0.63
31	300476	胜宏科技	316,600	109,679,738.00	0.62
32	002463	沪电股份	698,280	106,697,184.00	0.60
33	601211	国泰海通	5,851,401	106,495,498.20	0.60
34	300394	天孚通信	339,292	102,696,902.56	0.58
35	688498	源杰科技	51,519	97,164,834.00	0.55

36	688525	佰维存储	195,561	96,749,893.53	0.55
37	000988	华工科技	521,395	96,254,730.95	0.54
38	301308	江波龙	131,600	92,620,080.00	0.52
39	600176	中国巨石	1,244,762	90,718,254.56	0.51
40	601288	农业银行	14,876,663	90,301,344.41	0.51
41	601328	交通银行	13,812,303	88,813,108.29	0.50
42	000651	格力电器	2,322,900	87,108,750.00	0.49
43	600522	中天科技	1,415,414	85,887,321.52	0.48
44	688072	拓荆科技	102,697	85,443,904.00	0.48
45	603019	中科曙光	755,595	81,022,451.85	0.46
46	688521	芯原股份	218,100	79,540,434.00	0.45
47	603993	洛阳钼业	4,525,694	79,425,929.70	0.45
48	600150	中国船舶	2,340,126	79,072,857.54	0.45
49	300604	长川科技	230,200	78,594,884.00	0.44
50	600887	伊利股份	3,275,445	78,479,662.20	0.44
51	600584	长电科技	742,124	76,846,940.20	0.43
52	000338	潍柴动力	2,786,471	75,931,334.75	0.43
53	000858	五粮液	1,006,101	74,451,474.00	0.42
54	688347	华虹宏力	211,370	71,083,731.00	0.40
55	601816	京沪高铁	15,205,352	68,880,244.56	0.39
56	600309	万华化学	973,692	66,610,269.72	0.38
57	688120	华海清科	205,167	66,100,704.06	0.37
58	300124	汇川技术	982,500	65,169,225.00	0.37
59	002415	海康威视	1,900,327	64,991,183.40	0.37
60	002916	深南电路	141,187	64,649,527.30	0.36
61	002281	光迅科技	250,987	64,488,599.78	0.36
62	002008	大族激光	427,097	64,111,530.67	0.36
63	600111	北方稀土	1,310,831	62,985,429.55	0.36
64	000100	TCL 科技	10,703,400	62,293,788.00	0.35
65	000063	中兴通讯	1,670,400	60,451,776.00	0.34

66	300857	协创数据	177,500	60,332,250.00	0.34
67	300136	信维通信	501,556	59,810,553.00	0.34
68	600000	浦发银行	6,904,413	59,446,995.93	0.34
69	600089	特变电工	2,618,687	58,920,457.50	0.33
70	601857	中国石油	6,713,381	58,272,147.08	0.33
71	002028	思源电气	322,800	55,844,400.00	0.32
72	601088	中国神华	1,423,850	55,587,104.00	0.31
73	300433	蓝思科技	1,032,000	55,377,120.00	0.31
74	600031	三一重工	3,071,539	53,076,193.92	0.30
75	300014	亿纬锂能	788,600	51,282,658.00	0.29
76	300475	香农芯创	170,402	51,120,600.00	0.29
77	002050	三花智控	1,160,600	50,869,098.00	0.29
78	601601	中国太保	1,772,890	50,562,822.80	0.29
79	000001	平安银行	5,029,800	50,549,490.00	0.29
80	300223	北京君正	200,544	49,915,401.60	0.28
81	000792	盐湖股份	1,645,900	49,689,721.00	0.28
82	002714	牧原股份	1,415,900	49,542,341.00	0.28
83	600549	厦门钨业	576,100	49,083,720.00	0.28
84	002353	杰瑞股份	318,500	48,571,250.00	0.27
85	002156	通富微电	629,344	47,748,329.28	0.27
86	600406	国电南瑞	2,080,799	47,546,257.15	0.27
87	601668	中国建筑	10,704,861	46,459,096.74	0.26
88	000657	中钨高新	472,500	45,227,700.00	0.26
89	002436	兴森科技	881,000	44,886,950.00	0.25
90	601919	中远海控	3,250,414	43,100,489.64	0.24
91	002602	世纪华通	3,056,700	43,099,470.00	0.24
92	300760	迈瑞医疗	314,300	42,691,369.00	0.24
93	601988	中国银行	7,413,618	42,405,894.96	0.24
94	300054	鼎龙股份	395,200	41,879,344.00	0.24
95	600660	福耀玻璃	830,265	41,878,566.60	0.24

