华夏中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

2025 年中期报告

2025 年 6 月 30 日

基金管理人：华夏基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二五年八月三十日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 8 月 28 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 2025 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录 1
§2 基金简介 3
§3 主要财务指标和基金净值表现 4
3.1 主要会计数据和财务指标 4
3.2 基金净值表现 5
§4 管理人报告 8
§5 托管人报告 14
§6 中期报告财务会计报告（未经审计） 15
6.1 资产负债表 15
6.2 利润表 16
6.3 净资产变动表 17
6.4 报表附注 18
§7 投资组合报告 39
7.1 期末基金资产组合情况 39
7.3 报告期末按行业分类的股票投资组合 39
7.4 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 40
7.5 报告期内股票投资组合的重大变动 52
7.6 期末按债券品种分类的债券投资组合 53
7.7 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 53
7.8 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 54
7.9 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 54
7.10 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 54
7.11 本基金投资股指期货的投资政策 54
7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 54
7.13 投资组合报告附注 54
§8 基金份额持有人信息 55
§9 开放式基金份额变动 56
§10 重大事件揭示 56
§11 影响投资者决策的其他重要信息 58
§12 备查文件目录 58

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华夏中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金		
基金简称	华夏中证 A500ETF 联接		
基金主代码	022430		
交易代码	022430		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2024 年 11 月 18 日		
基金管理人	华夏基金管理有限公司		
基金托管人	招商银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	4,702,035,032.48 份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称	华夏中证 A500ETF 联接 A	华夏中证 A500ETF 联接 C	华夏中证 A500ETF 联接 Y
下属分级基金的交易代码	022430	022431	022979
报告期末下属分级基金的份额总额	1,623,653,990.37 份	2,984,919,332.40 份	93,461,709.71 份

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	华夏中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	512050
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2024 年 11 月 8 日
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2024 年 11 月 15 日
基金管理人名称	华夏基金管理有限公司
基金托管人名称	招商银行股份有限公司

2.2 基金产品说明

投资目标	通过对目标 ETF 基金份额的投资，追求跟踪标的指数，获得与指数收益相似的回报。本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。
投资策略	主要投资策略包括目标 ETF 投资策略，股票投资策略，存托凭证投资策略，债券投资策略，衍生品投资策略，资产支持证券投资策略，可转换债券、可交换债券投资策略，参与融资及转融通证券出借业务策略等。
业绩比较基准	中证 A500 指数收益率×95%＋人民币活期存款税后利率×5%
风险收益特征	本基金为目标 ETF 的联接基金，目标 ETF 为股票型指数基金，因此本基金的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。

2.2.1 目标基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。
投资策略	主要投资策略包括完全复制策略，替代性策略，存托凭证投资策略，金融衍生品投资策略，债券投资策略，可转换债券、可交换债券投资策略，资产支持证券投资策略，融资、转融通证券出借业务投资策略等。
业绩比较基准	中证 A500 指数收益率
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华夏基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李彬	张姗
	联系电话	400-818-6666	400-61-95555
	电子邮箱	service@ChinaAMC.com	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		400-818-6666	400-61-95555
传真		010-63136700	0755-83195201
注册地址		北京市顺义区安庆大街甲3号院	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
办公地址		北京市朝阳区北辰西路6号院北辰中心C座5层	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
邮政编码		100101	518040
法定代表人		张佑君	缪建民

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.ChinaAMC.com
基金中期报告备置地点	基金管理人和/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	华夏基金管理有限公司	北京市朝阳区北辰西路 6 号院北辰中心 C 座 5 层

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日）		
	华夏中证 A500ETF 联接 A	华夏中证 A500ETF 联接 C	华夏中证 A500ETF 联接 Y

本期已实现收益	116,281.31	-4,665,620.97	-1,863.45
本期利润	31,368,393.56	38,631,041.01	2,624,804.56
加权平均基金份额本期利润	0.0183	0.0126	0.0327
本期加权平均净值利润率	1.91%	1.32%	3.42%
本期基金份额净值增长率	1.57%	1.42%	1.58%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)		
	华夏中证 A500ETF 联接 A	华夏中证 A500ETF 联接 C	华夏中证 A500ETF 联接 Y
期末可供分配利润	-36,353,890.19	-72,527,388.36	-2,096,918.27
期末可供分配基金份额利润	-0.0224	-0.0243	-0.0224
期末基金资产净值	1,590,546,308.34	2,918,235,083.73	91,551,603.67
期末基金份额净值	0.9796	0.9777	0.9796
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)		
	华夏中证 A500ETF 联接 A	华夏中证 A500ETF 联接 C	华夏中证 A500ETF 联接 Y
基金份额累计净值增长率	0.00%	-0.17%	0.78%

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本基金自 2024 年 12 月 13 日增加 Y 类基金份额类别。

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

华夏中证 A500ETF 联接 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	3.38%	0.57%	2.68%	0.57%	0.70%	0.00%
过去三个月	1.78%	1.14%	0.83%	1.14%	0.95%	0.00%
过去六个月	1.57%	1.05%	0.49%	1.05%	1.08%	0.00%
自基金转型起至今	0.00%	1.03%	-1.11%	1.03%	1.11%	0.00%

华夏中证 A500ETF 联接 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	3.35%	0.57%	2.68%	0.57%	0.67%	0.00%
过去三个月	1.71%	1.14%	0.83%	1.14%	0.88%	0.00%
过去六个月	1.42%	1.05%	0.49%	1.05%	0.93%	0.00%
自基金转型起至今	-0.17%	1.03%	-1.11%	1.03%	0.94%	0.00%

华夏中证 A500ETF 联接 Y

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	3.38%	0.57%	2.68%	0.57%	0.70%	0.00%
过去三个月	1.79%	1.14%	0.83%	1.14%	0.96%	0.00%
过去六个月	1.58%	1.05%	0.49%	1.05%	1.09%	0.00%
自新增份额类别以来至今	0.78%	1.02%	-0.35%	1.02%	1.13%	0.00%

