

华夏上证 580 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：中国工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。

基金托管人中国工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	15
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）	16
6.1 资产负债表	16
6.2 利润表	18
6.3 净资产变动表	19
6.4 报表附注	20
§7 投资组合报告	38
7.1 期末基金资产组合情况	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	39
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	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	59
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	61
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	62
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	62
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	62
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	62
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	62
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	62
7.12 本报告期投资基金情况	62
7.13 投资组合报告附注	63

§8 基金份额持有人信息	63
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	63
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	63
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	63
§9 开放式基金份额变动	64
§10 重大事件揭示	64
10.1 基金份额持有人大会决议	64
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	64
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	64
10.4 基金投资策略的改变	64
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	64
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	64
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	65
10.8 其他重大事件	66
§11 影响投资者决策的其他重要信息	66
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	66
§12 备查文件目录	67
12.1 备查文件目录	67
12.2 存放地点	67
12.3 查阅方式	67

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华夏上证 580 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	华夏上证 580ETF
场内简称	580ETF（扩位证券简称：上证 580ETF 华夏）
基金主代码	530530
交易代码	530530
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2025 年 8 月 20 日
基金管理人	华夏基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	125,460,000.00 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	2025 年 8 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。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，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	上证 580 指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华夏基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李彬	郭明
	联系电话	400-818-6666	010-66105799
	电子邮箱	service@ChinaAMC.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-818-6666	95588
传真		010-63136700	010-66105798

注册地址	北京市顺义区安庆大街甲3号院	北京市西城区复兴门内大街55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	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码	100101	100140
法定代表人	邹迎光	廖林

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券日报》
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	95,528,784.44
本期利润	99,192,234.16
加权平均基金份额本期利润	0.3892
本期加权平均净值利润率	33.46%
本期基金份额净值增长率	27.69%
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	41,898,542.41
期末可供分配基金份额利润	0.3340
期末基金资产净值	167,358,542.41
期末基金份额净值	1.3340
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	33.40%

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	23.63%	1.61%	22.36%	1.62%	1.27%	-0.01%
过去六个月	27.69%	1.63%	25.94%	1.65%	1.75%	-0.02%
自基金合同生效起至今	33.40%	1.44%	34.15%	1.46%	-0.75%	-0.02%

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

华夏上证 580 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
(2025 年 8 月 20 日至 2026 年 6 月 30 日)



注：①本基金合同于 2025 年 8 月 20 日生效。

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

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

华夏基金管理有限公司成立于 1998 年 4 月 9 日，是经中国证监会批准成立的首批全国性基金管理公司之一。公司总部设在北京，在北京、上海、深圳、成都、南京、杭州、广州、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，华夏聚源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	2025-08-20	-	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上证 580 指数，该指数从沪市证券中选取市值规模较小、流动性较好的 580 只证券作为样本，反映上海证券市场市值较小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东方证券股份有限公司、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 1.3340 元，本报告期份额净值增长率为 27.69%，同期业绩比较基准增长率 25.94%。本基金本报告期跟踪偏离度为+1.75%，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

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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

本报告期内，本基金的管理人——华夏基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人依法对华夏基金管理有限公司编制和披露的本基金 2026 年中期报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§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：华夏上证 580 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	1,107,858.34	22,721,381.98
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	166,406,125.67	628,236,443.70
其中：股票投资		166,208,116.85	628,157,794.32
基金投资		-	-
债券投资		198,008.82	78,649.38
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		-	133,768.62
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		167,513,984.01	651,091,594.30
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		3,466.14	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		23,847.77	60,177.51

应付托管费		7,949.24	20,059.15
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		0.26	0.22
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	120,178.19	5,940,645.91
负债合计		155,441.60	6,020,882.79
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	125,460,000.00	617,460,000.00
未分配利润	6.4.7.8	41,898,542.41	27,610,711.51
净资产合计		167,358,542.41	645,070,711.51
负债和净资产总计		167,513,984.01	651,091,594.30

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.3340 元，基金份额总额 125,460,000.00 份。

6.2 利润表

会计主体：华夏上证 580 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
一、营业总收入		99,573,218.68
1.利息收入		1,783.78
其中：存款利息收入	6.4.7.9	1,783.78
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）		94,939,959.30
其中：股票投资收益	6.4.7.10	93,913,207.80
基金投资收益	6.4.7.11	-

债券投资收益	6.4.7.12	147,471.22
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	-
股利收益	6.4.7.16	879,280.28
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	3,663,449.72
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	968,025.88
减：二、营业总支出		380,984.52
1.管理人报酬		224,226.44
2.托管费		74,742.12
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		0.10
8.其他费用	6.4.7.21	82,015.86
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		99,192,234.16
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		99,192,234.16
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		99,192,234.16

6.3 净资产变动表

会计主体：华夏上证 580 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	617,460,000.00	27,610,711.51	645,070,711.51
二、本期期初净资产	617,460,000.00	27,610,711.51	645,070,711.51
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-492,000,000.00	14,287,830.90	-477,712,169.10
（一）、综合收益总额	-	99,192,234.16	99,192,234.16
（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）	-492,000,000.00	-84,904,403.26	-576,904,403.26
其中：1.基金申购款	36,000,000.00	4,254,083.29	40,254,083.29
2.基金赎回款	-528,000,000.00	-89,158,486.55	-617,158,486.55
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	125,460,000.00	41,898,542.41	167,358,542.41

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

华夏上证 580 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〔2025〕1410 号文《关于准予华夏上证 580 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》、《华夏上证 580 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 2025 年 8 月 6 日至 2025 年 8 月 15 日共募集 368,460,000.00 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）安永华明（2025）验字第 70035283_A36 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华夏上证 580 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2025 年 8 月 20 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 368,460,000.00 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，基金托管人为中国工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上证 580 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）、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。

通常情况下，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	581,772.33
等于：本金	581,718.59
加：应计利息	53.74
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	526,086.01
等于：本金	526,075.53
加：应计利息	10.48

合计	1,107,858.34
----	--------------

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		143,618,123.45	-	166,208,116.85	22,589,993.40
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	198,000.00	8.82	198,008.82	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	198,000.00	8.82	198,008.82	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		143,816,123.45	8.82	166,406,125.67	22,589,993.40

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

无。

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	114,722.86
其他	5,455.33
合计	120,178.19

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	617,460,000.00	617,460,000.00
本期申购	36,000,000.00	36,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-528,000,000.00	-528,000,000.00
本期末	125,460,000.00	125,460,000.00

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	17,481,185.82	10,129,525.69	27,610,711.51
本期期初	17,481,185.82	10,129,525.69	27,610,711.51
本期利润	95,528,784.44	3,663,449.72	99,192,234.16
本期基金份额交易产生的变动数	-63,022,454.48	-21,881,948.78	-84,904,403.26
其中：基金申购款	2,224,325.38	2,029,757.91	4,254,083.29
基金赎回款	-65,246,779.86	-23,911,706.69	-89,158,486.55
本期已分配利润	-	-	-
本期末	49,987,515.78	-8,088,973.37	41,898,542.41

