华夏沪深 300 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遵规守信情况的说明 14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 14
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 14
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遵规守信情况声明 16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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 17
§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 47
7.1 期末基金资产组合情况 47
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 47
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细 48
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 60
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 62
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 62

§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 64
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 64
§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 67
§11 影响投资者决策的其他重要信息 67
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 67
§12 备查文件目录 68
12.1 备查文件目录 68
12.2 存放地点 68
12.3 查阅方式 68

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	华夏沪深 300ETF
场内简称	华夏 300（扩位证券简称：沪深 300ETF 华夏）
基金主代码	510330
交易代码	510330
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2012 年 12 月 25 日
基金管理人	华夏基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	7,489,149,828 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	2013 年 1 月 16 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	主要投资策略包括组合复制策略、替代性策略、存托凭证投资策略、股指期货投资策略、权证投资策略等。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为沪深 300 指数。
风险收益特征	本基金属于股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股，在股票基金中属于较高风险、较高收益的产品。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华夏基金管理有限公司	中国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	《上海证券报》
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	50,790,162,697.48
本期利润	9,843,104,177.54
加权平均基金份额本期利润	0.4652
本期加权平均净值利润率	9.43%
本期基金份额净值增长率	8.44%
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	20,860,133,190.54
期末可供分配基金份额利润	2.7854
期末基金资产净值	39,156,435,762.52
期末基金份额净值	5.2284
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	168.71%

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

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

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

④基金管理人以 2013 年 1 月 9 日为基金份额折算日对本基金进行了份额折算，折算结果详情请参见 2013 年 1 月 11 日发布的《华夏基金管理有限公司关于华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金份额折算结果的公告》。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

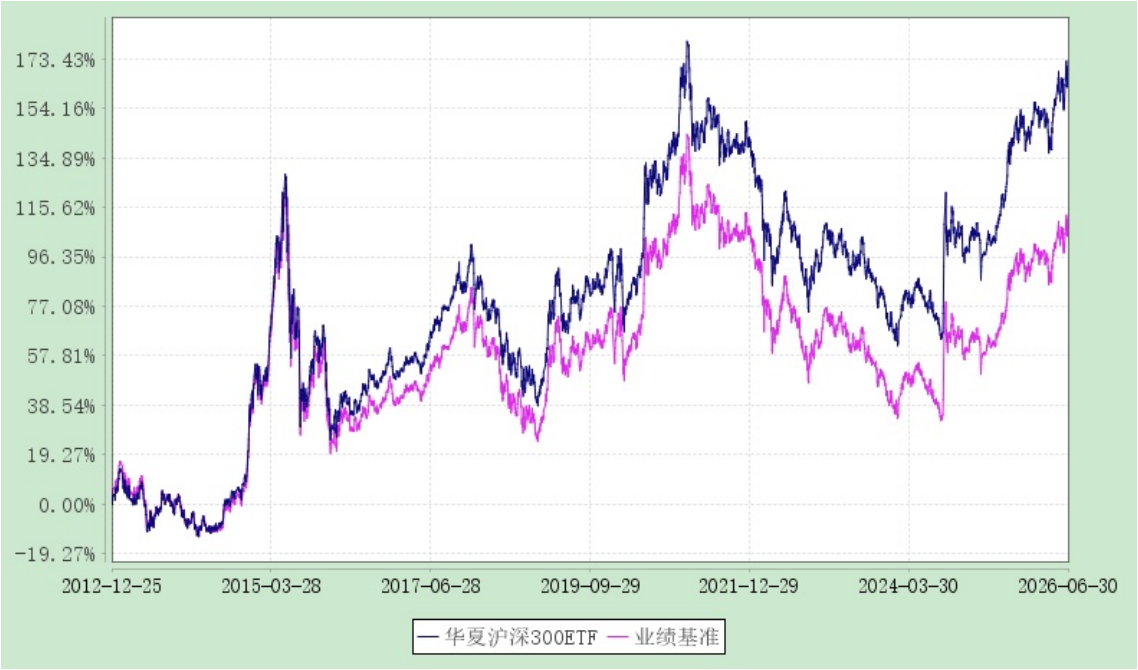
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	12.65%	1.25%	11.90%	1.26%	0.75%	-0.01%
过去六个月	8.44%	1.13%	7.55%	1.13%	0.89%	0.00%
过去一年	29.34%	1.02%	26.51%	1.02%	2.83%	0.00%
过去三年	38.91%	1.11%	29.59%	1.11%	9.32%	0.00%
过去五年	5.87%	1.12%	-4.68%	1.12%	10.55%	0.00%
过去七年	49.37%	1.16%	30.16%	1.17%	19.21%	-0.01%
过去十年	91.83%	1.15%	57.88%	1.15%	33.95%	0.00%
自基金合同生效起至今	168.71%	1.34%	109.11%	1.35%	59.60%	-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

华夏沪深 300 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

（2012 年 12 月 25 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		
赵宗庭	本基金的基金经理、投委会成员	2017-04-17	-	18 年	硕士。曾任华夏基金管理有限公司研究发展部产品经理、数量投资部研究员，嘉实基金管理有限公司指数投资部基金经理助理，嘉实国际资产管理有限公司基金经理。2016 年 11 月加入华夏基金管理有限公司。历任华夏中证四川国企改革交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2020 年 12 月 8 日至 2022 年 1 月 13

					日期间)、华夏中证浙江国资创新发展交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2020 年 12 月 8 日至 2022 年 1 月 13 日期间)、华夏中证浙江国资创新发展交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（2020 年 12 月 8 日至 2022 年 1 月 13 日期间)、华夏中证四川国企改革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 12 月 8 日至 2022 年 1 月 13 日期间)、上证主要消费交易型开放式指数发起式证券投资基金基金经理（2020 年 2 月 12 日至 2022 年 8 月 22 日期间)、华夏中证大数据产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2021 年 2 月 9 日至 2022 年 8 月 22 日期间)、华夏中证新能源交易型

					开放式指数证券投资基金基金经理（2021 年 3 月 9 日至 2022 年 8 月 22 日期间）、华夏中证新材料主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2021 年 8 月 4 日至 2023 年 3 月 27 日期间）、华夏中证石化产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2021 年 12 月 2 日至 2023 年 3 月 27 日期间）、华夏国证消费电子主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2021 年 8 月 12 日至 2023 年 6 月 29 日期间）、华夏中证机器人交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2021 年 12 月 17 日至 2023 年 6 月 29 日期间）、华夏中证细分有色金属产业主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2021 年 6 月 9 日至 2023

					年 12 月 28 日期间)、华夏中证细分有色金属产业主题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 10 月 18 日至 2023 年 12 月 28 日期间)、华夏中证云计算与大数据主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2021 年 8 月 24 日至 2025 年 6 月 3 日期间)、华夏沪深 300ESG 基准交易型开放式指数证券投资基金基金经理(2022 年 2 月 24 日至 2025 年 6 月 3 日期间)、华夏中证云计算与大数据主题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（2023 年 11 月 14 日至 2025 年 6 月 3 日期间)、华夏沪深 300ESG 基准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（2024