96	601728	中国电信	8,038,844	41,721,600.36	0.24
97	603501	豪威集团	439,255	41,663,336.75	0.24
98	601012	隆基绿能	3,141,889	41,221,583.68	0.23
99	601225	陕西煤业	2,010,275	40,909,096.25	0.23
100	002230	科大讯飞	996,100	40,680,724.00	0.23
101	600941	中国移动	467,796	40,291,269.48	0.23
102	600690	海尔智家	1,943,872	39,674,427.52	0.22
103	002352	顺丰控股	1,244,000	38,887,440.00	0.22
104	688777	中控技术	328,110	38,552,925.00	0.22
105	601985	中国核电	4,263,861	38,502,664.83	0.22
106	002460	赣锋锂业	585,560	38,295,624.00	0.22
107	002709	天赐材料	739,700	38,042,771.00	0.21
108	603799	华友钴业	786,651	37,963,777.26	0.21
109	300033	同花顺	156,089	37,617,449.00	0.21
110	000977	浪潮信息	532,800	37,296,000.00	0.21
111	600160	巨化股份	699,184	37,063,743.84	0.21
112	002938	鹏鼎控股	360,400	36,935,952.00	0.21
113	300757	罗博特科	60,800	36,655,460.00	0.21
114	002851	麦格米特	211,049	35,283,171.82	0.20
115	300442	润泽科技	425,400	34,756,178.00	0.20
116	000425	徐工机械	4,249,600	34,379,264.00	0.19
117	688126	沪硅产业	856,022	34,146,717.58	0.19
118	002202	金风科技	1,421,500	33,973,850.00	0.19
119	000938	紫光股份	1,176,400	33,950,904.00	0.19
120	601600	中国铝业	4,107,099	33,760,353.78	0.19
121	600028	中国石化	7,553,548	33,688,824.08	0.19
122	600938	中国海油	1,239,968	33,665,131.20	0.19
123	300346	南大光电	358,300	33,196,495.00	0.19
124	600460	士兰微	603,881	33,008,135.46	0.19
125	002466	天齐锂业	535,990	32,866,906.80	0.19

126	601766	中国中车	6,301,202	32,766,250.40	0.18
127	002600	领益智造	1,877,900	32,562,786.00	0.18
128	600050	中国联通	8,094,175	32,376,700.00	0.18
129	300661	圣邦股份	225,240	32,317,435.20	0.18
130	300567	精测电子	101,500	32,236,400.00	0.18
131	002837	英维克	396,277	31,527,798.12	0.18
132	002080	中材科技	347,958	31,316,220.00	0.18
133	002049	紫光国微	352,400	31,275,500.00	0.18
134	002407	多氟多	614,088	30,845,640.24	0.17
135	002185	华天科技	1,378,300	30,749,873.00	0.17
136	002138	顺络电子	418,000	30,555,800.00	0.17
137	601628	中国人寿	863,049	30,508,782.15	0.17
138	002179	中航光电	658,577	30,426,257.40	0.17
139	688002	睿创微纳	194,892	30,147,843.48	0.17
140	601100	恒立液压	278,049	29,906,950.44	0.17
141	000568	泸州老窖	381,500	29,573,880.00	0.17
142	601872	招商轮船	1,674,296	29,417,380.72	0.17
143	300395	菲利华	217,936	29,144,581.28	0.16
144	600879	航天电子	1,367,656	29,117,396.24	0.16
145	002241	歌尔股份	1,288,300	29,025,399.00	0.16
146	603288	海天味业	864,271	28,659,226.36	0.16
147	601006	大秦铁路	6,172,279	28,454,206.19	0.16
148	000408	藏格矿业	406,700	28,192,444.00	0.16
149	300390	天华新能	301,400	28,183,914.00	0.16
150	601658	邮储银行	5,711,620	28,158,286.60	0.16
151	605117	德业股份	263,978	28,029,184.04	0.16
152	688017	绿的谐波	66,400	27,745,904.00	0.16
153	688469	芯联集成	2,607,255	27,662,975.55	0.16
154	600905	三峡能源	7,402,872	27,464,655.12	0.15
155	600489	中金黄金	1,507,653	27,213,136.65	0.15

156	601888	中国中免	506,085	27,181,825.35	0.15
157	002625	光启技术	893,500	27,090,920.00	0.15
158	688396	华润微	275,408	26,866,050.40	0.15
159	000630	铜陵有色	4,170,700	26,525,652.00	0.15
160	600893	航发动力	690,857	26,487,457.38	0.15
161	600673	东阳光	780,092	26,195,489.36	0.15
162	600010	包钢股份	11,714,094	26,122,429.62	0.15
163	688271	联影医疗	256,337	25,948,994.51	0.15
164	601127	赛力斯	423,155	25,918,243.75	0.15
165	300058	蓝色光标	1,861,100	25,608,736.00	0.14
166	688111	金山办公	120,038	25,574,095.90	0.14
167	601689	拓普集团	450,429	25,413,204.18	0.14
168	300037	新宙邦	273,535	25,397,724.75	0.14
169	002027	分众传媒	5,240,500	25,364,020.00	0.14
170	002273	水晶光电	714,500	25,350,460.00	0.14
171	600118	中国卫星	306,499	25,148,242.95	0.14
172	600019	宝钢股份	4,516,530	24,524,757.90	0.14
173	300751	迈为股份	86,760	24,506,229.60	0.14
174	000426	兴业银锡	736,390	24,271,414.40	0.14
175	600760	中航沈飞	587,762	24,157,018.20	0.14
176	000807	云铝股份	1,078,600	23,880,204.00	0.13
177	601168	西部矿业	864,100	23,451,674.00	0.13
178	600362	江西铜业	537,816	23,287,432.80	0.13
179	600104	上汽集团	2,382,395	23,252,175.20	0.13
180	600989	宝丰能源	1,140,457	23,185,490.81	0.13
181	300450	先导智能	568,300	23,141,176.00	0.13
182	601727	上海电气	3,268,311	22,878,177.00	0.13
183	600875	东方电气	790,300	22,736,931.00	0.13
184	600988	赤峰黄金	862,587	22,703,289.84	0.13
185	002001	新和成	796,620	22,639,940.40	0.13