注：本基金自 2024 年 12 月 13 日增加 Y 类基金份额类别。

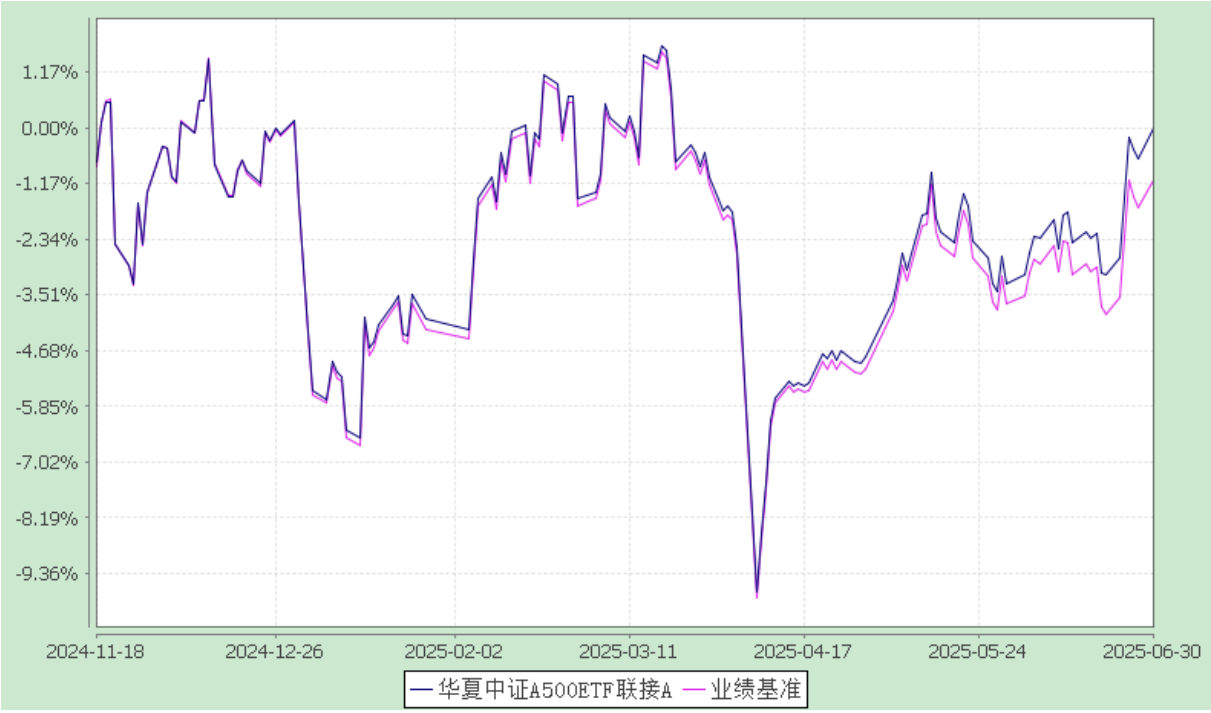
3.2.2 自基金转型以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华夏中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

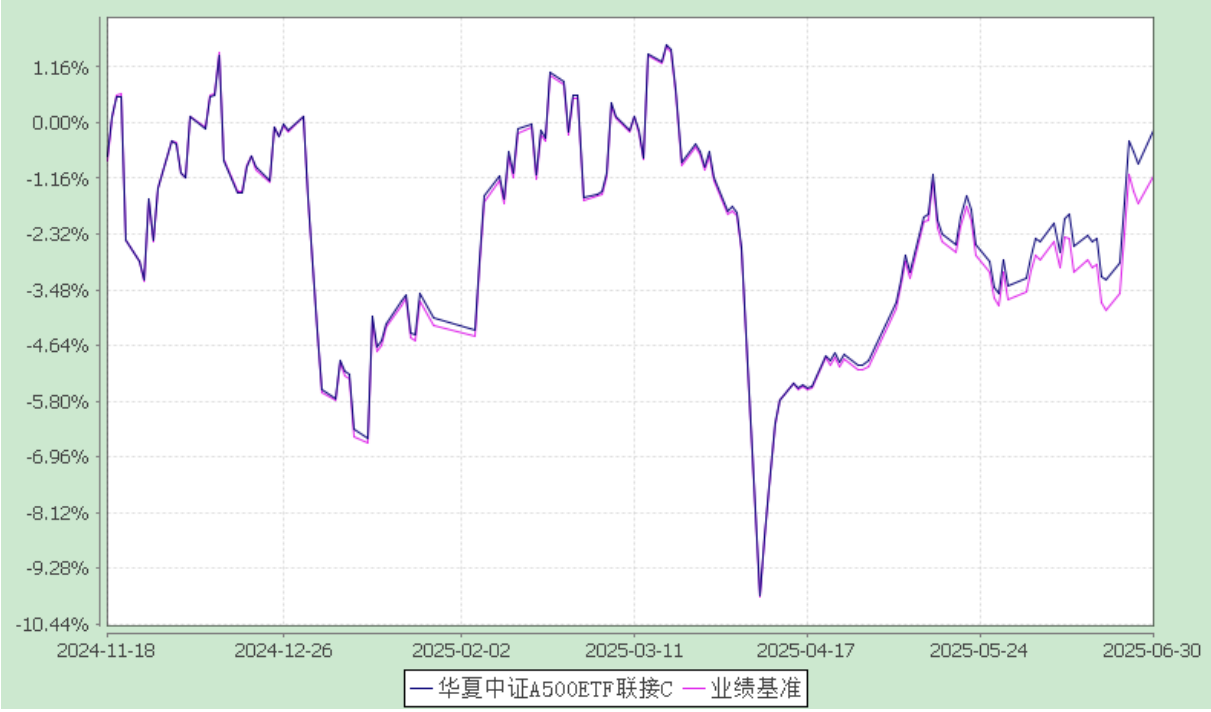
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2024 年 11 月 18 日至 2025 年 6 月 30 日)