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	1,159.01
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	624.77
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	1,783.78

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	20,488,435.19
股票投资收益——赎回差价收入	73,424,772.61
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	93,913,207.80

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	114,866,483.81
减：卖出股票成本总额	94,253,612.57
减：交易费用	124,436.05
买卖股票差价收入	20,488,435.19

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	617,158,486.55
减：现金支付赎回款总额	892,403.18
减：赎回股票成本总额	542,841,310.76
减：交易费用	-
赎回差价收入	73,424,772.61

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	26.44
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	147,444.78
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	147,471.22

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	323,480.49
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	176,000.00
减：应计利息总额	22.74
减：交易费用	12.97
买卖债券差价收入	147,444.78

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

无。

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	879,280.28
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	879,280.28

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	3,663,449.72
——股票投资	3,692,094.72
——债券投资	-28,645.00
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-

减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值 税	-
合计	3,663,449.72

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	968,025.88
合计	968,025.88

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	22,315.49
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	193.00
合计	82,015.86

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
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	基金托管人
华夏上证 580 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(“华夏上证 580ETF 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

无。

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 债券交易

无。

6.4.10.1.4 债券回购交易

无。

6.4.10.1.5 基金交易

无。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	224,226.44
其中：应支付销售机构的客户维护费	5,201.02
应支付基金管理人的净管理费	219,025.42

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
当期发生的基金应支付的托管费	74,742.12

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
华夏上证 580ETF 联接	112,085,800.00	89.34%	581,000,000.00	94.10%

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	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行活期存款	581,772.33	1,159.01

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国工商银行保管，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	688785	恒运昌	新股发行	1,155	106,467.90
中信证券	688820	盛合晶微	新股发行	4,131	81,298.08
中信证券	688808	联讯仪器	新股发行	696	56,988.48
中信证券	688811	有研复材	新股发行	8,337	53,440.17
中信证券	688797	臻宝科技	新股发行	828	36,895.68

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
688808	联讯	2026-0	6 个月	新发	81.88	1,584.3	70	5,731.6	110,90	-

	仪器	4-16		流通 受限		3		0	3.10	
688818	电科 蓝天	2026-0 2-03	6 个月	新发 流通 受限	9.47	70.14	1,236	11,704. 92	86,693. 04	-
688820	盛合 晶微	2026-0 4-13	6 个月	新发 流通 受限	19.68	141.49	414	8,147.5 2	58,576. 86	-
688785	恒运 昌	2026-0 1-20	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	2026-0 3-24	6 个月	新发 流通 受限	26.28	172.09	228	5,991.8 4	39,236. 52	-
688797	臻宝 科技	2026-0 6-16	6 个月	新发 流通 受限	44.56	468.67	83	3,698.4 8	38,899. 61	-
688635	长进 光子	2026-0 5-20	6 个月	新发 流通 受限	40.98	308.19	104	4,261.9 2	32,051. 76	-
688811	有研 复材	2026-0 4-01	6 个月	新发 流通 受限	6.41	24.13	834	5,345.9 4	20,124. 42	-
603459	红板 科技	2026-0 3-31	6 个月	新发 流通 受限	17.70	84.32	191	3,380.7 0	16,105. 12	-
603407	长裕 集团	2026-0 4-29	6 个月	新发 流通 受限	13.86	73.46	137	1,898.8 2	10,064. 02	-
688816	易思 维	2026-0 2-04	6 个月	新发 流通 受限	55.95	57.10	164	9,175.8 0	9,364.4 0	-
601112	振石 股份	2026-0 1-21	6 个月	新发 流通 受限	11.18	17.59	523	5,847.1 4	9,199.5 7	-
603435	嘉德 利	2026-0 5-15	6 个月	新发 流通 受限	15.76	46.71	104	1,639.0 4	4,857.8 4	-
603352	至信 股份	2026-0 1-08	6 个月	新发 流通 受限	21.88	25.52	104	2,275.5 2	2,654.0 8	-
603293	埃泰 克	2026-0 4-09	6 个月	新发 流通 受限	33.49	33.93	51	1,707.9 9	1,730.4 3	-

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	-
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
110101	宝钛转债	2026-06-24	1 个月内(含)	新发流通受限	100.00	100.00	920	92,000.00	92,001.41	期末估值单价为含息价格
113705	豪 26 转债	2026-06-15	1 个月内(含)	新发流通受限	100.00	100.01	610	61,000.00	61,004.28	期末估值单价为含息价格
113703	翔 26 转债	2026-06-08	1 个月内(含)	新发流通受限	100.00	100.01	250	25,000.00	25,002.52	期末估值单价为含息价格
118072	鼎通转债	2026-06-24	1 个月内(含)	新发流通受限	100.00	100.00	200	20,000.00	20,000.61	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

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
------	------	------	------	--------	------	--------	-------	--------	--------	----

601369	陕鼓动力	2026-06-29	重大事项	9.05	2026-07-13	9.96	26,030	248,819.27	235,571.50	-
--------	------	------------	------	------	------------	------	--------	------------	------------	---

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	166,208,116.85	99.31	628,157,794.32	97.38
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	198,008.82	0.12	78,649.38	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	166,406,125.67	99.43	628,236,443.70	97.39

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	除上证 580 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%	-9,130,977.64	-31,812,008.52
	+5%	9,130,977.64	31,812,008.52

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	165,476,755.16
第二层次	433,580.32
第三层次	495,790.19
合计	166,406,125.67

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	166,208,116.85	99.22
	其中：股票	166,208,116.85	99.22
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	198,008.82	0.12
	其中：债券	198,008.82	0.12
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-

6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,107,858.34	0.66
8	其他各项资产	-	-
9	合计	167,513,984.01	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	541,249.00	0.32
B	采矿业	1,583,114.60	0.95
C	制造业	124,714,382.00	74.52
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,282,914.00	2.56
E	建筑业	2,528,967.00	1.51
F	批发和零售业	2,949,526.00	1.76
G	交通运输、仓储和邮政业	4,593,156.48	2.74
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	14,183,583.42	8.47
J	金融业	3,195,577.60	1.91
K	房地产业	1,642,852.00	0.98
L	租赁和商务服务业	980,552.00	0.59
M	科学研究和技术服务业	2,851,829.75	1.70
N	水利、环境和公共设施管理业	1,133,109.00	0.68
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	1,027,304.00	0.61
S	综合	-	-
	合计	166,208,116.85	99.31