186	688099	晶晨股份	219,441	22,580,478.90	0.13
187	605589	圣泉集团	351,019	22,314,277.83	0.13
188	002422	科伦药业	577,200	22,233,744.00	0.13
189	600667	太极实业	759,036	22,148,670.48	0.12
190	600885	宏发股份	641,824	22,136,509.76	0.12
191	601390	中国中铁	5,305,537	22,124,089.29	0.12
192	000538	云南白药	462,460	21,906,730.20	0.12
193	002738	中矿资源	370,700	21,867,593.00	0.12
194	002126	银轮股份	439,000	21,862,200.00	0.12
195	000960	锡业股份	511,836	21,850,278.84	0.12
196	600392	盛和资源	726,869	21,638,890.13	0.12
197	600547	山东黄金	936,841	21,631,658.69	0.12
198	600795	国电电力	4,619,739	21,574,181.13	0.12
199	000831	中国稀土	385,100	21,369,199.00	0.12
200	600418	江淮汽车	817,874	21,125,685.42	0.12
201	600585	海螺水泥	1,242,801	21,065,476.95	0.12
202	601669	中国电建	4,462,661	20,974,506.70	0.12
203	002648	卫星化学	873,200	20,511,468.00	0.12
204	300316	晶盛机电	339,400	20,499,760.00	0.12
205	600141	兴发集团	436,087	20,483,006.39	0.12
206	002812	恩捷股份	305,500	20,441,005.00	0.12
207	002129	TCL 中环	1,676,700	20,153,934.00	0.11
208	600096	云天化	661,480	20,108,992.00	0.11
209	300015	爱尔眼科	2,417,100	19,965,246.00	0.11
210	301358	湖南裕能	262,300	19,900,701.00	0.11
211	601179	中国西电	1,328,581	19,822,428.52	0.11
212	300782	卓胜微	178,800	19,592,904.00	0.11
213	600346	恒力石化	1,094,713	19,387,367.23	0.11
214	601868	中国能建	7,247,359	19,350,448.53	0.11
215	600482	中国动力	587,901	19,283,152.80	0.11

216	002195	岩山科技	2,939,600	19,224,984.00	0.11
217	000066	中国长城	1,003,300	19,112,865.00	0.11
218	002558	巨人网络	689,600	19,005,376.00	0.11
219	600497	驰宏锌锗	1,567,740	18,985,331.40	0.11
220	300418	昆仑万维	466,300	18,819,868.00	0.11
221	600580	卧龙电驱	566,820	18,761,742.00	0.11
222	600066	宇通客车	688,561	18,460,320.41	0.10
223	000625	长安汽车	2,572,600	18,445,542.00	0.10
224	600426	华鲁恒升	767,516	18,358,982.72	0.10
225	600157	永泰能源	11,300,816	18,194,313.76	0.10
226	002532	天山铝业	1,679,600	18,022,108.00	0.10
227	600221	海航控股	13,323,300	17,986,455.00	0.10
228	000157	中联重科	2,574,900	17,947,053.00	0.10
229	600895	张江高科	481,700	17,943,325.00	0.10
230	688036	传音控股	298,376	17,589,265.20	0.10
231	600711	盛屯矿业	1,600,900	17,561,873.00	0.10
232	002340	格林美	2,645,000	17,483,450.00	0.10
233	300803	指南针	189,635	17,383,840.45	0.10
234	000933	神火股份	816,162	17,302,634.40	0.10
235	605499	东鹏饮料	140,152	17,298,961.36	0.10
236	600011	华能国际	2,278,036	17,290,293.24	0.10
237	600048	保利发展	3,723,064	17,237,786.32	0.10
238	600143	金发科技	1,108,360	17,124,162.00	0.10
239	600436	片仔癀	156,352	17,086,146.56	0.10
240	600438	通威股份	1,400,248	16,957,003.28	0.10
241	300017	网宿科技	1,293,700	16,831,037.00	0.09
242	600115	中国东航	4,412,740	16,812,539.40	0.09
243	002821	凯莱英	103,544	16,774,128.00	0.09
244	002236	大华股份	1,016,800	16,767,032.00	0.09
245	002493	荣盛石化	1,553,500	16,700,125.00	0.09