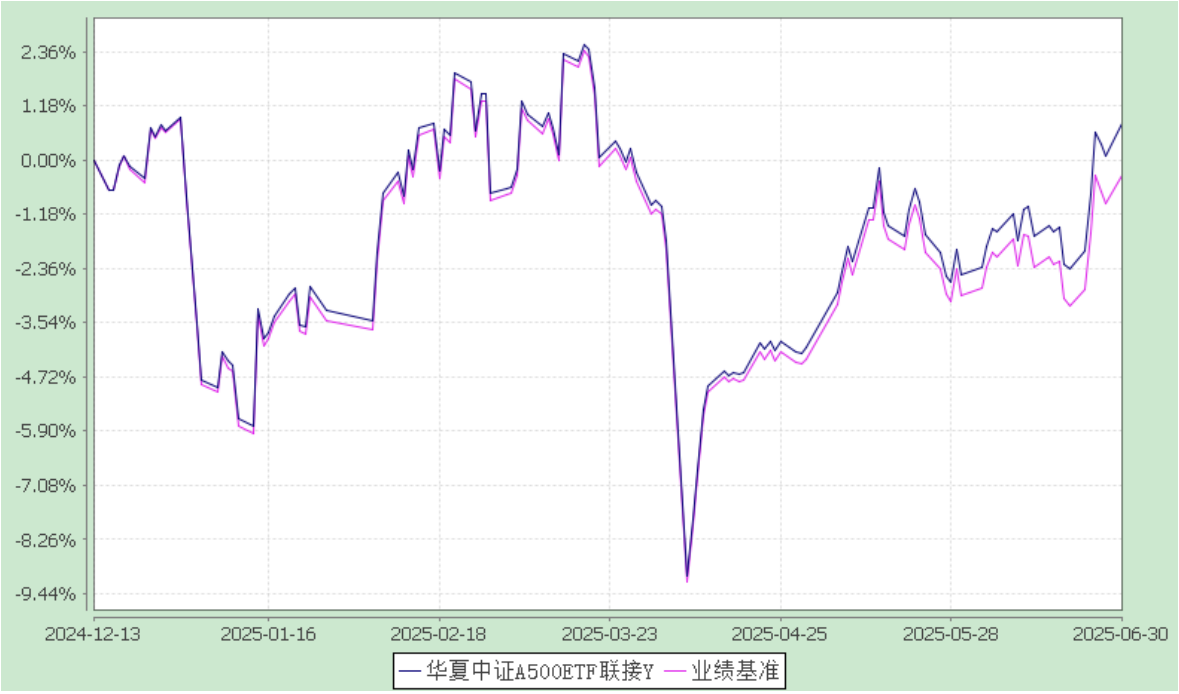
华夏中证 A500ETF 联接 A



华夏中证 A500ETF 联接 C



华夏中证 A500ETF 联接 Y



注：本基金自 2024 年 12 月 13 日增加 Y 类基金份额类别。

①本基金自 2024 年 11 月 18 日起由"华夏中证 A500 指数证券投资基金"转型而来。

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资格、首家加入联合国责任投资原则组织的公募基金公司、首批公募 FOF 基金管理人、首批公募养老目标基金管理人、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、首批公募 MOM 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，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 2025 年 6 月 30 日，华夏基金旗下多只产品近 1 年同类排名领先（基金排名不作为产品未来表现的保证），其中：

主动权益产品：在北交所主题偏股型基金(A 类)中华夏北交所创新中小企业精选两年定开混合发起式排名第 2/11；在灵活配置型基金(基准股票比例 30%-60%)(A 类)中华夏新锦绣混合 A 排名第 3/420、华夏稳增混合排名第 8/420；在混合型 FOF(权益资产 0-30%)(A 类)中华夏聚惠 FOF(A)排名第 8/75；在偏股型基金(股票上下限 60%-95%)(A 类)中华夏智造升级混合 A 排名第 14/1819、华夏成长精选 6 个月定开混合 A 排名第 24/1819、华夏磐润两年定开混合 A 排名第 28/1819、华夏招鑫鸿瑞混合 A 排名第 30/1819、华夏磐益一年定开混合排名第 108/1819、 华夏远见成长一年持有混合 A 排名第 111/1819、华夏行业景气混合排名第 137/1819、华夏核心科技 6 个月定开混合 A 排名第 162/1819、华夏先锋科技一年定开混合 A 类排名第 173/1819、华夏价值精选混合排名第 180/1819；在偏股型基金(股票上限 95%)(A 类)中华夏磐利一年定开混合 A 排名第 6/220、华夏磐锐一年定开混合 A 排名第 9/220；在汽车主题行业偏股型基金(A 类)中华夏汽车产业混合 A 排名第 3/16；在消费行业偏股型基金(A 类)中华夏消费臻选混合发起式 A 排名第 6/82；在养老目标风险 FOF(权益资产 0-30%)(A 类)中华夏稳健养老一年持有混合（FOF）A 排名第 7/81；在养老目标日期 FOF(2035)(A 类)中华夏福泽养老目标 2035 三年持有混合发起式（FOF）A 排名第 4/24。

固收与固收+产品：在普通偏债型基金(股票上限不高于 30%)(A 类)中华夏磐泰混合（LOF）排名第 2/324、华夏永顺一年持有混合 A 排名第 12/324、华夏永康添福混合 A 排名第 29/324；在信用债指数债券型基金(A 类)中华夏亚债中国指数 A 排名第 2/19；在定开纯债债券型基金(A 类)中华夏鼎庆一年定开债券发起式排名第 3/662；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 5/257、华夏聚利债券 A 排名第 7/257；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 8/127；在长期纯债债券型基金(A 类)中华夏鼎茂债券 A 排名第 43/936；在中短期纯债债券型基金(A 类)中华夏中短债债券 A 排名第 22/165；在 QDII 债券型基金(A 类)中华夏收益债券（QDII）A（人民币）排名第 6/24；在普通偏债型基金(股票上限高于 30%)(A 类)中华夏永泓一年持有混合 A 排名第 13/259、华夏永鑫六个月持有混合 A 排名第 30/259。

在《中国证券报》第二十届中国基金业金牛奖评选中，华夏基金荣获“金牛奖 20 周年特别贡献

公司”，连续 8 年荣获“被动投资金牛基金公司”,产品层面华夏创新前沿股票基金荣获“五年期开放式股票型持续优胜金牛基金”，华夏中证 5G 通信主题 ETF 荣获“开放式指数型金牛基金”。在证券时报主办的第十八届中国基金业明星基金奖评选活动上，华夏基金凭借卓越的投资实力以及优秀的中长期业绩回报，将两大奖项收入囊中：公司层面，华夏基金荣获“三年期海外投资明星基金公司”；产品层面，华夏沪深 300ETF 荣获“三年持续回报指数型明星基金奖”。在《上海证券报》主办的第二十届“金基金”奖评选活动上，华夏基金将三大金基金奖项收入囊中：公司层面，华夏基金荣获“金基金·被动投资基金管理公司奖”；产品层面，华夏创新前沿股票基金荣获“金基金·股票型基金五年期奖”，华夏行业景气混合基金荣获“金基金·偏股混合型基金五年期奖”。