					年 4 月 9 日至 2025 年 6 月 3 日期间)等。

注：①上述“任职日期”和“离任日期”为根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。首任基金经理的，其“任职日期”为基金合同生效日。

②证券从业的含义遵从行业协会《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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沪深 300 指数，沪深 300 指数由沪深 A 股中规模大、流动性好、最具代表性的 300 只股票组成，自 2005 年 4 月 8 日起正式发布，以综合反映沪深 A 股市场整体表现。沪深 300 指数是内地首只股指期货的标的指数。本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好地跟踪标的指数，实现基金投资目标。

2026 年上半年，全球经济在地缘冲突扰动和 AI 基建加速两条主线影响下呈现 K 型分化。油价先扬后抑、上半年中枢较去年四季度整体上移，叠加地缘风险溢价，推高全球通胀压力并影响传统

经济复苏；AI Agent 驱动下 AI 产业链投资构建增长核心动能。主要经济体受供给冲击和需求韧性差异表现分化，货币政策由前期宽松转向“按兵不动+紧缩预期”并明显分化。国内方面，十五五开局之年延续高质量发展趋势，上半年保持一定增长韧性，物价呈结构性复苏，输入型通胀特征显现；货币政策保持适度宽松，但 M2、社融增速边际回落；总体供强需弱矛盾突出、经济向好基础仍需巩固。

市场方面，2026 年上半年 A 股在科技主线引领下延续宽幅震荡上行、呈现标准 K 型结构性牛市特征，指数分层显著。行业层面呈现分化，31 个申万一级行业仅约 10 个上涨，电子、通信、建筑材料、机械设备等 AI 相关行业领涨，而商贸零售、农林牧渔、美容护理、食品饮料、医药生物等消费医药内需行业表现落后。市场风格方面，受成长板块基本面优势领先、AI/算力产业链远期景气预期上修及流动性宽松环境等因素影响，成长风格相对价值风格的超额收益极为突出。

基金投资运作方面，报告期内，本基金在做好跟踪标的指数的基础上，认真应对投资者日常申购、赎回和成份股调整等工作。

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2026 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 5.2284 元，本报告期份额净值增长率为 8.44%，同期业绩比较基准增长率 7.55%。本基金本报告期跟踪偏离度为+0.89%，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

2026 年下半年，人工智能技术革命预计仍将成为全球宏观面的重要线索，AI 资本开支维持高强度带来的 K 型分化、中等偏高通胀水平和实际利率抬升环境可能延续，能源冲击带来的通胀上行风险存疑，主要经济体货币政策偏向稳健。国内方面，存量政策加快落实有望拉动经济大盘企稳回升、预计二季度是年内低位，内需逐步修复企稳，出口在中游制造拉动下保持强劲增长，新旧动能转换持续推进。

市场方面，政策呵护资本市场、企业盈利兑现和长期资金入市等因素预计继续支撑 2026 年下半年市场表现。股市和经济预计延续分化格局，景气投资驱动下科技制造主线地位不变，但科技板块内部分化加剧、概念炒作退潮，市场波动加大。市场风格方面，考虑到成长风格相对价值风格仍具备盈利优势，成长将保持相对收益优势；但需注意成长已抱团近两年、TMT 拥挤度处于高位，若美联储加息预期落地，四季度可能成为成长/价值风格切换的拐点。同时由于科技成长抱团拥挤和国内低利率环境延续，价值风格兼具组合防御作用和长期配置价值，具备阶段性修复机会。

本基金将会根据基金合同要求，在紧密跟踪标的指数的基础上，做好相关投资工作。

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

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及基金合同约定，本基金管理人为准确、及时进行基金估值和份额净值计价，制定了基金估值和份额净值计价的业务管理制度，建立了估值委员会，使用可靠的估值业务系统，设有完善的风险监测、控制和报告机制。本基金托管人审阅本基金管理人采用的估值原则及技术，并复核、审查基金资产净值和基金份额申购、赎回价格。会计师事务所在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的真实、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：华夏沪深 300 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	245,019,386.71	139,369,522.88
结算备付金		308,063,702.93	1,253,025,104.67
存出保证金		71,236,216.01	182,968,499.45
交易性金融资产	6.4.7.2	38,716,623,450.66	227,126,770,120.68
其中：股票投资		38,716,623,450.66	227,126,770,120.68
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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		1,750,959,629.89	66,964,894.15
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		41,091,902,386.20	228,769,098,141.83
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		1,199,935,639.56	52,648,071.60
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		8,044,884.66	28,880,757.90
应付托管费		2,681,628.23	9,626,919.33
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		1,518,091.02	2,796,604.98
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	723,286,380.21	19,095,336.91
负债合计		1,935,466,623.68	113,047,690.72
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	18,296,302,571.98	115,860,868,278.95
未分配利润	6.4.7.8	20,860,133,190.54	112,795,182,172.16
净资产合计		39,156,435,762.52	228,656,050,451.11
负债和净资产总计		41,091,902,386.20	228,769,098,141.83

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额净值 5.2284 元，基金份额总额 7,489,149,828.00 份。

6.2 利润表

会计主体：华夏沪深 300 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		9,947,620,795.75	5,115,278,321.27
1.利息收入		3,588,909.25	4,627,721.49
其中：存款利息收入	6.4.7.9	3,580,442.74	4,273,115.23
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		8,466.51	354,606.26
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		50,796,546,817.26	4,365,827,840.39
其中：股票投资收益	6.4.7.10	49,823,150,287.58	1,894,278,989.58
基金投资收益	6.4.7.11	-	-
债券投资收益	6.4.7.12	-	-
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	108,407,450.20	-19,568,926.69
股利收益	6.4.7.16	864,989,079.48	2,491,117,777.50
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	-40,947,058,519.94	759,241,844.95
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	94,543,589.18	-14,419,085.56
减：二、营业总支出		104,516,618.21	184,898,896.36
1.管理人报酬		78,015,336.01	130,667,802.82
2.托管费		26,005,112.02	43,555,934.24
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		390,650.08	-
8.其他费用	6.4.7.21	105,520.10	10,675,159.30
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		9,843,104,177.54	4,930,379,424.91
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		9,843,104,177.54	4,930,379,424.91
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		9,843,104,177.54	4,930,379,424.91