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	688766	普冉股份	3,782	2,899,281.20	1.73
2	688048	长光华芯	4,541	2,279,582.00	1.36
3	601208	东材科技	30,500	2,159,095.00	1.29
4	688627	精智达	2,893	2,068,495.00	1.24
5	605376	博迁新材	6,900	1,871,970.00	1.12
6	688167	炬光科技	4,800	1,700,208.00	1.02
7	600869	远东股份	50,200	1,680,194.00	1.00
8	688519	南亚新材	4,318	1,641,012.72	0.98
9	688141	杰华特	10,245	1,572,607.50	0.94
10	688548	广钢气体	29,815	1,553,361.50	0.93
11	600206	有研新材	22,300	1,485,180.00	0.89
12	600330	天通股份	46,500	1,434,060.00	0.86
13	603306	华懋科技	12,400	1,285,756.00	0.77
14	688025	杰普特	2,556	1,201,320.00	0.72
15	688403	汇成股份	29,775	1,182,067.50	0.71
16	688362	甬矽电子	11,899	1,147,063.60	0.69
17	688668	鼎通科技	3,011	1,124,006.30	0.67
18	603629	利通电子	5,900	1,054,979.00	0.63
19	603061	金海通	2,000	1,004,440.00	0.60
20	688257	新锐股份	9,365	954,293.50	0.57
21	688503	聚和材料	7,140	947,478.00	0.57
22	600552	凯盛科技	28,400	925,272.00	0.55
23	688372	伟测科技	4,967	923,862.00	0.55
24	603186	华正新材	4,100	923,730.00	0.55
25	688195	腾景科技	4,670	899,348.60	0.54
26	688545	兴福电子	6,750	898,155.00	0.54
27	688596	正帆科技	11,021	871,320.26	0.52

28	603929	亚翔集成	3,200	870,464.00	0.52
29	688300	联瑞新材	3,511	858,088.40	0.51
30	600353	旭光电子	18,700	852,720.00	0.51
31	688205	德科立	4,083	850,039.77	0.51
32	688549	中巨芯	22,153	815,451.93	0.49
33	688233	神工股份	3,726	798,928.92	0.48
34	603663	三祥新材	7,900	760,770.00	0.45
35	688531	日联科技	4,254	756,531.36	0.45
36	600186	莲花控股	54,000	756,000.00	0.45
37	600226	亨通股份	78,400	751,856.00	0.45
38	688652	京仪装备	3,673	735,224.41	0.44
39	600114	东睦股份	19,000	717,440.00	0.43
40	603738	泰晶科技	11,620	697,781.00	0.42
41	688102	斯瑞新材	14,675	692,366.50	0.41
42	603667	五洲新春	10,100	661,752.00	0.40
43	688392	骄成超声	2,908	660,639.44	0.39
44	688268	华特气体	2,454	656,445.00	0.39
45	600961	株冶集团	20,200	654,278.00	0.39
46	600410	华胜天成	41,200	652,196.00	0.39
47	688559	海目星	7,360	617,651.20	0.37
48	603124	江南新材	3,300	617,034.00	0.37
49	688028	沃尔德	3,860	601,658.20	0.36
50	688400	凌云光	8,955	592,821.00	0.35
51	688772	珠海冠宇	29,839	585,739.57	0.35
52	688502	茂莱光学	830	575,688.00	0.34
53	688535	华海诚科	3,073	574,651.00	0.34
54	600596	新安股份	35,600	568,176.00	0.34
55	688432	有研硅	14,123	564,496.31	0.34
56	600388	龙净环保	38,200	555,810.00	0.33
57	603026	石大胜华	6,200	554,094.00	0.33

58	688507	索辰科技	2,043	550,956.24	0.33
59	688059	华锐精密	2,736	546,406.56	0.33
60	603876	鼎胜新材	21,000	546,210.00	0.33
61	688097	博众精工	8,372	527,854.60	0.32
62	688359	三孚新科	2,656	527,056.64	0.31
63	603031	安孚科技	9,870	525,577.50	0.31
64	603936	博敏电子	19,400	518,174.00	0.31
65	603002	宏昌电子	21,400	517,238.00	0.31
66	688150	莱特光电	7,506	515,061.72	0.31
67	601678	滨化股份	77,400	510,066.00	0.30
68	688158	优刻得	13,847	509,015.72	0.30
69	688368	晶丰明源	2,347	508,172.44	0.30
70	601918	新集能源	58,500	502,515.00	0.30
71	688380	中微半导	7,456	491,424.96	0.29
72	600201	生物股份	41,900	488,135.00	0.29
73	688327	云从科技	39,167	488,020.82	0.29
74	601778	晶科科技	112,100	482,030.00	0.29
75	688401	路维光电	5,000	479,900.00	0.29
76	605020	永和股份	11,600	472,352.00	0.28
77	600531	豫光金铅	31,800	469,368.00	0.28
78	688319	欧林生物	10,668	469,178.64	0.28
79	688661	和林微纳	2,900	461,042.00	0.28
80	601975	招商南油	123,400	460,282.00	0.28
81	600155	华创云信	83,300	459,816.00	0.27
82	600877	电科芯片	26,700	457,371.00	0.27
83	688515	裕太微	1,813	451,001.88	0.27
84	688003	天准科技	3,533	449,750.90	0.27
85	688001	华兴源创	5,236	448,725.20	0.27
86	688332	中科蓝讯	2,795	440,212.50	0.26
87	603301	振德医疗	5,000	435,800.00	0.26

88	688262	国芯科技	10,061	434,937.03	0.26
89	688206	概伦电子	9,786	434,204.82	0.26
90	688352	硕中科技	17,904	432,918.72	0.26
91	603011	合锻智能	13,000	430,040.00	0.26
92	603078	江化微	8,700	429,954.00	0.26
93	600366	宁波韵升	29,000	425,720.00	0.25
94	600151	航天机电	37,800	424,116.00	0.25
95	600179	安通控股	95,500	420,200.00	0.25
96	603938	三孚股份	5,800	415,570.00	0.25
97	600063	皖维高新	54,500	414,200.00	0.25
98	601375	中原证券	103,800	414,162.00	0.25
99	603950	长源东谷	4,900	413,707.00	0.25
100	688275	万润新能	3,192	407,139.60	0.24
101	600550	保变电气	34,700	407,031.00	0.24
102	600345	长江通信	6,200	406,162.00	0.24
103	605289	罗曼股份	2,800	406,000.00	0.24
104	600872	中炬高新	23,300	404,488.00	0.24
105	600343	航天动力	14,400	403,488.00	0.24
106	688593	新相微	10,348	402,744.16	0.24
107	688726	拉普拉斯	7,575	400,338.75	0.24
108	688757	胜科纳米	5,998	400,066.60	0.24
109	688518	联赢激光	12,855	397,219.50	0.24
110	688279	峰昭科技	1,762	395,463.28	0.24
111	688603	天承科技	1,893	393,649.35	0.24
112	600986	浙文互联	55,900	390,182.00	0.23
113	688605	先锋精科	3,688	383,625.76	0.23
114	603358	华达科技	8,800	382,800.00	0.23
115	603800	洪田股份	4,700	382,063.00	0.23
116	600416	湘电股份	38,900	381,220.00	0.23
117	603203	快克智能	4,940	379,293.20	0.23