在客户服务方面，2025 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）华夏基金直销渠道继续优化页面显示及相关功能，新增双因子验证和交易时间预估功能，给客户更方便直观的使用体验；（2）华夏基金管家客户端新增恒生指数行情，动态追踪港股风向，行情了解更全面，从客户投资需求出发，进一步提升操作体验；（3）与高华证券、广州银行等代销机构合作，拓展更加丰富的客户理财渠道；（4）开展 “如何加入 DeepSeek 的朋友圈？”、“一些 ETF 小妙招送给大家”、“哪吒 2、DeepSeek 火出圈，如何抓住投资机遇？”等活动，为客户提供了多样化的投资者教育和关怀服务。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李俊	本基金的基金经理	2024-11-18	-	17 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）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 74 次，均为指数量化投资组合因投资策略需要发生的反向交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金跟踪的标的指数为中证 A500 指数，基金业绩比较基准为：中证 A500 指数收益率×95%+人民币活期存款利率(税后) ×5%。中证 A500 指数从各行业选取市值较大、流动性较好的 500 只证券作为指数样本，以反映各行业最具代表性上市公司证券的整体表现。本基金通过交易所买卖或申购赎回的方式投资于目标 ETF（华夏中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金），从而实现基金投资目标，基金也可以通过买入中证 A500 指数成份股来跟踪标的指数。

上半年，国际环境依然复杂。特朗普上台后试图推动俄乌会谈，但他寄予厚望的俄乌停火并没出现，相反中东地区紧张局势急剧升级，以色列、伊朗双方从长期的代理人战争转向直接军事对抗，虽然双方冲突已告结束，但中东的动荡并未终结。经贸领域，4 月初，特朗普政府推出“对等关税”，继而是各国围绕关税的反制、暂停、继续谈判……给国际贸易、世界经济带来很大的扰动；面对不确定的环境和关税带来的通胀担忧，美联储维持利率不变，选择了继续观望。

国内方面，上半年国内经济实现了良好开局，虽然受到美国关税政策的冲击，但出口依然表现不俗。生产端数据较好，但需求端依然需要进一步提振，体现出来的就是实际 GDP 增速高于名义 GDP 增速，CPI 依然在低位，PPI 降幅进一步扩大，在这种背景下，治内卷和扩内需成为政策的重要抓手，其目的还是降低低效竞争。与此同时，面临复杂多变的国际环境，建设统一国内大市场，是夯筑起应对复杂变局的坚实依托。微观层面，AI 大模型、创新药等越来越多的领域迎来 DeepSeek 时刻，给了我们更多的信心。

市场方面，1 季度的投资中，DeepSeek 的横空出世是一个重大事件，不仅在科技领域引发了人工智能领域的连锁反应，在投资方面也带来了深远的影响，引发对中国科技板块和中国核心资产的

重新定价。2 季度初，美国推出对等关税给市场造成较大的冲击，但与此同时也冲击了美元、美债、美股，之后的角力与博弈中，关税的影响逐渐钝化，各国股票市场也纷纷收复失地。从全球资产配置角度来看，中国资产确实越来越具有吸引力，一方面来自横向比较下中国经济的韧性，尤其在当前的国际经济环境下；再一个是中国科技领域体现出的创新能力，这些都带来对中国资产的重新评估。

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2025 年 6 月 30 日，华夏中证 A500ETF 联接 A 份额净值为 0.9796 元，本报告期份额净值增长率为 1.57%，同期业绩比较基准增长率 0.49%，本报告期跟踪偏离度为+1.08%；华夏中证 A500ETF 联接 C 份额净值为 0.9777 元，本报告期份额净值增长率为 1.42%，同期业绩比较基准增长率 0.49%，本报告期跟踪偏离度为+0.93%；华夏中证 A500ETF 联接 Y 份额净值为 0.9796 元，本报告期份额净值增长率为 1.58%，同期业绩比较基准增长率 0.49%，本报告期跟踪偏离度为+1.09%。与业绩比较基准产生偏离的主要原因为成份股分红、日常运作费用、指数结构调整、申购赎回等产生的差异。

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，利益再分配的大环境下，世界秩序的解构与重构不可避免。

宏观上我们需要重点关注的依然还是中国经济的运行情况、中国的政策应对、美联储的决策，以及美国的关税措施。中国经济的运行情况，尤其需要关注中国价格因素与背后的供需矛盾；政策方面，需要关注面对国内需求不振、国际经贸复杂背景下，中国的政策应对；美联储的政策，一方面是美国经济自身的压力，一方面是过去抢进口环境下滞后的通胀压力，还有就是来自特朗普本人的压力；国际经贸，主要是各国与美国的关税谈判进展。以上，都是我们未来需要关注的重要因素。

市场方面，积极因素主要有：

（1）主观方面：存款利率持续下调背景下，市场资金的整体配置需求比较高；美元指数下跌的背景下，资金转而选择配置国内市场；中国经济的韧性与科技实力，海外资金开始将眼光投向中国市场。

（2）流动性方面：流动环境持续宽松。全球范围内看，宽货币宽财政成为当前的政策主基调。

（3）产业视角：人工智能、创新药等科技领域产业趋势向上。

未来需要关注的因素：

（1）美国在 AI 方面有没有可能继续与中国拉开差距。

（2）东升西落是长期的叙事，但这个过程也许会充满波折和反复。

（3）关税方面，现在和上世纪 20 年代末最大的不同在于，目前美国是最大的需求提供方，中国是最大的商品输出方，这本身会影响到双方与其他国家的经贸关系。此外，美国需要提高关税创收，也需要再工业化的产能空间，而当前市场对未来的经贸关系计入太多乐观预期。

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 ETF 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

托管人声明:

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

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并

根据监管要求履行报告义务。

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

本中期报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§6 中期报告财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华夏中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