246	002131	利欧股份	3,510,400	16,674,400.00	0.09
247	600570	恒生电子	785,298	16,640,464.62	0.09
248	600886	国投电力	1,244,016	16,557,852.96	0.09
249	002456	欧菲光	1,740,700	16,467,022.00	0.09
250	600352	浙江龙盛	1,349,116	16,337,794.76	0.09
251	601233	桐昆股份	739,967	16,020,285.55	0.09
252	603659	璞泰来	553,735	16,019,553.55	0.09
253	003816	中国广核	4,078,100	15,945,371.00	0.09
254	300339	润和软件	412,800	15,896,928.00	0.09
255	688047	龙芯中科	103,987	15,817,919.29	0.09
256	601360	三六零	1,814,208	15,765,467.52	0.09
257	601058	赛轮轮胎	1,363,020	15,715,620.60	0.09
258	000301	东方盛虹	1,370,913	15,696,953.85	0.09
259	688213	思特威	145,950	15,626,866.50	0.09
260	600026	中远海能	864,500	15,509,130.00	0.09
261	300759	康龙化成	536,000	15,506,480.00	0.09
262	002074	国轩高科	561,600	15,449,616.00	0.09
263	688578	艾力斯	139,922	15,279,482.40	0.09
264	688235	百济神州	59,511	15,152,095.71	0.09
265	002555	三七互娱	802,700	15,146,949.00	0.09
266	300438	鹏辉能源	182,650	15,132,552.50	0.09
267	600009	上海机场	644,873	14,896,566.30	0.08
268	688122	西部超导	235,742	14,806,955.02	0.08
269	600196	复星医药	658,916	14,805,842.52	0.08
270	000768	中航西飞	720,800	14,761,984.00	0.08
271	000975	山金国际	862,300	14,659,100.00	0.08
272	601111	中国国航	2,416,224	14,618,155.20	0.08
273	300207	欣旺达	766,100	14,548,239.00	0.08
274	300001	特锐德	383,000	14,488,890.00	0.08
275	002472	双环传动	349,000	14,486,990.00	0.08

276	600029	南方航空	2,794,499	14,475,504.82	0.08
277	600415	小商品城	1,420,628	14,433,580.48	0.08
278	002517	恺英网络	886,000	14,397,500.00	0.08
279	600674	川投能源	1,010,071	14,312,706.07	0.08
280	002601	龙佰集团	865,200	14,258,496.00	0.08
281	603129	春风动力	55,700	14,248,060.00	0.08
282	600219	南山铝业	3,569,895	14,243,881.05	0.08
283	300458	全志科技	360,556	14,227,539.76	0.08
284	601186	中国铁建	2,382,209	14,174,143.55	0.08
285	002128	电投能源	612,400	14,158,688.00	0.08
286	002595	豪迈科技	300,628	14,009,264.80	0.08
287	601877	正泰电器	557,059	13,965,469.13	0.08
288	601117	中国化学	1,899,341	13,960,156.35	0.08
289	300115	长盈精密	492,000	13,746,480.00	0.08
290	600372	中航机载	1,253,583	13,601,375.55	0.08
291	002155	湖南黄金	567,040	13,535,244.80	0.08
292	301236	软通动力	322,000	13,424,500.00	0.08
293	600839	四川长虹	1,914,034	13,359,957.32	0.08
294	002465	海格通信	1,029,300	13,144,161.00	0.07
295	300568	星源材质	697,600	13,059,072.00	0.07
296	300454	深信服	134,300	12,919,660.00	0.07
297	300347	泰格医药	267,700	12,849,600.00	0.07
298	000963	华东医药	454,550	12,781,946.00	0.07
299	000547	航天发展	662,900	12,694,535.00	0.07
300	600741	华域汽车	817,150	12,682,168.00	0.07
301	002920	德赛西威	154,702	12,608,213.00	0.07
302	300024	机器人	649,200	12,549,036.00	0.07
303	688506	百利天恒	42,654	12,541,555.62	0.07
304	603650	彤程新材	127,795	12,521,354.10	0.07
305	002130	沃尔核材	653,100	12,382,776.00	0.07