118	603662	柯力传感	5,300	377,201.00	0.23
119	603009	北特科技	7,800	374,166.00	0.22
120	600821	金开新能	59,300	370,625.00	0.22
121	603601	再升科技	30,100	369,628.00	0.22
122	688258	卓易信息	3,058	362,495.32	0.22
123	688508	芯朋微	3,870	359,755.20	0.21
124	600867	通化东宝	44,200	355,368.00	0.21
125	603859	能科科技	7,400	355,052.00	0.21
126	688353	华盛锂电	3,047	353,665.29	0.21
127	688031	星环科技	3,058	352,220.44	0.21
128	600184	光电股份	11,000	352,110.00	0.21
129	601333	广深铁路	127,700	351,175.00	0.21
130	601609	金田股份	32,500	351,000.00	0.21
131	605196	华通线缆	13,400	349,740.00	0.21
132	600458	时代新材	21,100	349,205.00	0.21
133	600739	辽宁成大	34,400	347,784.00	0.21
134	600728	佳都科技	80,200	341,652.00	0.20
135	688063	派能科技	6,404	341,141.08	0.20
136	603997	继峰股份	28,700	339,521.00	0.20
137	600490	鹏欣资源	58,300	339,306.00	0.20
138	688717	艾罗能源	4,103	338,784.71	0.20
139	603319	美湖股份	10,200	338,742.00	0.20
140	688239	航宇科技	5,660	338,637.80	0.20
141	688556	高测股份	25,025	332,332.00	0.20
142	600619	海立股份	20,800	329,680.00	0.20
143	688691	灿芯股份	2,820	326,922.60	0.20
144	688625	呈和科技	3,834	323,627.94	0.19
145	603323	苏农银行	83,580	323,454.60	0.19
146	688088	虹软科技	9,010	320,305.50	0.19
147	600267	海正药业	31,500	318,465.00	0.19

148	600133	东湖高新	40,200	317,580.00	0.19
149	603989	艾华集团	6,000	315,000.00	0.19
150	688382	益方生物	17,450	314,100.00	0.19
151	688798	艾为电子	4,279	313,736.28	0.19
152	600635	大众公用	72,800	311,584.00	0.19
153	601963	重庆银行	30,900	311,472.00	0.19
154	600702	舍得酒业	8,700	309,285.00	0.18
155	600320	振华重工	74,700	308,511.00	0.18
156	603698	航天工程	8,000	308,480.00	0.18
157	688321	微芯生物	11,670	307,271.10	0.18
158	600509	天富能源	36,200	305,890.00	0.18
159	688376	美埃科技	2,598	302,147.40	0.18
160	603638	艾迪精密	12,800	300,160.00	0.18
161	688261	东微半导	2,823	296,217.39	0.18
162	600456	宝钛股份	10,800	295,380.00	0.18
163	603589	口子窖	15,800	295,144.00	0.18
164	600908	无锡银行	57,800	293,624.00	0.18
165	688108	赛诺医疗	15,737	291,606.61	0.17
166	600391	航发科技	8,700	291,015.00	0.17
167	603858	步长制药	19,900	290,540.00	0.17
168	688567	孚能科技	27,587	289,663.50	0.17
169	688222	成都先导	8,996	288,861.56	0.17
170	688428	诺诚健华	10,051	286,151.97	0.17
171	688383	新益昌	1,505	283,000.20	0.17
172	688612	威迈斯	9,532	282,051.88	0.17
173	600528	中铁工业	41,800	275,462.00	0.16
174	600959	江苏有线	94,200	272,238.00	0.16
175	688107	安路科技	5,961	271,821.60	0.16
176	600859	王府井	29,600	271,728.00	0.16
177	688584	上海合晶	7,484	269,049.80	0.16

178	601860	紫金银行	110,300	266,926.00	0.16
179	600326	西藏天路	41,100	265,917.00	0.16
180	603757	大元泵业	3,500	265,160.00	0.16
181	601133	柏诚股份	6,000	264,240.00	0.16
182	600461	洪城环境	29,000	262,740.00	0.16
183	600629	华建集团	21,660	262,302.60	0.16
184	600113	浙江东日	7,900	262,122.00	0.16
185	600572	康恩贝	66,800	261,856.00	0.16
186	603337	杰克科技	7,200	260,856.00	0.16
187	600718	东软集团	36,000	260,640.00	0.16
188	688191	智洋创新	7,293	260,360.10	0.16
189	603220	中贝通信	12,100	258,577.00	0.15
190	600621	华鑫股份	20,000	258,400.00	0.15
191	600973	宝胜股份	36,218	256,785.62	0.15
192	688035	德邦科技	2,783	255,479.40	0.15
193	601005	重庆钢铁	219,200	254,272.00	0.15
194	688686	奥普特	1,506	253,595.34	0.15
195	688062	迈威生物	8,965	253,261.25	0.15
196	600361	创新新材	70,300	253,080.00	0.15
197	600478	科力远	50,200	253,008.00	0.15
198	600062	华润双鹤	15,700	251,828.00	0.15
199	600389	江山股份	12,900	251,808.00	0.15
200	688591	泰凌微	7,321	251,695.98	0.15
201	600835	上海机电	12,200	251,320.00	0.15
202	603297	永新光学	1,700	249,815.00	0.15
203	600022	山东钢铁	201,400	249,736.00	0.15
204	603530	神马电力	4,900	249,410.00	0.15
205	603713	密尔克卫	3,500	249,095.00	0.15
206	600797	浙大网新	38,700	247,680.00	0.15
207	600056	中国医药	28,100	245,875.00	0.15