6.3 净资产变动表

会计主体：华夏沪深 300 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	115,860,868,278.95	112,795,182,172.16	228,656,050,451.11
二、本期期初净资产	115,860,868,278.95	112,795,182,172.16	228,656,050,451.11
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-97,564,565,706.97	-91,935,048,981.62	-189,499,614,688.59
（一）、综合收益总额	-	9,843,104,177.54	9,843,104,177.54
（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）	-97,564,565,706.97	-101,778,153,159.16	-199,342,718,866.13
其中：1.基金申购款	5,004,325,865.37	5,102,108,196.59	10,106,434,061.96
2.基金赎回款	-102,568,891,572.34	-106,880,261,355.75	-209,449,152,928.09
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	18,296,302,571.98	20,860,133,190.54	39,156,435,762.52
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	97,301,327,582.59	66,707,160,248.14	164,008,487,830.73
二、本期期初净资产	97,301,327,582.59	66,707,160,248.14	164,008,487,830.73

三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	19,880,981,752.81	12,811,372,359.25	32,692,354,112.06
（一）、综合收益总额	-	4,930,379,424.91	4,930,379,424.91
（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）	19,880,981,752.81	10,564,404,423.02	30,445,386,175.83
其中：1.基金申购款	29,456,482,251.85	16,691,161,883.90	46,147,644,135.75
2.基金赎回款	-9,575,500,499.04	-6,126,757,460.88	-15,702,257,959.92
（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）	-	-2,683,411,488.68	-2,683,411,488.68
四、本期期末净资产	117,182,309,335.40	79,518,532,607.39	196,700,841,942.79

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

华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2012]1653 号《关于核准华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金募集的批复》的核准，由华夏基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金运作管理办法》、《华夏沪深 300 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 2012 年 12 月 17 日至 2012 年 12 月 19 日期间共募集 602,764,295.00 元（不含认购资金利息），业经德勤华永会计师事务所有限公司德师报（验）字（12）第 0075 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2012 年 12 月 25 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 602,808,845 份基金份额，其中认购资金利息折合 44,550 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《华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，基金还可投资于非成份股、债券、股指期货、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资范围中的股票包含存托凭证。

根据《华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》，基金管理人华夏基金管理有限公司确定 2013 年 1 月 9 日为基金份额折算日。折算后的基金份额净值与 2013 年 1 月 9 日沪深 300 指数收盘值的千分之一基本一致。折算前基金份额总额为 16,020,609,566 份，本次基金份额折算比例为 0.40932601，折算后基金份额总额为 6,557,649,828 份。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布和修订的《企业会计准则——基本准则》、各项具体会计准则(以下合称“企业会计准则”) 、中国证监会颁布的《公开募集证券投资基金信息披露内容与格式准则第 2 号——定期报告的内容与格式》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的《公开募集证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号——年度报告和中期报告》编制，同时在信息披露方面也参考了中国证监会、中国基金业协会发布的基金行业实务操作的其他有关规定。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

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

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

根据财税[2005]103 号《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81 号《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通

知》、财税[2015]125 号《财政部、国家税务总局、证监会关于内地与香港基金互认有关税收政策的通知》、财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2023]39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财政部税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、中华人民共和国主席令第四十一号《中华人民共和国增值税法》、中华人民共和国国务院令第 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》及财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

（3）存款利息收入不征收增值税。

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

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

（6）对基金取得的债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

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

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

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

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	245,019,386.71
等于：本金	244,983,028.74
加：应计利息	36,357.97
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
合计	245,019,386.71

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	30,213,119,620.83	-	38,716,623,450.66	8,503,503,829.83

贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		30,213,119,620.83	-	38,716,623,450.66	8,503,503,829.83

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	436,287,120.00	-	-	-
其中：股指期货	436,287,120.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	436,287,120.00	-	-	-

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
IF2609	沪深 300 期货 IF2609 合约	304	442,301,760.00	6,014,640.00
合计	-	-	-	6,014,640.00
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	6,014,640.00
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	11,794,007.62
其中：交易所市场	11,794,007.62
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	189,350.98
可退替代款	4,388,286.02
应退替代款	706,914,735.59
合计	723,286,380.21

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	47,424,849,828.00	115,860,868,278.95

本期申购	2,048,400,000.00	5,004,325,865.37
本期赎回（以“-”号填列）	-41,984,100,000.00	-102,568,891,572.34
本期末	7,489,149,828.00	18,296,302,571.98

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

②基金管理人以 2013 年 1 月 9 日为基金份额折算日对本基金进行了份额折算，折算结果详情请参见 2013 年 1 月 11 日发布的《华夏基金管理有限公司关于华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金份额折算结果的公告》。

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	177,410,582,624.97	-64,615,400,452.81	112,795,182,172.16
本期期初	177,410,582,624.97	-64,615,400,452.81	112,795,182,172.16
本期利润	50,790,162,697.48	-40,947,058,519.94	9,843,104,177.54
本期基金份额交易产生的变动数	-182,302,299,466.51	80,524,146,307.35	-101,778,153,159.16
其中：基金申购款	10,163,376,970.95	-5,061,268,774.36	5,102,108,196.59
基金赎回款	-192,465,676,437.46	85,585,415,081.71	-106,880,261,355.75
本期已分配利润	-	-	-
本期末	45,898,445,855.94	-25,038,312,665.40	20,860,133,190.54

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	318,189.47
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	3,236,751.92
其他	25,501.35
合计	3,580,442.74

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	27,975,008,871.16
股票投资收益——赎回差价收入	21,848,141,416.42
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	49,823,150,287.58

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	100,398,569,235.64
减：卖出股票成本总额	72,353,682,018.89
减：交易费用	69,878,345.59
买卖股票差价收入	27,975,008,871.16

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	209,449,152,928.09
减：现金支付赎回款总额	84,204,524,848.94
减：赎回股票成本总额	103,396,486,662.73
减：交易费用	-
赎回差价收入	21,848,141,416.42

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

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	108,407,450.20

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	864,989,079.48
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	864,989,079.48

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	-40,918,038,619.94
——股票投资	-40,918,038,619.94
——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	-29,019,900.00
——权证投资	-
——期货投资	-29,019,900.00
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-40,947,058,519.94

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	94,543,589.18
合计	94,543,589.18

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	43,043.61
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	2,969.12
指数使用费	-
合计	105,520.10

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
华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(“华夏沪深 300ETF 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
中信期货有限公司（“中信期货”）	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	4,540,170,971.99	3.69%	-	-

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

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	435,465.90	3.69%	435,465.90	3.69%
关联方名称	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
中信证券	-	-	-	-

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

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	78,015,336.01	130,667,802.82
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,083,076.47	120,761.91
应支付基金管理人的净管理费	76,932,259.54	130,547,040.91

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	26,005,112.02	43,555,934.24

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
华夏沪深 300ETF 联接	2,642,282,970.00	35.28%	2,616,591,296.00	5.52%
中信中证资本	792,800.00	0.01%	792,800.00	0.00%
中信证券	329,986.00	0.00%	208,279.00	0.00%

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

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日		上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行活期存款	245,019,386.71	318,189.47	281,174,855.90	482,621.39

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	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 383,928,097.41 元，占基金资产净值的比例为 0.98%（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 2,519,161,476.48 元，占基金资产净值的比例为 1.10%）。