306	002497	雅化集团	597,500	12,171,075.00	0.07
307	688676	金盘科技	143,006	12,104,027.84	0.07
308	300012	华测检测	872,400	12,091,464.00	0.07
309	688331	荣昌生物	92,313	12,024,691.38	0.07
310	001979	招商蛇口	1,869,500	12,020,885.00	0.07
311	000878	云南铜业	754,300	11,978,284.00	0.07
312	002432	九安医疗	169,100	11,951,988.00	0.07
313	300496	中科创达	191,500	11,832,785.00	0.07
314	002271	东方雨虹	990,600	11,758,422.00	0.07
315	300083	创世纪	863,000	11,754,060.00	0.07
316	002414	高德红外	885,500	11,741,730.00	0.07
317	000034	神州数码	421,700	11,702,175.00	0.07
318	300866	安克创新	111,190	11,619,355.00	0.07
319	601021	春秋航空	253,576	11,557,994.08	0.07
320	002444	巨星科技	371,500	11,553,650.00	0.07
321	300474	景嘉微	189,608	11,467,491.84	0.06
322	603979	金诚信	193,992	11,451,347.76	0.06
323	000733	振华科技	201,100	11,390,304.00	0.06
324	000661	长春高新	169,221	11,270,118.60	0.06
325	688266	泽璟制药	96,116	11,212,892.56	0.06
326	601319	中国人保	1,655,672	11,192,342.72	0.06
327	300763	锦浪科技	123,806	11,185,872.10	0.06
328	002756	永兴材料	195,635	11,080,766.40	0.06
329	300748	金力永磁	354,800	10,945,580.00	0.06
330	600699	均胜电子	506,056	10,935,870.16	0.06
331	002078	太阳纸业	869,200	10,856,308.00	0.06
332	601615	明阳智能	937,818	10,850,554.26	0.06
333	300073	当升科技	225,700	10,842,628.00	0.06
334	002025	航天电器	141,564	10,790,008.08	0.06
335	300142	沃森生物	829,100	10,770,009.00	0.06

336	601677	明泰铝业	644,611	10,700,542.60	0.06
337	300432	富临精工	531,780	10,683,460.20	0.06
338	603606	东方电缆	256,540	10,648,975.40	0.06
339	300919	中伟新材	243,160	10,638,250.00	0.06
340	000423	东阿阿胶	233,700	10,600,632.00	0.06
341	600039	四川路桥	1,351,988	10,572,546.16	0.06
342	603087	甘李药业	185,778	10,544,759.28	0.06
343	601800	中国交建	1,841,387	10,514,319.77	0.06
344	000002	万科 A	3,528,500	10,444,360.00	0.06
345	002252	上海莱士	2,392,300	10,382,582.00	0.06
346	600233	圆通速递	670,428	10,378,841.00	0.06
347	600226	亨通股份	1,079,300	10,350,487.00	0.06
348	688169	石头科技	107,564	10,215,353.08	0.06
349	688608	恒玄科技	61,083	10,212,466.77	0.06
350	300724	捷佳伟创	144,400	10,194,640.00	0.06
351	688223	晶科能源	2,129,386	10,114,583.50	0.06
352	688599	天合光能	728,605	10,035,902.60	0.06
353	002064	华峰化学	1,029,000	9,765,210.00	0.06
354	600588	用友网络	1,062,840	9,756,871.20	0.06
355	601633	长城汽车	646,200	9,751,158.00	0.06
356	001965	招商公路	1,056,700	9,679,372.00	0.05
357	688390	固德威	88,274	9,578,611.74	0.05
358	000786	北新建材	529,400	9,576,846.00	0.05
359	002831	裕同科技	267,163	9,500,316.28	0.05
360	688180	君实生物	278,099	9,405,308.18	0.05
361	300677	英科医疗	237,600	9,306,792.00	0.05
362	002294	信立泰	289,061	9,218,155.29	0.05
363	000519	中兵红箭	433,100	9,125,417.00	0.05
364	603806	福斯特	540,889	9,081,526.31	0.05
365	601618	中国中冶	3,699,817	9,027,553.48	0.05

366	600177	雅戈尔	1,197,405	9,016,459.65	0.05
367	600516	方大炭素	1,460,184	9,009,335.28	0.05
368	688188	柏楚电子	84,189	8,982,966.30	0.05
369	688065	凯赛生物	186,951	8,945,605.35	0.05
370	601607	上海医药	578,342	8,906,466.80	0.05
371	302132	中航成飞	152,400	8,887,968.00	0.05
372	300972	万辰集团	51,200	8,878,592.00	0.05
373	002176	江特电机	884,500	8,853,845.00	0.05
374	000623	吉林敖东	495,900	8,792,307.00	0.05
375	300699	光威复材	301,680	8,643,132.00	0.05
376	000617	中油资本	1,310,600	8,636,854.00	0.05
377	603260	合盛硅业	183,867	8,620,421.42	0.05
378	300832	新产业	203,699	8,555,358.00	0.05
379	002085	万丰奥威	770,500	8,544,845.00	0.05
380	300558	贝达药业	130,899	8,517,597.93	0.05
381	002318	久立特材	354,600	8,474,940.00	0.05
382	300251	光线传媒	760,300	8,431,727.00	0.05
383	002459	晶澳科技	1,029,500	8,338,950.00	0.05
384	002065	东华软件	1,163,100	8,304,534.00	0.05
385	300342	天银机电	176,225	8,282,575.00	0.05
386	300088	长信科技	759,072	8,251,181.26	0.05
387	600499	科达制造	596,200	8,227,560.00	0.05
388	002266	浙富控股	1,623,300	8,213,898.00	0.05
389	600085	同仁堂	355,150	8,207,516.50	0.05
390	688472	阿特斯	755,414	8,173,579.48	0.05
391	605090	九丰能源	219,500	8,158,815.00	0.05
392	600515	海南机场	2,961,338	8,114,066.12	0.05
393	603596	伯特利	325,450	8,084,178.00	0.05
394	300409	道氏技术	405,500	8,081,615.00	0.05
395	000400	许继电气	369,700	8,022,490.00	0.05