208	600744	华银电力	38,200	245,626.00	0.15
209	600864	哈投股份	47,000	243,930.00	0.15
210	688049	炬芯科技	5,184	243,181.44	0.15
211	600645	中源协和	14,100	241,251.00	0.14
212	688386	泛亚微透	2,679	240,681.36	0.14
213	603985	恒润股份	10,000	240,200.00	0.14
214	688418	震有科技	4,979	239,390.32	0.14
215	600771	广誉远	18,400	238,280.00	0.14
216	600255	鑫科材料	68,000	236,640.00	0.14
217	600198	大唐电信	24,500	236,425.00	0.14
218	601619	嘉泽新能	54,900	236,070.00	0.14
219	601369	陕鼓动力	26,030	235,571.50	0.14
220	603328	依顿电子	18,800	235,564.00	0.14
221	688523	航天环宇	4,490	235,276.00	0.14
222	605305	中际联合	5,600	234,752.00	0.14
223	688277	天智航	13,724	234,680.40	0.14
224	688209	英集芯	8,062	234,442.96	0.14
225	603683	晶华新材	7,600	234,232.00	0.14
226	688202	美迪西	2,897	233,816.87	0.14
227	688306	均普智能	23,114	233,451.40	0.14
228	603977	国泰集团	14,000	231,140.00	0.14
229	603040	新坐标	3,660	230,836.20	0.14
230	600037	歌华有线	36,700	230,109.00	0.14
231	600480	凌云股份	27,600	229,356.00	0.14
232	601101	昊华能源	21,700	229,152.00	0.14
233	600623	华谊集团	28,300	228,381.00	0.14
234	688486	龙迅股份	3,590	228,252.20	0.14
235	688499	利元亨	4,338	227,961.90	0.14
236	603052	可川科技	2,800	226,772.00	0.14
237	600590	泰豪科技	22,400	226,240.00	0.14

238	600827	百联股份	30,200	223,782.00	0.13
239	600783	鲁信创投	11,200	223,104.00	0.13
240	603194	中力股份	6,100	223,016.00	0.13
241	600268	国电南自	19,100	221,942.00	0.13
242	688550	瑞联新材	3,808	220,292.80	0.13
243	688543	国科军工	5,577	220,012.65	0.13
244	600475	华光环能	14,400	219,600.00	0.13
245	688138	清溢光电	4,638	217,986.00	0.13
246	605507	国邦医药	14,680	217,264.00	0.13
247	603360	百傲化学	13,300	216,524.00	0.13
248	600203	福日电子	17,800	216,270.00	0.13
249	600587	新华医疗	18,200	216,216.00	0.13
250	688068	热景生物	2,495	216,067.00	0.13
251	603181	皇马科技	13,300	215,726.00	0.13
252	688611	杭州柯林	3,017	215,564.65	0.13
253	603118	共进股份	17,700	214,347.00	0.13
254	605123	派克新材	2,200	213,422.00	0.13
255	603809	豪能股份	24,300	213,111.00	0.13
256	600315	上海家化	12,600	211,932.00	0.13
257	600717	天津港	54,400	211,616.00	0.13
258	688787	海天瑞声	1,571	211,220.95	0.13
259	603887	城地香江	22,600	211,084.00	0.13
260	600651	飞乐音响	37,700	210,743.00	0.13
261	603039	泛微网络	5,840	210,648.80	0.13
262	600556	天下秀	47,600	210,392.00	0.13
263	688789	宏华数科	3,955	210,287.35	0.13
264	688325	赛微微电	1,607	209,568.87	0.13
265	603169	兰石重装	29,500	208,860.00	0.12
266	605133	嵘泰股份	5,300	208,661.00	0.12
267	688337	普源精电	2,780	208,305.40	0.12

268	600103	青山纸业	67,500	207,225.00	0.12
269	600779	水井坊	7,300	206,882.00	0.12
270	601890	亚星锚链	25,300	206,701.00	0.12
271	688153	唯捷创芯	6,420	206,210.40	0.12
272	688685	迈信林	3,750	205,875.00	0.12
273	600770	综艺股份	29,400	205,800.00	0.12
274	688698	伟创电气	3,912	205,184.40	0.12
275	601929	吉视传媒	92,000	205,160.00	0.12
276	600787	中储股份	49,000	204,820.00	0.12
277	605060	联德股份	3,600	204,264.00	0.12
278	605016	百龙创园	7,900	204,215.00	0.12
279	601568	北元化工	59,800	203,320.00	0.12
280	603686	福龙马	15,700	202,844.00	0.12
281	605168	三人行	4,000	202,560.00	0.12
282	605389	长龄液压	2,100	201,600.00	0.12
283	600420	国药现代	25,300	201,135.00	0.12
284	603533	掌阅科技	9,900	200,871.00	0.12
285	605128	上海沿浦	8,230	199,495.20	0.12
286	688165	埃夫特	9,743	198,757.20	0.12
287	600502	安徽建工	45,200	196,620.00	0.12
288	688155	先惠技术	2,429	196,481.81	0.12
289	600996	贵广网络	28,100	195,014.00	0.12
290	600158	中体产业	28,900	194,786.00	0.12
291	600094	大名城	56,000	193,760.00	0.12
292	600339	中油工程	63,100	193,717.00	0.12
293	603496	恒为科技	8,400	193,032.00	0.12
294	688125	安达智能	1,178	192,603.00	0.12
295	603826	坤彩科技	7,500	191,700.00	0.11
296	688182	灿勤科技	4,411	189,981.77	0.11
297	600710	苏美达	19,700	188,332.00	0.11

298	600789	鲁抗医药	27,500	187,275.00	0.11
299	600058	五矿发展	16,200	187,110.00	0.11
300	688510	航亚科技	7,830	186,980.40	0.11
301	688305	科德数控	2,864	186,933.28	0.11
302	600764	中国海防	10,700	186,501.00	0.11
303	688046	药康生物	7,688	186,049.60	0.11
304	600496	精工钢构	60,000	186,000.00	0.11
305	688160	步科股份	1,705	185,452.85	0.11
306	688226	威腾电气	4,320	185,025.60	0.11
307	600106	重庆路桥	40,100	183,658.00	0.11
308	688091	上海谊众	4,565	183,513.00	0.11
309	600266	城建发展	46,900	183,379.00	0.11
310	603171	税友股份	4,600	183,310.00	0.11
311	600686	金龙汽车	16,200	182,898.00	0.11
312	688710	益诺思	2,708	181,977.60	0.11
313	688788	科思科技	4,005	180,144.90	0.11
314	601969	海南矿业	22,500	177,975.00	0.11
315	603477	巨星农牧	11,900	176,120.00	0.11
316	603368	柳药集团	12,000	176,040.00	0.11
317	600059	古越龙山	24,000	175,680.00	0.10
318	600269	赣粤高速	44,000	175,120.00	0.10
319	603100	川仪股份	9,700	175,085.00	0.10
320	600125	铁龙物流	34,400	174,408.00	0.10
321	600736	苏州高新	26,000	173,940.00	0.10
322	600017	日照港	69,500	173,750.00	0.10
323	600108	亚盛集团	58,600	173,456.00	0.10
324	688660	电气风电	20,081	173,098.22	0.10
325	600654	中安科	65,000	172,900.00	0.10
326	688758	赛分科技	7,844	172,646.44	0.10
327	600575	淮河能源	54,000	172,260.00	0.10