于 2026 年 6 月 30 日，本基金（因指数成份股包括中国工商银行而被动）持有的中国工商银行股票估值总额为 313,042,745.12 元，占基金资产净值的比例为 0.80%（2025 年 12 月 31 日，本基金（因指数成份股包括中国工商银行而被动）持有的中国工商银行股票估值总额为 2,306,533,407.88 元，占基金资产净值的比例为 1.01%）。

本基金本报告期通过中信期货买卖期货成交额为 1,951,283,460.00 元（上年度可比期间：3,435,268,500.00 元），支付给中信期货的佣金为 64,392.57 元（上年度可比期间：113,363.63 元）。

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
688012	中微公司	2026-06-25	6 个月	大宗转让流通受限	372.36	424.72	100,000	37,236,000.00	42,472,000.00	-
688082	盛美上海	2026-02-09	6 个月	非公开流通受限	160.00	399.91	100,000	16,000,000.00	39,991,000.00	-

300750	宁德时代	2026-04-24	6 个月	非公开流通受限	410.34	373.17	100,000	41,034,000.00	37,317,000.00	-
688521	芯原股份	2026-06-22	6 个月	大宗转让流通受限	249.92	322.13	100,000	24,992,000.00	32,213,000.00	-
688012	中微公司	2026-04-20	6 个月	大宗转让流通受限	288.88	433.39	59,600	11,555,200.00	25,830,044.00	含证券送配
301236	软通动力	2026-01-16	6 个月	大宗转让流通受限	45.50	41.13	500,000	22,750,000.00	20,565,000.00	-
688047	龙芯中科	2026-04-09	6 个月	大宗转让流通受限	121.77	145.44	100,000	12,177,000.00	14,544,000.00	-
603260	合盛硅业	2026-02-12	6 个月	大宗转让流通	44.91	45.73	250,000	11,227,500.00	11,432,500.00	-

				受限						
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	-
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	-
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	联讯仪器	2026-04-16	6 个月	新发流通受限	81.88	1,584.33	163	13,346.44	258,245.79	-
001248	华润新能源	2026-06-24	1 个月内（含）	新发流通受限	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	2026-03-18	6 个月	新发流	69.66	160.06	714	49,737.24	114,282.84	-

	子			通受限						
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	惠康科技	2026-05-15	6 个月	新发流通受限	53.26	58.74	285	15,179.10	16,740.90	-
301669	高特电子	2026-06-02	6 个月	新发流通受限	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	2026-04-28	6 个月	新发流	13.30	51.56	290	3,857.00	14,952.40	-

	团			通受限						
301599	理奇智能	2026-04-22	6 个月	新发流通受限	13.91	32.47	433	6,023.03	14,059.51	-
601112	振石股份	2026-01-21	6 个月	新发流通受限	11.18	17.59	775	8,664.50	13,632.25	-
301680	固德电材	2026-02-27	6 个月	新发流通受限	58.00	112.16	117	6,786.00	13,122.72	-
301683	慧谷新材	2026-03-24	6 个月	新发流通受限	78.38	121.77	96	7,524.48	11,689.92	-
688816	易思维	2026-02-04	6 个月	新发流通受限	55.95	57.10	177	9,903.15	10,106.70	-
603407	长裕集团	2026-04-29	6 个月	新发流通受限	13.86	73.46	137	1,898.82	10,064.02	-
301513	尚水智能	2026-04-10	6 个月	新发流通受限	26.66	50.96	138	3,679.08	7,032.48	-

920136	永励精密	2026-06-25	1 个月内（含）	新发流通受限	19.28	19.28	300	5,784.00	5,784.00	-
603435	嘉德利	2026-05-15	6 个月	新发流通受限	15.76	46.71	104	1,639.04	4,857.84	-
603352	至信股份	2026-01-08	6 个月	新发流通受限	21.88	25.52	112	2,450.56	2,858.24	-
920193	吉和昌	2026-06-18	1 个月内（含）	新发流通受限	8.52	8.52	300	2,556.00	2,556.00	-
603293	埃泰克	2026-04-09	6 个月	新发流通受限	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	2026-02-03	6 个月	新发流	37.88	34.87	46	1,742.48	1,604.02	-

	展			通受限						
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	-

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	317,125	208,618,841.85	263,848,000.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

6.4.13.3 流动性风险

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

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

在资产端，本基金主要投资于标的指数成份股、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	38,716,623,450.66	98.88	227,126,770,120.68	99.33
交易性金融资产－基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产－债券投资	-	-	-	-
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	38,716,623,450.66	98.88	227,126,770,120.68	99.33

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	除沪深 300 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%	-2,171,999,366.55	-12,227,509,344.22
	+5%	2,171,999,366.55	12,227,509,344.22

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	38,210,713,519.78
第二层次	264,708,259.44
第三层次	241,201,671.44
合计	38,716,623,450.66

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	38,716,623,450.66	94.22
	其中：股票	38,716,623,450.66	94.22
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	553,083,089.64	1.35
8	其他各项资产	1,822,195,845.90	4.43
9	合计	41,091,902,386.20	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	220,527,441.75	0.56
B	采矿业	1,620,032,079.77	4.14
C	制造业	24,821,144,121.83	63.39
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	961,781,658.02	2.46
E	建筑业	441,111,286.32	1.13
F	批发和零售业	57,202,881.68	0.15
G	交通运输、仓储和邮政业	937,252,652.80	2.39
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,078,903,327.16	5.31
J	金融业	6,779,034,392.58	17.31
K	房地产业	126,152,653.85	0.32
L	租赁和商务服务业	176,927,565.71	0.45
M	科学研究和技术服务业	421,658,717.95	1.08
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	52,690,721.72	0.13
R	文化、体育和娱乐业	22,246,817.25	0.06
S	综合	-	-
	合计	38,716,666,318.39	98.88

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	1,526,341	1,938,453,070.00	4.95
2	300750	宁德时代	3,623,039	1,421,906,557.39	3.63
3	300502	新易盛	1,910,355	1,159,585,485.00	2.96
4	600519	贵州茅台	855,611	1,014,318,284.39	2.59
5	603986	兆易创新	914,737	745,510,655.00	1.90