396	002223	鱼跃医疗	311,800	8,000,788.00	0.05
397	688617	惠泰医疗	43,870	7,965,037.20	0.04
398	002044	美年健康	1,623,200	7,954,696.00	0.04
399	002405	四维图新	1,228,900	7,950,983.00	0.04
400	301550	斯菱智驱	86,940	7,948,924.20	0.04
401	688005	容百科技	259,349	7,936,079.40	0.04
402	300003	乐普医疗	668,900	7,926,465.00	0.04
403	000032	深桑达 A	315,000	7,859,250.00	0.04
404	000415	渤海租赁	1,923,600	7,829,052.00	0.04
405	600521	华海药业	543,300	7,823,520.00	0.04
406	600862	中航高科	433,125	7,809,243.75	0.04
407	601216	君正集团	1,749,268	7,801,735.28	0.04
408	000683	博源化工	1,348,700	7,768,512.00	0.04
409	000999	华润三九	345,051	7,760,196.99	0.04
410	000039	中集集团	954,900	7,744,239.00	0.04
411	603766	隆鑫通用	638,300	7,614,919.00	0.04
412	600803	新奥股份	481,200	7,602,960.00	0.04
413	600704	物产中大	1,606,990	7,584,992.80	0.04
414	600312	平高电气	422,000	7,452,520.00	0.04
415	600018	上港集团	1,567,762	7,399,836.64	0.04
416	603605	珀莱雅	123,204	7,382,383.68	0.04
417	688795	摩尔线程	10,828	7,329,906.32	0.04
418	000887	中鼎股份	409,400	7,324,166.00	0.04
419	600332	白云山	363,982	7,294,199.28	0.04
420	600765	中航重机	563,152	7,275,923.84	0.04
421	000967	盈峰环境	690,000	7,265,700.00	0.04
422	688116	天奈科技	190,003	7,258,114.60	0.04
423	300122	智飞生物	620,400	7,252,476.00	0.04
424	600166	福田汽车	2,459,719	7,157,782.29	0.04
425	600153	建发股份	901,100	7,145,723.00	0.04

426	000830	鲁西化工	592,300	7,107,600.00	0.04
427	002410	广联达	856,300	6,987,408.00	0.04
428	600323	瀚蓝环境	253,499	6,961,082.54	0.04
429	002007	华兰生物	567,810	6,921,603.90	0.04
430	300896	爱美客	78,411	6,837,439.20	0.04
431	601799	星宇股份	74,065	6,711,770.30	0.04
432	688114	华大智造	129,496	6,614,655.68	0.04
433	603568	伟明环保	425,346	6,541,821.48	0.04
434	600398	海澜之家	1,243,005	6,500,916.15	0.04
435	002603	以岭药业	433,000	6,495,000.00	0.04
436	688009	中国通号	1,340,367	6,380,146.92	0.04
437	600486	扬农化工	125,748	6,375,423.60	0.04
438	601000	唐山港	1,534,390	6,367,718.50	0.04
439	601018	宁波港	2,016,400	6,351,660.00	0.04
440	002389	航天彩虹	357,400	6,350,998.00	0.04
441	600529	山东药玻	343,997	6,346,744.65	0.04
442	600208	衢州发展	2,205,364	6,241,180.12	0.04
443	000738	航发控制	340,900	6,235,061.00	0.04
444	600316	洪都航空	223,000	6,230,620.00	0.04
445	600008	首创环保	2,280,700	6,203,504.00	0.04
446	000932	华菱钢铁	1,776,100	6,163,067.00	0.03
447	600170	上海建工	2,761,012	6,129,446.64	0.03
448	600998	九州通	1,306,053	6,125,388.57	0.03
449	603486	科沃斯	120,000	6,090,000.00	0.03
450	600820	隧道股份	1,140,887	5,944,021.27	0.03
451	600161	天坛生物	512,247	5,931,820.26	0.03
452	300118	东方日升	472,800	5,886,360.00	0.03
453	601238	广汽集团	1,147,520	5,829,401.60	0.03
454	603885	吉祥航空	566,034	5,824,489.86	0.03
455	688303	大全能源	333,610	5,814,822.30	0.03