328	688707	振华新材	13,405	172,254.25	0.10
329	603112	华翔股份	10,200	170,646.00	0.10
330	600664	哈药股份	56,900	170,131.00	0.10
331	603227	雪峰科技	24,200	169,884.00	0.10
332	601326	秦港股份	53,700	169,692.00	0.10
333	600775	南京熊猫	17,700	169,212.00	0.10
334	688210	统联精密	4,175	169,129.25	0.10
335	600751	海航科技	58,100	169,071.00	0.10
336	603668	天马科技	13,300	168,378.00	0.10
337	601200	上海环境	25,400	167,640.00	0.10
338	600757	长江传媒	22,800	166,668.00	0.10
339	600033	福建高速	51,600	166,152.00	0.10
340	688190	云路股份	1,813	164,457.23	0.10
341	600928	西安银行	50,200	164,154.00	0.10
342	600307	酒钢宏兴	117,800	163,742.00	0.10
343	688326	经纬恒润	2,304	163,307.52	0.10
344	603166	福达股份	12,200	163,114.00	0.10
345	600055	万东医疗	15,900	162,498.00	0.10
346	600649	城投控股	47,100	162,495.00	0.10
347	603992	松霖科技	5,000	162,000.00	0.10
348	605488	福莱新材	5,700	161,652.00	0.10
349	688583	思看科技	1,876	160,904.52	0.10
350	688007	光峰科技	12,089	160,783.70	0.10
351	601686	友发集团	33,200	160,356.00	0.10
352	605599	菜百股份	11,700	160,290.00	0.10
353	603197	保隆科技	5,700	159,258.00	0.10
354	600935	华塑股份	67,700	159,095.00	0.10
355	600597	光明乳业	26,000	157,820.00	0.09
356	600305	恒顺醋业	25,000	157,750.00	0.09
357	603072	天和磁材	4,000	156,800.00	0.09

358	600971	恒源煤电	22,700	156,630.00	0.09
359	603279	景津装备	13,000	156,000.00	0.09
360	688408	中信博	4,850	155,927.50	0.09
361	603033	三维股份	15,500	155,620.00	0.09
362	600611	大众交通	41,200	155,324.00	0.09
363	600006	东风股份	30,100	154,413.00	0.09
364	688621	阳光诺和	2,812	154,406.92	0.09
365	603508	思维列控	7,200	153,792.00	0.09
366	601163	三角轮胎	12,100	153,549.00	0.09
367	600882	妙可蓝多	9,600	153,504.00	0.09
368	603416	信捷电气	2,900	153,323.00	0.09
369	600501	航天晨光	9,700	152,581.00	0.09
370	688093	世华科技	4,109	151,622.10	0.09
371	600251	冠农股份	17,500	151,200.00	0.09
372	600557	康缘药业	12,800	150,656.00	0.09
373	603125	常青科技	4,600	150,604.00	0.09
374	688553	汇宇制药	14,153	150,446.39	0.09
375	603128	华贸物流	29,600	149,480.00	0.09
376	600592	龙溪股份	10,500	148,680.00	0.09
377	600252	中恒集团	83,800	147,488.00	0.09
378	600855	航天长峰	10,600	147,446.00	0.09
379	600163	中闽能源	28,600	147,290.00	0.09
380	603050	科林电气	7,500	146,700.00	0.09
381	688185	康希诺	2,876	146,647.24	0.09
382	688252	天德钰	6,086	146,064.00	0.09
383	600510	黑牡丹	19,400	144,724.00	0.09
384	605222	起帆电缆	6,200	144,584.00	0.09
385	601900	南方传媒	13,300	144,438.00	0.09
386	600966	博汇纸业	30,200	144,356.00	0.09
387	600477	杭萧钢构	62,100	143,451.00	0.09

388	688377	迪威尔	6,082	143,413.56	0.09
389	603969	银龙股份	19,700	143,219.00	0.09
390	600167	联美控股	25,600	143,104.00	0.09
391	600138	中青旅	21,700	141,701.00	0.08
392	601388	怡球资源	49,600	140,368.00	0.08
393	688513	苑东生物	3,191	140,276.36	0.08
394	688586	江航装备	11,892	139,017.48	0.08
395	603162	海通发展	15,484	138,891.48	0.08
396	688696	极米科技	2,150	138,761.00	0.08
397	600425	青松建化	42,400	138,648.00	0.08
398	605598	上海港湾	3,600	138,348.00	0.08
398	600812	华北制药	32,400	138,348.00	0.08
399	603223	恒通股份	10,600	138,330.00	0.08
400	605277	新亚电子	7,240	137,994.40	0.08
401	601789	宁波建工	34,400	137,944.00	0.08
402	600313	农发种业	26,300	137,812.00	0.08
403	601886	江河集团	17,100	137,313.00	0.08
404	600571	信雅达	14,000	136,500.00	0.08
405	600605	汇通能源	4,700	135,924.00	0.08
406	600708	光明地产	42,000	134,820.00	0.08
407	601579	会稽山	9,000	132,210.00	0.08
408	603861	白云电器	10,200	131,682.00	0.08
409	601096	宏盛华源	30,200	131,068.00	0.08
410	601500	通用股份	35,900	131,035.00	0.08
411	603367	辰欣药业	10,200	130,866.00	0.08
412	600682	南京新百	25,300	130,295.00	0.08
413	688658	悦康药业	10,081	129,641.66	0.08
414	605088	冠盛股份	4,600	129,628.00	0.08
415	688697	纽威数控	9,533	129,553.47	0.08
416	603131	上海沪工	7,600	129,352.00	0.08

417	600748	上实发展	34,700	129,084.00	0.08
418	603271	永杰新材	2,900	128,905.00	0.08
419	600693	东百集团	16,400	128,576.00	0.08
420	688365	光云科技	8,070	127,263.90	0.08
421	688776	国光电气	2,073	127,157.82	0.08
422	600810	神马股份	20,600	127,102.00	0.08
423	605198	安德利	2,000	126,720.00	0.08
424	603299	苏盐井神	14,400	126,576.00	0.08
425	688522	纳睿雷达	6,317	126,466.34	0.08
426	688443	智翔金泰	5,435	126,363.75	0.08
427	600780	通宝能源	21,500	125,990.00	0.08
428	603093	南华期货	6,900	125,235.00	0.07
429	688095	福昕软件	2,099	124,743.57	0.07
430	600020	中原高速	33,800	124,722.00	0.07
431	600468	百利电气	20,500	124,435.00	0.07
432	600284	浦东建设	25,600	124,416.00	0.07
433	600874	创业环保	23,100	123,816.00	0.07
434	600713	南京医药	24,600	123,000.00	0.07
435	600610	中毅达	18,700	122,485.00	0.07
436	603383	顶点软件	4,600	122,176.00	0.07
437	600975	新五丰	28,300	121,973.00	0.07
438	600894	广日股份	16,000	121,920.00	0.07
439	600742	富维股份	16,800	121,632.00	0.07
440	603229	奥翔药业	15,700	121,518.00	0.07
441	603636	南威软件	15,300	120,717.00	0.07
442	600963	岳阳林纸	39,700	120,688.00	0.07
443	601107	四川成渝	24,400	119,072.00	0.07
444	605319	无锡振华	5,240	118,895.60	0.07
445	603123	翠微股份	15,000	118,650.00	0.07
446	688351	微电生理	5,224	118,375.84	0.07