6	601318	中国平安	14,591,180	696,582,933.20	1.78
7	688256	寒武纪	432,273	689,713,185.15	1.76
8	600036	招商银行	16,936,717	601,253,453.50	1.54
9	601899	紫金矿业	22,560,061	567,159,933.54	1.45
10	002371	北方华创	585,604	518,001,874.24	1.32
11	000333	美的集团	6,658,022	502,880,401.66	1.28
12	002475	立讯精密	6,981,144	491,472,537.60	1.26
13	688008	澜起科技	1,569,111	486,267,498.90	1.24
14	688041	海光信息	1,270,938	470,628,341.40	1.20
15	002384	东山精密	1,756,012	460,689,748.20	1.18
16	600900	长江电力	16,744,828	443,235,597.16	1.13
17	688981	中芯国际	2,789,142	442,971,532.44	1.13
18	688012	中微公司	958,690	442,675,709.00	1.13
19	000725	京东方 A	49,898,400	433,118,112.00	1.11
20	603259	药明康德	3,386,545	421,658,717.95	1.08
21	601138	工业富联	5,428,543	391,669,377.45	1.00
22	600030	中信证券	13,363,317	383,928,097.41	0.98
23	601166	兴业银行	23,178,976	383,843,842.56	0.98
24	300059	东方财富	17,331,284	353,211,567.92	0.90
25	600183	生益科技	1,995,741	346,061,489.40	0.88
26	600276	恒瑞医药	6,109,905	317,959,456.20	0.81
27	300274	阳光电源	1,988,693	316,241,960.86	0.81
28	601398	工商银行	44,277,616	313,042,745.12	0.80
29	300408	三环集团	1,837,791	306,727,317.90	0.78
30	002594	比亚迪	3,718,010	296,325,397.00	0.76
31	300476	胜宏科技	836,394	289,751,973.42	0.74
32	002463	沪电股份	1,845,472	281,988,121.60	0.72
33	601211	国泰海通	15,465,387	281,470,043.40	0.72
34	300394	天孚通信	896,525	271,360,187.00	0.69
35	688072	拓荆科技	317,125	263,848,000.00	0.67

36	000988	华工科技	1,375,445	253,920,901.45	0.65
37	301308	江波龙	349,244	245,797,927.20	0.63
38	600176	中国巨石	3,287,407	239,586,222.16	0.61
39	601288	农业银行	39,313,806	238,634,802.42	0.61
40	601328	交通银行	36,490,373	234,633,098.39	0.60
41	000651	格力电器	6,150,181	230,631,787.50	0.59
42	600522	中天科技	3,733,500	226,548,780.00	0.58
43	600919	江苏银行	20,085,207	216,518,531.46	0.55
44	603019	中科曙光	2,002,618	214,740,728.14	0.55
45	688521	芯原股份	578,938	209,966,049.32	0.54
46	603993	洛阳钼业	11,942,809	209,596,297.95	0.54
47	600150	中国船舶	6,179,667	208,810,947.93	0.53
48	600887	伊利股份	8,655,025	207,374,399.00	0.53
49	600584	长电科技	1,961,259	203,088,369.45	0.52
50	000338	潍柴动力	7,359,633	200,549,999.25	0.51
51	000858	五粮液	2,658,360	196,718,640.00	0.50
52	601816	京沪高铁	40,148,729	181,873,742.37	0.46
53	600309	万华化学	2,571,956	175,947,509.96	0.45
54	300124	汇川技术	2,595,744	172,175,699.52	0.44
55	002415	海康威视	5,019,900	171,680,580.00	0.44
56	002916	深南电路	374,867	171,651,599.30	0.44
57	600111	北方稀土	3,461,675	166,333,483.75	0.42
58	601688	华泰证券	8,002,574	165,013,075.88	0.42
59	000100	TCL 科技	28,340,801	164,943,461.82	0.42
60	000063	中兴通讯	4,409,602	159,583,496.38	0.41
61	600000	浦发银行	18,232,997	156,986,104.17	0.40
62	600089	特变电工	6,914,974	155,586,915.00	0.40
63	601857	中国石油	17,730,027	153,896,634.36	0.39
64	002028	思源电气	852,820	147,537,860.00	0.38
65	601088	中国神华	3,758,069	146,715,013.76	0.37

66	300433	蓝思科技	2,727,165	146,339,673.90	0.37
67	600031	三一重工	8,119,306	140,301,607.68	0.36
68	300014	亿纬锂能	2,081,138	135,336,404.14	0.35
69	002050	三花智控	3,064,357	134,310,767.31	0.34
70	002142	宁波银行	4,518,741	134,161,420.29	0.34
71	601601	中国太保	4,684,248	133,594,752.96	0.34
72	000001	平安银行	13,281,777	133,481,858.85	0.34
73	000792	盐湖股份	4,348,240	131,273,365.60	0.34
74	002714	牧原股份	3,737,965	130,791,395.35	0.33
75	600549	厦门钨业	1,520,800	129,572,160.00	0.33
76	002353	杰瑞股份	841,200	128,283,000.00	0.33
77	600406	国电南瑞	5,495,196	125,565,228.60	0.32
78	601668	中国建筑	28,270,602	122,694,412.68	0.31
79	000657	中钨高新	1,246,000	119,267,120.00	0.30
80	601229	上海银行	13,606,286	118,102,562.48	0.30
81	601919	中远海控	8,586,382	113,855,425.32	0.29
82	002602	世纪华通	8,072,800	113,826,480.00	0.29
83	300760	迈瑞医疗	830,129	112,756,422.07	0.29
84	601988	中国银行	19,585,854	112,031,084.88	0.29
85	601939	建设银行	11,594,846	111,658,366.98	0.29
86	600660	福耀玻璃	2,192,077	110,568,363.88	0.28
87	603501	豪威集团	1,161,751	110,192,082.35	0.28
88	601728	中国电信	21,225,821	110,162,010.99	0.28
89	600016	民生银行	33,964,297	109,365,036.34	0.28
90	601012	隆基绿能	8,295,908	108,842,312.96	0.28
91	601225	陕西煤业	5,305,345	107,963,770.75	0.28
92	002230	科大讯飞	2,631,910	107,487,204.40	0.27
93	600999	招商证券	5,076,300	107,109,930.00	0.27
94	600941	中国移动	1,232,095	106,120,342.35	0.27
95	600690	海尔智家	5,133,223	104,769,081.43	0.27

96	002352	顺丰控股	3,285,611	102,708,199.86	0.26
97	601985	中国核电	11,255,024	101,632,866.72	0.26
98	002460	赣锋锂业	1,546,007	101,108,857.80	0.26
99	002938	鹏鼎控股	954,700	100,606,286.00	0.26
100	002709	天赐材料	1,951,303	100,355,513.29	0.26
101	600926	杭州银行	6,943,656	100,335,829.20	0.26
102	603799	华友钴业	2,075,339	100,155,860.14	0.26
103	601169	北京银行	20,240,550	99,178,695.00	0.25
104	300033	同花顺	410,281	98,877,721.00	0.25
105	000977	浪潮信息	1,406,245	98,437,150.00	0.25
106	600160	巨化股份	1,849,136	98,022,699.36	0.25
107	000776	广发证券	4,041,614	94,573,767.60	0.24
108	300442	润泽科技	1,125,029	93,456,159.03	0.24
109	000425	徐工机械	11,218,950	90,761,305.50	0.23
110	688126	沪硅产业	2,261,380	90,206,448.20	0.23
111	000938	紫光股份	3,113,954	89,868,712.44	0.23
112	300498	温氏股份	7,283,770	89,736,046.40	0.23
113	002202	金风科技	3,740,800	89,405,120.00	0.23
114	601600	中国铝业	10,838,579	89,093,119.38	0.23
115	600028	中国石化	19,938,925	88,927,605.50	0.23
116	600938	中国海油	3,273,500	88,875,525.00	0.23
117	600460	士兰微	1,594,547	87,157,939.02	0.22
118	002600	领益智造	5,003,500	86,760,690.00	0.22
119	002466	天齐锂业	1,414,514	86,737,998.48	0.22
120	601766	中国中车	16,639,201	86,523,845.20	0.22
121	600050	中国联通	21,384,600	85,538,400.00	0.22
122	300661	圣邦股份	593,772	85,194,406.56	0.22
123	601009	南京银行	8,455,630	83,626,180.70	0.21
124	002837	英维克	1,048,014	83,379,993.84	0.21
125	002049	紫光国微	931,202	82,644,177.50	0.21