报告截止日：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	217,548,120.07	371,620,389.74
结算备付金		4,532,235.49	55,309,543.41
存出保证金		412,911.60	6,146,438.33
交易性金融资产	6.4.7.2	4,421,341,617.36	4,096,083,321.12
其中：股票投资		146,761,301.08	135,855,288.57
基金投资		4,221,346,724.22	3,960,228,032.55
债券投资		53,233,592.06	-
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		18,518,400.46	-
应收股利		-	-
应收申购款		2,698,716.93	30,434,719.94
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	848,879.26
资产总计		4,665,052,001.91	4,560,443,291.80
负债和净资产	**附注号**	**本期末 2025 年 6 月 30 日**	**上年度末 2024 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		-	163,814,541.33
应付赎回款		63,820,656.67	17,065,128.20
应付管理人报酬		46,119.33	46,059.21
应付托管费		15,373.12	15,353.08
应付销售服务费		726,314.61	644,379.12
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	110,542.44	1,032,112.58
负债合计		64,719,006.17	182,617,573.52
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	4,702,035,032.48	4,540,478,205.99
未分配利润	6.4.7.8	-101,702,036.74	-162,652,487.71
净资产合计		4,600,332,995.74	4,377,825,718.28
负债和净资产总计		4,665,052,001.91	4,560,443,291.80

注：报告截止日 2025 年 6 月 30 日，华夏中证 A500ETF 联接 A 基金份额净值 0.9796 元，华夏中证 A500ETF 联接 C 基金份额净值 0.9777 元，华夏中证 A500ETF 联接 Y 基金份额净值 0.9796 元；华夏中证 A500ETF 联接基金份额总额 4,702,035,032.48 份（其中 A 类 1,623,653,990.37 份，C 类 2,984,919,332.40 份，Y 类 93,461,709.71 份）。

6.2 利润表

会计主体：华夏中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		77,492,983.35
1.利息收入		544,083.00
其中：存款利息收入	6.4.7.9	544,083.00
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）		-315,785.05

其中：股票投资收益	6.4.7.10	-260,317.38
基金投资收益	6.4.7.11	883,622.99
债券投资收益	6.4.7.12	138,674.43
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	-2,789,406.38
股利收益	6.4.7.16	1,711,641.29
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	77,175,442.24
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	89,243.16
减：二、营业总支出		4,868,744.22
1.管理人报酬		308,905.71
2.托管费		102,968.66
3.销售服务费		4,343,227.95
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		8,942.80
8.其他费用	6.4.7.21	104,699.10
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		72,624,239.13
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		72,624,239.13
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		72,624,239.13

6.3 净资产变动表

会计主体：华夏中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 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	4,540,478,205.99	-162,652,487.71	4,377,825,718.28
二、本期期初净资产	4,540,478,205.99	-162,652,487.71	4,377,825,718.28
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	161,556,826.49	60,950,450.97	222,507,277.46
（一）、综合收益总额	-	72,624,239.13	72,624,239.13
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变	161,556,826.49	-11,673,788.16	149,883,038.33

动数（净资产减少以“-”号填列）			
其中：1.基金申购款	1,993,165,892.55	-78,410,416.14	1,914,755,476.41
2.基金赎回款	-1,831,609,066.06	66,736,627.98	-1,764,872,438.08
（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	4,702,035,032.48	-101,702,036.74	4,600,332,995.74

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：张佑君，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

根据《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》等法规规定以及原《华夏中证 A500 指数证券投资基金基金合同》的相关约定，经与基金托管人招商银行股份有限公司协商一致自 2024 年 11 月 18 日起，华夏中证 A500 指数证券投资基金正式转型为华夏中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金。本基金为契约型开放式，存续期限为不定期。根据基金管理人刊登的相关公告，本基金自 2024 年 12 月 13 日增加 Y 类基金份额类别。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和本基金基金合同的有关规定，本基金的标的指数为中证 A500 指数。本基金主要投资于目标 ETF 基金份额、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)、衍生品（包括股指期货、股票期权、国债期货）、资产支持证券、货币市场工具（含同业存单、债券回购等）、银行存款以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金可根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。

基金的投资组合比例为：本基金投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%。每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在 1 年以内的政府债券。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”) 、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会发布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告

和中期报告>》和中国证监会、中国基金业协会允许的如财务报表附注 6.4.4 所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和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[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]103 号《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81 号《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]125 号《财政部、国家税务总局、证监会关于内地与香港基金互认有关税收政策的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《财政部、国家税务总局关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《财政部、国家税务总局关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2023]39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》及其他相关财税法规和实

务操作，主要税项列示如下：

（1）以发行基金方式募集资金不属于增值税征收范围，不征收增值税。

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

（3）基金买卖股票、债券的差价收入免征增值税，暂不征收企业所得税。

（4）存款利息收入不征收增值税。

（5）国债、地方政府债利息收入，金融同业往来利息收入免征增值税。

（6）对基金取得的债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

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

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

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

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 2025 年 6 月 30 日
活期存款	217,548,120.07
等于：本金	217,529,527.88
加：应计利息	18,592.19
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	217,548,120.07

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2025 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		146,779,119.75	-	146,761,301.08	-17,818.67
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	52,851,549.00	281,292.06	53,233,592.06	100,751.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	52,851,549.00	281,292.06	53,233,592.06	100,751.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		4,195,641,029.60	-	4,221,346,724.22	25,705,694.62
其他		-	-	-	-
合计		4,395,271,698.35	281,292.06	4,421,341,617.36	25,788,626.95

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 2025 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	23,761.99
其中：交易所市场	23,761.99
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	86,780.45
合计	110,542.44

6.4.7.7 实收基金

华夏中证 A500ETF 联接 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	1,670,945,876.70	1,670,945,876.70
本期申购	455,326,556.72	455,326,556.72
本期赎回（以“-”号填列）	-502,618,443.05	-502,618,443.05
本期末	1,623,653,990.37	1,623,653,990.37

华夏中证 A500ETF 联接 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	2,831,276,845.48	2,831,276,845.48
本期申购	1,473,932,013.45	1,473,932,013.45
本期赎回（以“-”号填列）	-1,320,289,526.53	-1,320,289,526.53
本期末	2,984,919,332.40	2,984,919,332.40

华夏中证 A500ETF 联接 Y

金额单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日

	基金份额	账面金额
上年度末	38,255,483.81	38,255,483.81
本期申购	63,907,322.38	63,907,322.38
本期赎回（以“-”号填列）	-8,701,096.48	-8,701,096.48
本期末	93,461,709.71	93,461,709.71