447	600639	浦东金桥	12,900	117,648.00	0.07
448	600576	祥源文旅	19,900	117,410.00	0.07
449	688311	盟升电子	4,474	117,174.06	0.07
450	600846	同济科技	11,700	117,000.00	0.07
451	600903	贵州燃气	17,500	116,200.00	0.07
452	601515	衢州东峰	36,300	116,160.00	0.07
452	600987	航民股份	19,200	116,160.00	0.07
453	600640	国脉文化	12,000	116,040.00	0.07
454	688750	金天钛业	6,960	115,744.80	0.07
455	603132	金徽股份	7,400	115,292.00	0.07
456	601339	百隆东方	17,000	115,090.00	0.07
457	603919	金徽酒	7,600	114,380.00	0.07
458	601177	杭齿前进	9,200	114,172.00	0.07
459	600997	开滦股份	23,900	113,525.00	0.07
460	600195	中牧股份	19,200	113,280.00	0.07
461	688230	芯导科技	1,434	113,013.54	0.07
462	600508	上海能源	15,280	112,613.60	0.07
463	601921	浙版传媒	16,800	112,392.00	0.07
464	688562	航天软件	7,447	112,151.82	0.07
465	600929	雪天盐业	24,700	112,138.00	0.07
466	688225	亚信安全	8,977	111,494.34	0.07
467	601226	华电科工	17,500	111,300.00	0.07
467	600643	爱建集团	30,000	111,300.00	0.07
468	603855	华荣股份	6,400	110,912.00	0.07
469	688808	联讯仪器	70	110,903.10	0.07
470	688577	浙海德曼	2,394	109,717.02	0.07
471	603257	中国瑞林	1,400	109,186.00	0.07
472	601801	皖新传媒	22,100	108,953.00	0.07
473	688626	翔宇医疗	2,459	108,835.34	0.07
474	601330	绿色动力	15,500	108,035.00	0.06

475	600990	四创电子	6,100	107,543.00	0.06
476	688539	高华科技	3,372	107,499.36	0.06
477	688128	中国电研	4,462	105,927.88	0.06
478	688639	华恒生物	6,544	105,620.16	0.06
479	600217	中再资环	37,400	105,468.00	0.06
480	603043	广州酒家	8,500	105,400.00	0.06
481	600604	市北高新	26,400	105,336.00	0.06
482	600335	国机汽车	22,400	104,832.00	0.06
483	603590	康辰药业	3,600	104,436.00	0.06
484	688552	航天南湖	3,687	103,715.31	0.06
485	600861	北京人力	8,500	103,700.00	0.06
486	600644	乐山电力	13,100	103,490.00	0.06
487	688656	浩欧博	1,065	103,060.05	0.06
488	600197	伊力特	10,700	102,720.00	0.06
489	603057	紫燕食品	4,600	102,580.00	0.06
490	600368	五洲交通	30,200	101,170.00	0.06
491	603327	福蓉科技	11,900	100,912.00	0.06
492	601949	中国出版	21,500	99,975.00	0.06
493	605056	咸亨国际	6,200	99,200.00	0.06
494	600826	兰生股份	11,100	97,569.00	0.06
495	600603	广汇物流	22,200	96,570.00	0.06
496	601083	锦江航运	9,700	96,418.00	0.06
497	600223	福瑞达	19,100	96,073.00	0.06
498	600841	动力新科	15,700	95,770.00	0.06
499	688648	中邮科技	2,613	95,505.15	0.06
500	600403	大有能源	18,000	95,220.00	0.06
501	688228	开普云	1,217	94,122.78	0.06
502	601968	宝钢包装	24,000	94,080.00	0.06
503	601008	连云港	23,300	93,666.00	0.06
504	605183	确成股份	6,300	92,862.00	0.06

505	603567	珍宝岛	21,200	92,856.00	0.06
506	603418	友升股份	2,100	92,757.00	0.06
507	600897	厦门空港	6,300	91,980.00	0.05
508	605555	德昌股份	7,300	91,250.00	0.05
509	603366	日出东方	12,300	89,421.00	0.05
510	600825	新华传媒	19,700	89,044.00	0.05
511	603866	桃李面包	24,100	88,688.00	0.05
512	603202	天有为	1,800	88,452.00	0.05
513	601089	福元医药	5,400	87,912.00	0.05
514	601512	中新集团	11,200	87,360.00	0.05
515	605116	奥锐特	4,600	87,032.00	0.05
516	601038	一拖股份	8,200	86,838.00	0.05
517	688818	电科蓝天	1,236	86,693.04	0.05
518	603098	森特股份	8,200	86,510.00	0.05
519	688276	百克生物	6,157	85,828.58	0.05
520	603193	润本股份	4,600	85,330.00	0.05
521	688109	品茗科技	1,121	84,859.70	0.05
522	603983	丸美生物	3,000	84,420.00	0.05
522	600618	氯碱化工	8,400	84,420.00	0.05
523	688232	新点软件	4,748	84,419.44	0.05
524	603693	江苏新能	6,700	84,353.00	0.05
525	688348	昱能科技	2,402	83,541.56	0.05
526	600724	宁波富达	16,300	82,641.00	0.05
527	605368	蓝天燃气	13,400	81,740.00	0.05
528	603312	西典新能	2,400	81,552.00	0.05
529	603173	福斯达	2,400	81,360.00	0.05
530	601116	三江购物	8,200	80,934.00	0.05
531	603055	台华新材	10,100	78,679.00	0.05
532	688177	百奥泰	4,573	76,917.86	0.05
533	600981	苏豪汇鸿	33,800	76,050.00	0.05