126	688082	盛美上海	196,520	81,687,640.00	0.21
127	601628	中国人寿	2,279,390	80,576,436.50	0.21
128	002179	中航光电	1,739,903	80,383,518.60	0.21
129	601100	恒立液压	733,655	78,911,931.80	0.20
130	000568	泸州老窖	1,008,553	78,183,028.56	0.20
131	601872	招商轮船	4,419,116	77,643,868.12	0.20
132	002241	歌尔股份	3,399,321	76,586,702.13	0.20
133	603288	海天味业	2,281,971	75,670,158.36	0.19
134	601006	大秦铁路	16,288,158	75,088,408.38	0.19
135	000408	藏格矿业	1,077,380	74,683,981.60	0.19
136	601658	邮储银行	15,078,379	74,336,408.47	0.19
137	605117	德业股份	696,315	73,934,726.70	0.19
138	601818	光大银行	25,383,782	73,359,129.98	0.19
139	600809	山西汾酒	667,278	72,980,194.86	0.19
140	600905	三峡能源	19,543,863	72,507,731.73	0.19
141	600489	中金黄金	3,981,017	71,857,356.85	0.18
142	601888	中国中免	1,334,897	71,697,317.87	0.18
143	002625	光启技术	2,359,497	71,539,949.04	0.18
144	688396	华润微	731,060	71,314,903.00	0.18
145	000630	铜陵有色	11,009,500	70,020,420.00	0.18
146	600893	航发动力	1,825,505	69,989,861.70	0.18
147	600010	包钢股份	30,935,763	68,986,751.49	0.18
148	688271	联影医疗	680,436	68,880,536.28	0.18
149	601127	赛力斯	1,115,300	68,312,125.00	0.17
150	601336	新华保险	1,138,819	67,941,941.54	0.17
151	688111	金山办公	318,806	67,921,618.30	0.17
152	600958	东方证券	7,155,695	67,549,760.80	0.17
153	002027	分众传媒	13,875,010	67,155,048.40	0.17
154	601689	拓普集团	1,187,311	66,988,086.62	0.17
155	600118	中国卫星	809,401	66,411,352.05	0.17

156	600019	宝钢股份	11,920,309	64,727,277.87	0.17
157	600760	中航沈飞	1,550,468	63,724,234.80	0.16
158	000807	云铝股份	2,846,825	63,028,705.50	0.16
159	601838	成都银行	3,475,859	61,522,704.30	0.16
160	600362	江西铜业	1,419,310	61,456,123.00	0.16
161	600104	上汽集团	6,288,653	61,377,253.28	0.16
162	600989	宝丰能源	3,010,402	61,201,472.66	0.16
163	300450	先导智能	1,500,307	61,092,501.04	0.16
164	688183	生益电子	457,843	60,618,413.20	0.15
165	601727	上海电气	8,625,300	60,377,100.00	0.15
166	600875	东方电气	2,084,946	59,983,896.42	0.15
167	002001	新和成	2,102,185	59,744,097.70	0.15
168	601825	沪农商行	7,915,356	59,286,016.44	0.15
169	002422	科伦药业	1,524,059	58,706,752.68	0.15
170	601390	中国中铁	14,006,709	58,407,976.53	0.15
171	603296	华勤技术	778,294	57,803,895.38	0.15
172	601995	中金公司	1,598,338	57,779,918.70	0.15
173	000538	云南白药	1,219,483	57,766,909.71	0.15
174	600547	山东黄金	2,474,148	57,128,077.32	0.15
175	601377	兴业证券	9,445,568	57,051,230.72	0.15
176	600795	国电电力	12,195,785	56,954,315.95	0.15
177	600015	华夏银行	8,704,594	55,622,355.66	0.14
178	600585	海螺水泥	3,279,678	55,590,542.10	0.14
179	601669	中国电建	11,766,037	55,300,373.90	0.14
180	603893	瑞芯微	289,637	54,556,025.32	0.14
181	000166	申万宏源	12,370,043	54,428,189.20	0.14
182	601916	浙商银行	20,616,170	54,220,527.10	0.14
183	300316	晶盛机电	896,900	54,172,760.00	0.14
184	002648	卫星化学	2,305,294	54,151,356.06	0.14
185	300015	爱尔眼科	6,379,022	52,690,721.72	0.13

186	601698	中国卫通	1,733,296	52,432,204.00	0.13
187	601066	中信建投	1,778,426	51,698,843.82	0.13
188	600346	恒力石化	2,888,994	51,164,083.74	0.13
189	601868	中国能建	19,114,700	51,036,249.00	0.13
190	600482	中国动力	1,552,202	50,912,225.60	0.13
191	601998	中信银行	7,245,802	50,213,407.86	0.13
192	002311	海大集团	1,123,873	50,135,974.53	0.13
193	002558	巨人网络	1,818,400	50,115,104.00	0.13
194	300418	昆仑万维	1,229,652	49,628,754.72	0.13
195	000625	长安汽车	6,808,926	48,819,999.42	0.12
196	600066	宇通客车	1,814,928	48,658,219.68	0.12
197	600426	华鲁恒升	2,024,687	48,430,513.04	0.12
198	002532	天山铝业	4,433,859	47,575,307.07	0.12
199	600221	海航控股	35,127,000	47,421,450.00	0.12
200	000157	中联重科	6,793,958	47,353,887.26	0.12
201	688036	传音控股	783,629	46,194,929.55	0.12
202	605499	东鹏饮料	372,041	45,921,020.63	0.12
203	300803	指南针	499,439	45,783,573.13	0.12
204	600011	华能国际	6,013,979	45,646,100.61	0.12
205	600048	保利发展	9,824,219	45,486,133.97	0.12
206	600436	片仔癀	410,413	44,849,932.64	0.11
207	600438	通威股份	3,695,919	44,757,579.09	0.11
208	600115	中国东航	11,645,953	44,371,080.93	0.11
209	601077	渝农商行	7,255,330	44,330,066.30	0.11
210	002236	大华股份	2,682,781	44,239,058.69	0.11
211	002493	荣盛石化	4,111,756	44,201,377.00	0.11
212	600570	恒生电子	2,071,980	43,905,256.20	0.11
213	600886	国投电力	3,282,800	43,694,068.00	0.11
214	600188	兖矿能源	2,442,808	43,408,698.16	0.11
215	003816	中国广核	10,763,700	42,086,067.00	0.11