456	002607	中公教育	3,197,100	5,754,780.00	0.03
457	603816	顾家家居	255,298	5,708,463.28	0.03
458	603939	益丰药房	313,968	5,645,144.64	0.03
459	688166	博瑞医药	158,116	5,535,641.16	0.03
460	600763	通策医疗	162,346	5,500,282.48	0.03
461	601567	三星电气	364,296	5,442,582.24	0.03
462	600038	中直股份	212,594	5,376,502.26	0.03
463	300676	华大基因	151,786	5,321,617.16	0.03
464	300049	福瑞医科	136,800	5,318,784.00	0.03
465	603392	万泰生物	196,621	5,302,868.37	0.03
466	300573	兴齐眼药	129,645	5,284,330.20	0.03
467	601880	辽港股份	3,809,206	5,256,704.28	0.03
468	600535	天士力	387,257	5,123,410.11	0.03
469	600511	国药股份	195,388	5,087,903.52	0.03
470	600816	建元信托	2,038,812	4,974,701.28	0.03
471	300100	双林股份	177,900	4,942,062.00	0.03
472	002244	滨江集团	645,100	4,902,760.00	0.03
473	000833	粤桂股份	207,900	4,869,018.00	0.03
474	601155	新城控股	468,700	4,808,862.00	0.03
475	002120	韵达股份	751,500	4,779,540.00	0.03
476	688063	派能科技	89,105	4,746,623.35	0.03
477	300144	宋城演艺	816,300	4,742,703.00	0.03
478	000998	隆平高科	609,400	4,594,876.00	0.03
479	002544	普天科技	247,000	4,500,340.00	0.03
480	600064	南京高科	627,500	4,474,075.00	0.03
481	601866	中远海发	2,020,122	4,464,469.62	0.03
482	600635	大众公用	1,003,100	4,293,268.00	0.02
483	600754	锦江酒店	235,900	4,243,841.00	0.02
484	300457	赢合科技	200,700	4,230,756.00	0.02
485	000035	中国天楹	866,600	4,185,678.00	0.02

486	600655	豫园股份	1,007,400	4,140,414.00	0.02
487	300601	康泰生物	347,400	3,939,516.00	0.02
488	603899	晨光股份	189,878	3,917,183.14	0.02
489	600004	白云机场	534,372	3,879,540.72	0.02
490	600663	陆家嘴	611,800	3,842,104.00	0.02
491	600258	首旅酒店	347,300	3,792,516.00	0.02
492	600859	王府井	407,896	3,744,485.28	0.02
493	002091	江苏国泰	506,300	3,660,549.00	0.02
494	300070	碧水源	1,127,200	3,595,768.00	0.02
495	300383	光环新网	300,000	3,429,000.00	0.02
496	000069	华侨城 A	2,083,400	3,416,776.00	0.02
497	600864	哈投股份	647,035	3,358,111.65	0.02
498	301078	孩子王	458,900	3,102,164.00	0.02
499	688802	沐曦股份	3,994	3,070,946.66	0.02
500	002292	奥飞娱乐	459,900	3,016,944.00	0.02
501	603833	欧派家居	94,738	2,852,561.18	0.02
502	002891	中宠股份	100,100	2,674,672.00	0.02
503	600325	华发股份	1,141,339	2,636,493.09	0.01
504	688783	西安奕材	44,370	2,547,725.40	0.01
505	002572	索菲亚	299,500	2,186,350.00	0.01
506	001248	华润新能源	84,104	850,291.44	0.00
507	688765	禾元生物	16,470	799,783.20	0.00
508	301666	大普微	1,220	565,262.60	0.00
509	688759	必贝特	12,552	384,718.80	0.00
510	688820	盛合晶微	2,391	338,302.59	0.00
511	688790	昂瑞微	2,319	293,237.55	0.00
512	688781	视涯科技	6,335	267,083.60	0.00
513	688808	联讯仪器	163	258,245.79	0.00
514	001399	惠科股份	6,488	179,912.24	0.00
515	688818	电科蓝天	1,717	120,430.38	0.00

516	301682	宏明电子	714	114,282.84	0.00
517	688797	臻宝科技	207	97,014.69	0.00
518	688712	北芯生命	1,500	53,880.00	0.00
519	688785	恒运昌	116	53,725.40	0.00
520	688813	泰金新能	234	40,269.06	0.00
521	688635	长进光子	128	39,448.32	0.00
522	001257	盛龙股份	1,743	36,149.82	0.00
523	603459	红板科技	330	27,825.60	0.00
524	001365	天海电子	719	22,511.89	0.00
525	688811	有研复材	834	20,124.42	0.00
526	301696	三瑞智能	216	18,748.80	0.00
527	001237	惠康科技	285	16,740.90	0.00
528	301669	高特电子	546	15,506.40	0.00
529	301687	新广益	195	15,167.10	0.00
530	001393	维通利	387	15,089.13	0.00
531	301531	春光集团	290	14,952.40	0.00
532	301599	理奇智能	433	14,059.51	0.00
533	601112	振石股份	775	13,632.25	0.00
534	301680	固德电材	117	13,122.72	0.00
535	301683	慧谷新材	96	11,689.92	0.00
536	688816	易思维	177	10,106.70	0.00
537	603407	长裕集团	137	10,064.02	0.00
538	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
539	920136	永励精密	300	5,784.00	0.00
540	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
541	603352	至信股份	112	2,858.24	0.00
542	920193	吉和昌	300	2,556.00	0.00
543	603293	埃泰克	72	2,442.96	0.00
544	001312	福恩股份	134	2,248.52	0.00
545	920189	康美特	200	1,628.00	0.00