6.4.7.8 未分配利润

华夏中证 A500ETF 联接 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-37,489,991.42	-21,862,465.84	-59,352,457.26
本期期初	-37,489,991.42	-21,862,465.84	-59,352,457.26
本期利润	116,281.31	31,252,112.25	31,368,393.56
本期基金份额交易产生的变动数	1,019,819.92	-6,143,438.25	-5,123,618.33
其中：基金申购款	-10,165,453.80	-13,808,473.55	-23,973,927.35
基金赎回款	11,185,273.72	7,665,035.30	18,850,309.02
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-36,353,890.19	3,246,208.16	-33,107,682.03

华夏中证 A500ETF 联接 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-64,907,317.34	-37,032,182.42	-101,939,499.76
本期期初	-64,907,317.34	-37,032,182.42	-101,939,499.76
本期利润	-4,665,620.97	43,296,661.98	38,631,041.01
本期基金份额交易产生的变动数	-2,954,450.05	-421,339.87	-3,375,789.92
其中：基金申购款	-33,887,888.58	-17,052,958.83	-50,940,847.41
基金赎回款	30,933,438.53	16,631,618.96	47,565,057.49
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-72,527,388.36	5,843,139.69	-66,684,248.67

华夏中证 A500ETF 联接 Y

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	-860,007.23	-500,523.46	-1,360,530.69
本期期初	-860,007.23	-500,523.46	-1,360,530.69
本期利润	-1,863.45	2,626,668.01	2,624,804.56
本期基金份额交易产生的变动数	-1,235,047.59	-1,939,332.32	-3,174,379.91
其中：基金申购款	-1,429,658.52	-2,065,982.86	-3,495,641.38

基金赎回款	194,610.93	126,650.54	321,261.47
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-2,096,918.27	186,812.23	-1,910,106.04

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	415,723.80
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	104,555.39
其他	23,803.81
合计	544,083.00

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	229,073.25
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-489,390.63
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-260,317.38

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	68,183,110.24
减：卖出股票成本总额	67,878,095.60
减：交易费用	75,941.39
买卖股票差价收入	229,073.25

6.4.7.10.3 股票投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
申购基金份额总额	32,796,600.00
减：现金支付申购款总额	14,760,098.00
减：申购股票成本总额	18,525,892.63

减：交易费用	-
申购差价收入	-489,390.63

6.4.7.11 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
卖出/赎回基金成交总额	636,358,223.94
减：卖出/赎回基金成本总额	635,288,926.04
减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额	128,332.67
减：交易费用	57,342.24
基金投资收益	883,622.99

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 2025年1月1日至2025年6月30日
债券投资收益——利息收入	144,497.79
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-5,823.36
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	138,674.43

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 2025年1月1日至2025年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	20,019,399.50
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	19,928,843.00
减：应计利息总额	96,379.48
减：交易费用	0.38
买卖债券差价收入	-5,823.36

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 2025年1月1日至2025年6月30日
股指期货投资收益	-2,789,406.38

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,711,641.29
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	1,711,641.29

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
1.交易性金融资产	76,670,810.24
——股票投资	2,916,442.72
——债券投资	100,751.00
——资产支持证券投资	-
——基金投资	73,653,616.52
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	504,632.00
——权证投资	-
——期货投资	504,632.00
4.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	77,175,442.24

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
基金赎回费收入	89,243.16
合计	89,243.16

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 2025年1月1日至2025年6月30日
审计费用	27,273.08
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	17,918.65
合计	104,699.10

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 关联方关系

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

本基金本报告期不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华夏基金管理有限公司	基金管理人
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	基金托管人
华夏中证A500交易型开放式指数证券投资基金(“目标ETF”)	本基金是该基金的联接基金
中信证券股份有限公司（“中信证券”）	基金管理人的股东
上海华夏财富投资管理有限公司（“华夏财富”）	基金管理人的子公司
中信证券华南股份有限公司（“中信证券（华南）”）	基金管理人第一大股东的子公司
中信证券（山东）有限责任公司（“中信证券（山东）”）	基金管理人第一大股东的子公司
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 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
中信证券	65,950,614.65	40.98%

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年1月1日至2025年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例
中信证券	9,349.50	0.01%

6.4.10.1.4 债券回购交易

无。

6.4.10.1.5 基金交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年1月1日至2025年6月30日	
	成交金额	占当期基金交易成交总额的比例
中信证券	715,644,489.73	50.17%

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 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	12,920.30	40.98%	8,444.51	35.54%

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 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	308,905.71
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,419,688.42
应支付基金管理人的净管理费	-1,110,782.71

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扣除基金资产中目标 ETF 份额所对应资产净值后剩余部分(剩余部分若为负数则取 0)的 0.15%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＝(前一日的基金资产净值–前一日基金资产中目标 ETF 份额所对应资产净值) ×年费率/当年天数。若前一日的基金资产净值扣除基金资产中目标 ETF 份额所对应资产净值后剩余部分为负数，则按 0 计算。

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。

④对于基金中基金、ETF 联接基金等特殊类型的基金产品，由于基金管理人不得对基金财产中持有的自身管理的基金部分收取管理费，但客户维护费的收取标准并不调减，可能出现净管理费为负值的情况。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 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	102,968.66

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扣除基金资产中目标 ETF 份额所对应资产净值后剩余部分(剩余部分若为负数则取 0)的 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＝（前一日的基金资产净值–前一日基金资产中目标

ETF 份额所对应资产净值）×年费率/当年天数。若前一日的基金资产净值扣除基金资产中目标 ETF 份额所对应资产净值后剩余部分为负数，则按 0 计算。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2025年1月1日至2025年6月30日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	华夏中证 A500ETF 联接 A	华夏中证 A500ETF 联接 C	华夏中证 A500ETF 联接 Y	合计
招商银行	-	3,325,026.62	-	3,325,026.62
华夏基金管理有限公司	-	266,703.82	-	266,703.82
中信证券	-	4,543.12	-	4,543.12
华夏财富	-	3,876.63	-	3,876.63
中信证券（华南）	-	1,633.39	-	1,633.39
中信证券（山东）	-	410.25	-	410.25
中信期货	-	1.81	-	1.81
合计	-	3,602,195.64	-	3,602,195.64

注：①支付基金销售机构的基金销售服务费按 C 类基金份额前一日基金资产净值 0.30%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给基金管理人，再由基金管理人计算并支付给各基金销售机构。