216	002736	国信证券	4,203,282	41,990,787.18	0.11
217	688047	龙芯中科	275,892	41,749,215.64	0.11
218	601360	三六零	4,786,401	41,593,824.69	0.11
219	000301	东方盛虹	3,628,923	41,551,168.35	0.11
220	601058	赛轮轮胎	3,597,126	41,474,862.78	0.11
221	600026	中远海能	2,281,824	40,935,922.56	0.10
222	002074	国轩高科	1,482,384	40,780,383.84	0.10
223	601901	方正证券	5,629,400	40,531,680.00	0.10
224	600009	上海机场	1,703,403	39,348,609.30	0.10
225	600196	复星医药	1,739,724	39,091,598.28	0.10
226	000768	中航西飞	1,900,859	38,929,592.32	0.10
227	000975	山金国际	2,283,017	38,811,289.00	0.10
228	601111	中国国航	6,376,032	38,574,993.60	0.10
229	601788	光大证券	2,669,780	38,524,925.40	0.10
230	600029	南方航空	7,368,657	38,169,643.26	0.10
231	600415	小商品城	3,747,559	38,075,199.44	0.10
232	601456	国联民生	4,299,300	38,005,812.00	0.10
233	600674	川投能源	2,665,951	37,776,525.67	0.10
234	600219	南山铝业	9,418,480	37,579,735.20	0.10
235	601186	中国铁建	6,283,064	37,384,230.80	0.10
236	601881	中国银河	2,971,394	37,350,422.58	0.10
237	600233	圆通速递	2,341,500	36,878,625.00	0.09
238	601877	正泰电器	1,470,070	36,854,654.90	0.09
239	601117	中国化学	5,012,318	36,840,537.30	0.09
240	600372	中航机载	3,308,232	35,894,317.20	0.09
241	301269	华大九天	300,156	35,844,629.52	0.09
242	601878	浙商证券	3,754,800	35,670,600.00	0.09
243	301236	软通动力	850,658	35,450,432.10	0.09
244	000963	华东医药	1,198,414	33,699,401.68	0.09
245	600741	华域汽车	2,156,533	33,469,392.16	0.09

246	688506	百利天恒	113,611	33,405,042.33	0.09
247	002920	德赛西威	408,603	33,301,144.50	0.09
248	000895	双汇发展	1,422,010	31,853,024.00	0.08
249	001979	招商蛇口	4,933,784	31,724,231.12	0.08
250	002304	洋河股份	825,098	31,477,488.70	0.08
251	300866	安克创新	295,093	30,837,218.50	0.08
252	601021	春秋航空	668,967	30,491,515.86	0.08
253	601898	中煤能源	2,501,867	30,472,740.06	0.08
254	601319	中国人保	4,365,295	29,509,394.20	0.08
255	600023	浙能电力	5,500,963	28,935,065.38	0.07
256	600039	四川路桥	3,568,040	27,902,072.80	0.07
257	601800	中国交建	4,860,761	27,754,945.31	0.07
258	000002	万科 A	9,309,090	27,554,906.40	0.07
259	688223	晶科能源	5,613,912	26,666,082.00	0.07
260	600588	用友网络	2,803,918	25,739,967.24	0.07
261	601633	长城汽车	1,704,104	25,714,929.36	0.07
262	001965	招商公路	2,788,701	25,544,501.16	0.07
263	600600	青岛啤酒	482,954	25,224,687.42	0.06
264	603369	今世缘	1,020,044	24,185,243.24	0.06
265	600027	华电国际	5,411,013	24,079,007.85	0.06
266	601618	中国中冶	9,750,200	23,790,488.00	0.06
267	601607	上海医药	1,526,200	23,503,480.00	0.06
268	300628	亿联网络	693,132	23,441,724.24	0.06
269	302132	中航成飞	400,466	23,355,177.12	0.06
270	600918	中泰证券	4,325,886	23,013,713.52	0.06
271	600061	国投资本	3,493,543	22,882,706.65	0.06
272	000617	中油资本	3,454,500	22,765,155.00	0.06
273	603260	合盛硅业	483,878	22,719,452.28	0.06
274	600025	华能水电	2,546,453	22,637,967.17	0.06
275	300832	新产业	536,466	22,531,572.00	0.06

276	300251	光线传媒	2,006,025	22,246,817.25	0.06
277	600930	华电新能	4,554,442	21,724,688.34	0.06
278	600085	同仁堂	934,776	21,602,673.36	0.06
279	688472	阿特斯	1,992,192	21,555,517.44	0.06
280	601059	信达证券	1,327,978	21,499,963.82	0.05
281	600515	海南机场	7,805,614	21,387,382.36	0.05
282	000999	华润三九	911,906	20,508,765.94	0.05
283	600803	新奥股份	1,267,175	20,021,365.00	0.05
284	600018	上港集团	4,130,330	19,495,157.60	0.05
285	600845	宝信软件	1,172,164	19,493,087.32	0.05
286	300122	智飞生物	1,640,976	19,183,009.44	0.05
287	300999	金龙鱼	816,500	18,991,790.00	0.05
288	300896	爱美客	208,248	18,159,225.60	0.05
289	000596	古井贡酒	224,916	17,948,296.80	0.05
290	000708	中信特钢	1,382,984	17,453,258.08	0.04
291	688009	中国通号	3,532,971	16,816,941.96	0.04
292	601018	宁波港	5,310,700	16,728,705.00	0.04
293	601238	广汽集团	3,025,060	15,367,304.80	0.04
294	688303	大全能源	877,157	15,288,846.51	0.04
295	001280	中国铀业	227,631	15,182,987.70	0.04
296	300413	芒果超媒	1,021,421	14,943,389.23	0.04
297	301165	锐捷网络	183,880	14,793,146.00	0.04
298	603392	万泰生物	517,202	13,948,937.94	0.04
299	601136	首创证券	743,600	10,373,220.00	0.03
300	001391	国货航	1,995,386	8,121,221.02	0.02
301	688795	摩尔线程	10,828	7,329,906.32	0.02
302	688802	沐曦股份	3,994	3,070,946.66	0.01
303	688783	西安奕材	44,370	2,547,725.40	0.01
304	001248	华润新能源	84,104	850,291.44	0.00
305	688765	禾元生物	16,470	799,783.20	0.00