546	603284	林平发展	46	1,604.02	0.00
547	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	300750	宁德时代	783,132,272.16	1.86
2	002371	北方华创	560,165,416.41	1.33
3	300308	中际旭创	529,155,006.65	1.26
4	300502	新易盛	361,711,204.51	0.86
5	000333	美的集团	320,357,395.50	0.76
6	600519	贵州茅台	314,687,528.64	0.75
7	300394	天孚通信	311,389,049.67	0.74
8	300476	胜宏科技	261,574,946.72	0.62
9	300274	阳光电源	236,927,602.33	0.56
10	300059	东方财富	232,600,830.37	0.55
11	002475	立讯精密	231,339,029.02	0.55
12	002384	东山精密	209,874,019.88	0.50
13	688041	海光信息	203,355,434.84	0.48
14	002594	比亚迪	197,403,665.31	0.47
15	002028	思源电气	172,838,624.33	0.41
16	000651	格力电器	167,512,396.68	0.40
17	300604	长川科技	163,971,806.26	0.39
18	300760	迈瑞医疗	158,596,670.60	0.38
19	000725	京东方 A	148,791,120.00	0.35
20	002463	沪电股份	143,883,040.26	0.34

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	300750	宁德时代	1,769,200,219.41	4.21
2	300308	中际旭创	1,288,947,722.67	3.07
3	300502	新易盛	822,735,430.92	1.96
4	002371	北方华创	773,504,757.48	1.84
5	000333	美的集团	683,363,847.32	1.63
6	002475	立讯精密	507,898,885.96	1.21
7	300059	东方财富	480,816,810.03	1.14
8	300394	天孚通信	459,491,325.76	1.09
9	300274	阳光电源	446,827,570.24	1.06
10	002594	比亚迪	446,731,777.29	1.06
11	300476	胜宏科技	436,967,310.95	1.04
12	002384	东山精密	374,567,393.83	0.89
13	000651	格力电器	328,061,160.29	0.78
14	000858	五粮液	321,485,307.47	0.76
15	688256	寒武纪	320,729,618.17	0.76
16	000725	京东方 A	300,627,008.05	0.72
17	002028	思源电气	293,045,729.90	0.70
18	000338	潍柴动力	263,102,749.40	0.63
19	002463	沪电股份	260,056,804.76	0.62
20	300760	迈瑞医疗	257,651,736.96	0.61

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	17,912,995,297.99
卖出股票收入（成交）总额	30,307,280,086.94

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）	877,040.37	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	877,040.37	0.00

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	8,770	877,040.37	0.00
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 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 本基金投资的前十名证券的发行主体中，招商银行股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责、处罚的情况。本基金为指数型基金，采取完全复制策略，招商银行系标的指数成份股，上述股票的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

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	59,790,868.80
2	应收清算款	-
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	59,790,868.80

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	603986	兆易创新	18,132,750.00	0.10	大宗转让流通受限
2	300750	宁德时代	5,597,550.00	0.03	非公开流通受限

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		华夏中证 A500ETF 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
28,497	465,171.50	6,764,073,602.00	51.03%	1,254,108,784.00	9.46%	5,237,809,801.00	39.51%

注：本章节持有人户数合计按份额级别汇总，未予以合并别重。

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（2024 年 11 月 8 日）基金份额总额	1,999,992,187.00
本报告期期初基金份额总额	35,419,992,187.00
本报告期基金总申购份额	20,133,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	42,297,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	13,255,992,187.00

§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，基金托管人无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期未发生影响基金管理人经营或公募基金运营业务的诉讼。

本报告期内，无涉及基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金所聘用的会计师事务所未发生改变。

10.6 管理人、托管人及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，基金托管人相关从业人员没有受到监管部门调查或处罚。

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（山东）	14	48,195,455,604.73	100.00%	8,961,214.02	100.00%	-

注：①为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择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，本基金本报告期末选择其他交易单元作为本基金交易单元。
- ⑤在上述租用的券商交易单元中，中信证券（山东）的部分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（山东）	-	-	-	-	-	-	-	-

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
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	2026-06-18
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	2026-06-26

§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					报告期末持有基金份额	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份
华夏中证 A500ETF 联接	1	2026-02-02 至 2026-02-04,2026-02-09 至 2026-06-30	6,216,849,523.00	1,153,600,529.00	2,132,640,251.00	5,237,809,801.00	39

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