534	688136	科兴制药	3,666	75,922.86	0.05
535	600278	东方创业	12,900	75,852.00	0.05
536	603069	海汽集团	6,000	75,300.00	0.04
537	603121	华培动力	6,400	75,200.00	0.04
538	605009	豪悦护理	3,200	74,592.00	0.04
539	600657	信达地产	32,200	74,382.00	0.04
540	603248	锡华科技	3,460	72,971.40	0.04
541	601026	道生天合	5,000	72,900.00	0.04
542	603489	八方股份	2,600	72,696.00	0.04
543	603402	陕西旅游	1,200	70,980.00	0.04
544	605118	力鼎光电	2,000	69,780.00	0.04
545	605296	神农集团	2,500	69,700.00	0.04
546	605050	福然德	7,400	69,264.00	0.04
547	600746	江苏索普	13,200	69,036.00	0.04
548	600429	三元股份	16,900	68,276.00	0.04
549	601003	柳钢股份	19,700	66,389.00	0.04
550	603219	富佳股份	4,200	65,436.00	0.04
551	603275	众辰科技	1,700	64,719.00	0.04
552	603708	家家悦	7,300	62,634.00	0.04
553	603334	丰倍生物	1,700	60,401.00	0.04
554	603013	亚普股份	3,800	60,002.00	0.04
555	688820	盛合晶微	414	58,576.86	0.04
556	603395	红四方	2,900	58,000.00	0.03
557	603680	今创集团	5,900	57,879.00	0.03
558	600081	东风科技	6,300	57,204.00	0.03
559	605179	一鸣食品	4,500	56,565.00	0.03
560	688151	华强科技	3,771	56,074.77	0.03
561	605099	共创草坪	1,700	54,740.00	0.03
562	605365	立达信	3,800	54,644.00	0.03
563	601279	英利汽车	17,900	54,595.00	0.03

564	688785	恒运昌	116	53,725.40	0.03
565	603014	威高血净	1,600	52,368.00	0.03
566	603210	泰鸿万立	3,800	51,034.00	0.03
567	688196	卓越新能	1,401	50,295.90	0.03
568	601068	中铝国际	11,600	50,112.00	0.03
569	601086	国芳集团	7,500	49,725.00	0.03
570	605005	合兴股份	3,000	47,430.00	0.03
571	600828	茂业商业	13,100	46,898.00	0.03
572	603370	华新精科	1,300	46,774.00	0.03
573	605011	杭州热电	3,000	46,380.00	0.03
574	605286	同力天启	1,800	45,882.00	0.03
575	605188	国光连锁	3,800	44,422.00	0.03
576	603352	至信股份	1,704	44,302.08	0.03
577	603848	好太太	3,000	40,980.00	0.02
578	603103	横店影视	2,800	40,068.00	0.02
579	688813	泰金新能	228	39,236.52	0.02
580	603406	天富龙	1,500	38,925.00	0.02
581	688797	臻宝科技	83	38,899.61	0.02
582	688635	长进光子	104	32,051.76	0.02
583	603376	大明电子	1,200	29,736.00	0.02
584	688811	有研复材	834	20,124.42	0.01
585	603459	红板科技	191	16,105.12	0.01
586	603407	长裕集团	137	10,064.02	0.01
587	688816	易思维	164	9,364.40	0.01
588	601112	振石股份	523	9,199.57	0.01
589	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
590	603293	埃泰克	51	1,730.43	0.00
591	603284	林平发展	46	1,604.02	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	688766	普冉股份	3,936,891.59	0.61
2	688195	腾景科技	3,184,389.27	0.49
3	688048	长光华芯	3,141,125.57	0.49
4	688205	德科立	3,014,938.28	0.47
5	688372	伟测科技	2,511,872.32	0.39
6	688536	思瑞浦	2,427,260.96	0.38
7	688652	京仪装备	2,179,362.67	0.34
8	688519	南亚新材	2,159,261.29	0.33
9	688668	鼎通科技	1,657,786.20	0.26
10	688717	艾罗能源	1,569,162.71	0.24
11	688698	伟创电气	1,513,512.35	0.23
12	688531	日联科技	1,502,530.34	0.23
13	688270	ST 臻镭	1,493,271.17	0.23
14	688031	星环科技	1,364,645.94	0.21
15	688300	联瑞新材	1,308,422.61	0.20
16	688789	宏华数科	1,277,736.41	0.20
17	688627	精智达	1,261,367.46	0.20
18	688167	炬光科技	1,243,171.31	0.19
19	603516	淳中科技	1,239,668.00	0.19
20	600105	永鼎股份	1,188,274.00	0.18

注：“买入金额”按买入成交金额（成交价乘以成交数量）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	688498	源杰科技	12,365,474.73	1.92
2	600105	永鼎股份	2,909,128.00	0.45
3	688313	仕佳光子	2,276,408.72	0.35
4	688146	中船特气	2,178,565.65	0.34

5	603256	宏和科技	1,972,032.00	0.31
6	688025	杰普特	1,426,839.58	0.22
7	603308	应流股份	1,393,165.00	0.22
8	688536	思瑞浦	1,376,977.36	0.21
9	688409	富创精密	1,285,119.15	0.20
10	688167	炬光科技	1,203,553.49	0.19
11	688068	热景生物	1,161,082.12	0.18
12	688502	茂莱光学	1,106,096.80	0.17
13	688270	ST 臻镭	1,072,771.68	0.17
14	603119	浙江荣泰	1,072,026.40	0.17
15	600259	中稀有色	1,063,617.00	0.16
16	600595	中孚实业	952,369.00	0.15
17	688326	经纬恒润	949,622.42	0.15
18	600759	ST 洲际	874,037.00	0.14
19	603516	淳中科技	870,382.00	0.13
20	688332	中科蓝讯	857,081.66	0.13

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	143,631,548.57
卖出股票收入（成交）总额	114,866,483.81

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）	198,008.82	0.12
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	198,008.82	0.12

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	110101	宝钛转债	920	92,001.41	0.05
2	113705	豪 26 转债	610	61,004.28	0.04
3	113703	翔 26 转债	250	25,002.52	0.01
4	118072	鼎通转债	200	20,000.61	0.01
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

本基金本报告期末无股指期货投资。

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，南亚新材料科技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，南亚新材料系标的指数成份股，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

本基金本报告期末无其他资产。

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		华夏上证 580ETF 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
433	289,745.96	3,819,600.00	3.04%	9,554,600.00	7.62%	112,085,800.00	89.34%

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（2025 年 8 月 20 日）基金份额总额	368,460,000.00
本报告期期初基金份额总额	617,460,000.00
本报告期基金总申购份额	36,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	528,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	125,460,000.00

§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，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。

本报告期无涉及基金财产、无基金托管业务需要承担民事或刑事责任的诉讼事项。

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

本报告期内托管人无重大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

本报告期内托管人相关从业人员无重大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	
国信证券	6	257,667,919.76	100.00%	50,481.16	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，本基金本报告期未选择其他交易单元作为本基金交易单元。

⑤本报告期内，本基金租用的券商交易单元未发生变更。

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	债券交易	债券回购交易	权证交易	基金交易
-----	------	--------	------	------

称	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
国信证 券	323,480.49	100.00%	-	-	-	-	-	-

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调整旗下部分上交所 ETF 基金份额参考净值（IOPV）计算机构并修订基金合同、招募说明书的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-02-09
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	2026-04-18
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	2026-06-18

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
华夏上证 580E TF 联接	1	2026-01-01 至 2026-06-30	581,000,000.00	38,943,100.00	507,857,300.00	112,085,800.00	89.34%

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