306	301666	大普微	1,220	565,262.60	0.00
307	688759	必贝特	12,552	384,718.80	0.00
308	688820	盛合晶微	2,391	338,302.59	0.00
309	688790	昂瑞微	2,319	293,237.55	0.00
310	688781	视涯科技	6,335	267,083.60	0.00
311	688808	联讯仪器	163	258,245.79	0.00
312	001399	惠科股份	6,488	179,912.24	0.00
313	688818	电科蓝天	1,717	120,430.38	0.00
314	301682	宏明电子	714	114,282.84	0.00
315	688797	臻宝科技	207	97,014.69	0.00
316	688712	北芯生命	1,500	53,880.00	0.00
317	688785	恒运昌	116	53,725.40	0.00
318	688813	泰金新能	234	40,269.06	0.00
319	688635	长进光子	128	39,448.32	0.00
320	001257	盛龙股份	1,743	36,149.82	0.00
321	603459	红板科技	330	27,825.60	0.00
322	001365	天海电子	719	22,511.89	0.00
323	688811	有研复材	834	20,124.42	0.00
324	301696	三瑞智能	216	18,748.80	0.00
325	001237	惠康科技	285	16,740.90	0.00
326	301669	高特电子	546	15,506.40	0.00
327	301687	新广益	195	15,167.10	0.00
328	001393	维通利	387	15,089.13	0.00
329	301531	春光集团	290	14,952.40	0.00
330	301599	理奇智能	433	14,059.51	0.00
331	601112	振石股份	775	13,632.25	0.00
332	301680	固德电材	117	13,122.72	0.00
333	301683	慧谷新材	96	11,689.92	0.00
334	688816	易思维	177	10,106.70	0.00
335	603407	长裕集团	137	10,064.02	0.00

336	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
337	920136	永励精密	300	5,784.00	0.00
338	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
339	603352	至信股份	112	2,858.24	0.00
340	920193	吉和昌	300	2,556.00	0.00
341	603293	埃泰克	72	2,442.96	0.00
342	001312	福恩股份	134	2,248.52	0.00
343	920189	康美特	200	1,628.00	0.00
344	603284	林平发展	46	1,604.02	0.00
345	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	300308	中际旭创	813,571,836.23	0.36
2	002371	北方华创	797,344,869.66	0.35
3	300502	新易盛	732,443,484.94	0.32
4	688041	海光信息	550,869,883.65	0.24
5	000988	华工科技	450,986,229.63	0.20
6	300750	宁德时代	439,305,624.51	0.19
7	301308	江波龙	349,619,518.99	0.15
8	688072	拓荆科技	339,277,883.29	0.15
9	600436	片仔癀	334,774,206.54	0.15
10	002920	德赛西威	290,985,432.65	0.13
11	688012	中微公司	283,835,528.37	0.12
12	688521	芯原股份	276,154,251.23	0.12
13	002916	深南电路	274,460,561.60	0.12
14	002594	比亚迪	273,204,270.53	0.12
15	300394	天孚通信	253,881,875.84	0.11
16	002353	杰瑞股份	243,237,349.47	0.11

17	300803	指南针	235,475,997.39	0.10
18	002602	世纪华通	233,901,405.54	0.10
19	000657	中钨高新	231,100,284.66	0.10
20	600549	厦门钨业	205,149,224.79	0.09

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	7,795,850,549.21	3.41
2	300308	中际旭创	7,344,881,306.51	3.21
3	300502	新易盛	4,429,867,634.79	1.94
4	000333	美的集团	3,079,391,540.71	1.35
5	002371	北方华创	2,664,263,922.09	1.17
6	002475	立讯精密	2,550,396,391.24	1.12
7	688256	寒武纪	2,534,085,552.50	1.11
8	300059	东方财富	2,301,268,453.88	1.01
9	002594	比亚迪	2,191,173,248.07	0.96
10	300274	阳光电源	1,931,347,248.51	0.84
11	000858	五粮液	1,501,008,792.49	0.66
12	000725	京东方 A	1,482,002,590.35	0.65
13	000651	格力电器	1,479,846,378.76	0.65
14	300476	胜宏科技	1,443,144,502.18	0.63
15	002384	东山精密	1,293,728,080.48	0.57
16	300394	天孚通信	1,182,446,198.64	0.52
17	300124	汇川技术	1,155,352,941.22	0.51
18	000338	潍柴动力	1,119,506,581.24	0.49
19	000063	中兴通讯	1,090,411,808.10	0.48
20	688012	中微公司	1,066,743,697.24	0.47

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	22,628,014,376.59
卖出股票收入（成交）总额	100,398,569,235.64

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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	71,236,216.01
2	应收清算款	1,750,959,629.89
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	1,822,195,845.90

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	300750	宁德时代	37,317,000.00	0.10	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		华夏沪深 300ETF 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
32,599	229,735.57	4,529,870,793.00	60.49%	316,996,065.00	4.23%	2,642,282,970.00	35.28%

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	1,900.00	0.00%

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（2012 年 12 月 25 日）基金份额总额	602,808,845
本报告期期初基金份额总额	47,424,849,828
本报告期基金总申购份额	2,048,400,000
减：本报告期基金总赎回份额	41,984,100,000
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	7,489,149,828

§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	
中信建投证券	4	37,332,711,264.84	30.36%	3,580,943.54	30.36%	-
中国银河证券	4	25,506,155,960.93	20.74%	2,446,126.59	20.74%	-
广发证券	3	16,948,729,325.73	13.78%	1,625,432.33	13.78%	-
国泰海通证券	3	12,422,198,553.80	10.10%	1,191,301.08	10.10%	-
招商证券	3	11,150,699,870.37	9.07%	1,069,378.04	9.07%	-
方正证券	2	5,648,252,247.22	4.59%	541,920.89	4.59%	-
中信证券	8	4,540,170,971.99	3.69%	435,465.90	3.69%	-
华安证券	3	4,535,875,819.05	3.69%	435,011.15	3.69%	-
国金证券	5	2,649,671,597.59	2.15%	254,112.11	2.15%	-
国信证券	1	2,230,975,400.51	1.81%	214,315.99	1.82%	-

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

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

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

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

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

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

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

③证券公司专用交易单元选择程序：

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

ii 投资、研究部门根据上述标准进行评估并确定选用的证券公司。

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

④除本表列示外，本基金还选择了财通证券、长江证券、诚通证券、东北证券、东方财富证券、东方证券、东兴证券、山西证券、上海证券、世纪证券、信达证券、兴业证券、粤开证券、浙商证券、中金财富、中金公司、中泰证券的交易单元作为本基金交易单元，本报告期无股票交易及应付佣金。

⑤在上述租用的券商交易单元中，华安证券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
中信建投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中国银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-

招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	20,000,000.00	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

华夏沪深300ETF联接	1	2026-06-17至2026-06-30	2,616,591,296.00	362,045,045.00	336,353,371.00	2,642,282,970.00	35.28%
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、中国证监会核准基金募集的文件；

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