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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日		
	华夏中证 A500ETF 联接 A	华夏中证 A500ETF 联接 C	华夏中证 A500ETF 联接 Y
期初持有的基金份额	163,082,254.61	-	-
期间申购/买入总份额	-	-	-
期间因拆分变动份额	-	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-	-
期末持有的基金份额	163,082,254.61	-	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	10.04%	-	-

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年1月1日至2025年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
招商银行活期存款	217,548,120.07	415,723.80

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

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 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	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

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

于 2025 年 6 月 30 日，本基金持有的中信证券股票估值总额为 1,325,760.00 元，占基金资产净值的比例为 0.03%（2024 年 12 月 31 日，本基金持有的中信证券股票估值总额为 1,621,852.00 元，

占基金资产净值的比例为 0.04%）。

于 2025 年 6 月 30 日，本基金持有的招商银行股票估值总额为 2,095,320.00 元，占基金资产净值的比例为 0.05%（2024 年 12 月 31 日，本基金持有的招商银行股票估值总额为 2,766,720.00 元，占基金资产净值的比例为 0.06%）。

本基金本报告期通过中信期货买卖期货成交额为 925,790,040.00 元，支付给中信期货的佣金为 21,357.71 元。

截至 2025 年 6 月 30 日止，本基金持有 4,377,174,123 份目标 ETF 基金份额（2024 年 12 月 31 日：4,172,174,497 份），占其总份额的比例为 26.47%（2024 年 12 月 31 日：21.51%）。

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（2025 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(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688775	影石创新	2025-06-04	6 个月	新发流通受限	47.27	124.16	573	27,085.71	71,143.68	-
603049	中策橡胶	2025-05-27	6 个月	新发流通受限	46.50	42.85	724	33,666.00	31,023.40	-
301275	汉朔科技	2025-03-04	6 个月	新发流通受限	27.50	56.19	397	10,917.50	22,307.43	-
301501	恒鑫生活	2025-03-11	6 个月	新发流通受限	39.92	45.22	349	9,620.72	15,781.78	含证券送配
603202	天有为	2025-04-16	6 个月	新发流通受限	93.50	90.66	166	15,521.00	15,049.56	-
301479	弘景	2025-03-06	6 个月	新发流通	41.90	77.87	182	5,447.00	14,172.34	含证券送

	光电			受限						配
301535	浙江华远	2025-03-18	6 个月	新发流通受限	4.92	18.99	734	3,611.28	13,938.66	-
688757	胜科纳米	2025-03-18	6 个月	新发流通受限	9.08	25.94	536	4,866.88	13,903.84	-
001388	信通电子	2025-06-24	1 个月内（含）	新发流通受限	16.42	16.42	843	13,842.06	13,842.06	-
301662	宏工科技	2025-04-10	6 个月	新发流通受限	26.60	82.50	143	3,803.80	11,797.50	-
301658	首航新能	2025-03-26	6 个月	新发流通受限	11.80	22.98	437	5,156.60	10,042.26	-
301665	泰禾股份	2025-04-02	6 个月	新发流通受限	10.27	22.39	393	4,036.11	8,799.27	-
688755	汉邦科技	2025-05-09	6 个月	新发流通受限	22.77	39.33	203	4,622.31	7,983.99	-
001382	新亚电缆	2025-03-13	6 个月	新发流通受限	7.40	20.21	366	2,708.40	7,396.86	-
603014	威高血净	2025-05-12	6 个月	新发流通受限	26.50	32.68	205	5,432.50	6,699.40	-
301636	泽润新能	2025-04-30	6 个月	新发流通受限	33.06	47.46	128	4,231.68	6,074.88	-
301595	太力	2025-05-12	6 个月	新发流通	17.05	29.10	196	3,341.80	5,703.60	-

	科技			受限						
301560	众捷汽车	2025-04-17	6 个月	新发流通受限	16.50	27.45	190	3,135.00	5,215.50	-
603210	泰鸿万立	2025-04-01	6 个月	新发流通受限	8.60	15.61	286	2,459.60	4,464.46	-
603271	永杰新材	2025-03-04	6 个月	新发流通受限	20.60	35.08	126	2,595.60	4,420.08	-
603124	江南新材	2025-03-12	6 个月	新发流通受限	10.54	46.31	88	927.52	4,075.28	-
603409	汇通控股	2025-02-25	6 个月	新发流通受限	24.18	33.32	100	2,418.00	3,332.00	-
001390	古麒绒材	2025-05-21	6 个月	新发流通受限	12.08	18.12	178	2,150.24	3,225.36	-
603257	中国瑞林	2025-03-28	6 个月	新发流通受限	20.52	37.47	78	1,600.56	2,922.66	-
603400	华之杰	2025-06-12	6 个月	新发流通受限	19.88	43.81	57	1,133.16	2,497.17	-
603382	海阳科技	2025-06-05	6 个月	新发流通受限	11.50	22.39	105	1,207.50	2,350.95	-
001335	信凯科技	2025-04-02	6 个月	新发流通受限	12.80	28.05	80	1,024.00	2,244.00	-
603120	肯特催	2025-04-09	6 个月	新发流通受限	15.00	33.43	65	975.00	2,172.95	-

	化									
001388	信通电子	2025-06-24	6 个月	新发流通受限	16.42	16.42	94	1,543.48	1,543.48	-

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

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

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

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

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

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，本基金主要通过交易所买卖或申购赎回的方式投资于流动性较好的目标 ETF 基金，基金管理人持续监测目标 ETF 基金的市场交易量、申赎情况及标的指数成份股流动性等影响资产流动性的因素，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。

本基金主要通过投资于目标 ETF 基金份额、标的指数成份股、备选成份股来跟踪标的指数。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。

本基金主要投资于目标 ETF 基金份额、标的指数成份股、备选成份股。本基金的其他价格风险与目标 ETF 基金相似。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 2025 年 6 月 30 日		上年度末 2024 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	146,761,301.08	3.19	135,855,288.57	3.10
交易性金融资产－基金投资	4,221,346,724.22	91.76	3,960,228,032.55	90.46
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	4,368,108,025.30	94.95	4,096,083,321.12	93.56

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

②由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中证 A500 指数以外的其他市场变量保持不变

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
	-5%	-218,282,517.65	-206,248,105.06
	+5%	218,282,517.65	206,248,105.06

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 2025 年 6 月 30 日
第一层次	4,367,793,900.90
第二层次	53,248,977.60
第三层次	298,738.86
合计	4,421,341,617.36

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）和非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并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应属第二层次或第三层次。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 2025 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	146,761,301.08	3.15
	其中：股票	146,761,301.08	3.15
2	基金投资	4,221,346,724.22	90.49
3	固定收益投资	53,233,592.06	1.14
	其中：债券	53,233,592.06	1.14
	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	222,080,355.56	4.76
8	其他各项资产	21,630,028.99	0.46
9	合计	4,665,052,001.91	100.00

7.2 期末投资目标基金明细

金额单位：人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	华夏中证 A500ETF	股票型	交易型开放式	华夏基金管理有限公司	4,221,346,724.22	91.76

7.3 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	605,752.00	0.01
B	采矿业	7,420,667.00	0.16
C	制造业	96,326,701.62	2.09
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,128,339.82	0.07
E	建筑业	1,645,500.60	0.04
F	批发和零售业	1,574,657.58	0.03

G	交通运输、仓储和邮政业	3,933,438.00	0.09
H	住宿和餐饮业	97,245.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,814,594.76	0.24
J	金融业	15,327,369.00	0.33
K	房地产业	795,786.00	0.02
L	租赁和商务服务业	2,148,600.20	0.05
M	科学研究和技术服务业	1,851,502.50	0.04
N	水利、环境和公共设施管理业	50,850.00	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	104,958.00	0.00
Q	卫生和社会工作	486,896.00	0.01
R	文化、体育和娱乐业	448,443.00	0.01
S	综合	-	-
	合计	146,761,301.08	3.19

7.4 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	300750	宁德时代	19,000	4,792,180.00	0.10
2	600519	贵州茅台	3,000	4,228,560.00	0.09
3	601318	中国平安	60,400	3,350,992.00	0.07
4	600036	招商银行	45,600	2,095,320.00	0.05
5	000333	美的集团	28,000	2,021,600.00	0.04
6	600900	长江电力	63,185	1,904,395.90	0.04
7	601899	紫金矿业	96,916	1,889,862.00	0.04
8	300059	东方财富	73,600	1,702,368.00	0.04
9	002594	比亚迪	4,500	1,493,595.00	0.03
10	002475	立讯精密	39,900	1,384,131.00	0.03
11	600030	中信证券	48,000	1,325,760.00	0.03
12	600276	恒瑞医药	25,300	1,313,070.00	0.03
13	000651	格力电器	28,900	1,298,188.00	0.03
14	300014	亿纬锂能	28,300	1,296,423.00	0.03
15	300124	汇川技术	19,500	1,259,115.00	0.03
16	688981	中芯国际	14,184	1,250,603.28	0.03
17	000725	京东方 A	291,800	1,164,282.00	0.03
18	601166	兴业银行	49,700	1,159,998.00	0.03
19	002371	北方华创	2,600	1,149,746.00	0.02
20	600887	伊利股份	40,800	1,137,504.00	0.02
21	000858	五粮液	9,500	1,129,550.00	0.02
22	603659	璞泰来	59,500	1,117,410.00	0.02
23	688256	寒武纪	1,828	1,099,542.00	0.02
24	605499	东鹏饮料	3,500	1,099,175.00	0.02

25	601088	中国神华	26,400	1,070,256.00	0.02
26	300308	中际旭创	7,200	1,050,192.00	0.02
27	603259	药明康德	14,700	1,022,385.00	0.02
28	300502	新易盛	7,380	937,407.60	0.02
29	601398	工商银行	113,900	864,501.00	0.02
30	601601	中国太保	23,000	862,730.00	0.02
31	300274	阳光电源	12,700	860,679.00	0.02
32	601728	中国电信	110,600	857,150.00	0.02
33	688041	海光信息	6,033	852,402.57	0.02
34	000063	中兴通讯	25,600	831,744.00	0.02
35	002415	海康威视	29,400	815,262.00	0.02
36	601225	陕西煤业	41,300	794,612.00	0.02
37	600415	小商品城	37,900	783,772.00	0.02
38	603501	豪威集团	6,000	765,900.00	0.02
39	300760	迈瑞医疗	3,400	764,150.00	0.02
40	600941	中国移动	6,600	742,830.00	0.02
41	603019	中科曙光	10,500	739,200.00	0.02
42	300024	机器人	42,600	731,868.00	0.02
43	002008	大族激光	29,900	728,663.00	0.02
44	601012	隆基绿能	48,400	726,968.00	0.02
45	688012	中微公司	3,939	718,079.70	0.02
46	002472	双环传动	21,400	716,686.00	0.02
47	002230	科大讯飞	14,500	694,260.00	0.02
48	601816	京沪高铁	120,600	693,450.00	0.02
49	688777	中控技术	14,917	669,922.47	0.01
50	600690	海尔智家	26,900	666,582.00	0.01
51	600111	北方稀土	25,900	644,910.00	0.01
52	000100	TCL 科技	147,900	640,407.00	0.01
53	601888	中国中免	10,500	640,185.00	0.01
54	300476	胜宏科技	4,700	631,586.00	0.01
55	688111	金山办公	2,205	617,510.25	0.01
56	688008	澜起科技	7,432	609,424.00	0.01
57	603986	兆易创新	4,800	607,344.00	0.01
58	603486	科沃斯	10,400	605,592.00	0.01
59	600050	中国联通	113,000	603,420.00	0.01
60	000967	盈峰环境	85,600	594,920.00	0.01
61	688169	石头科技	3,745	586,279.75	0.01
62	002352	顺丰控股	11,800	575,368.00	0.01
63	600438	通威股份	33,500	561,125.00	0.01
64	600188	兖矿能源	45,700	556,169.00	0.01
65	002714	牧原股份	13,200	554,532.00	0.01
66	002050	三花智控	21,000	553,980.00	0.01
67	601857	中国石油	64,600	552,330.00	0.01

68	601328	交通银行	68,300	546,400.00	0.01
69	300033	同花顺	2,000	546,020.00	0.01
70	601288	农业银行	91,300	536,844.00	0.01
71	000568	泸州老窖	4,700	532,980.00	0.01
72	600309	万华化学	9,800	531,748.00	0.01
73	601668	中国建筑	84,980	490,334.60	0.01
74	002459	晶澳科技	47,600	475,048.00	0.01
75	603288	海天味业	12,160	473,145.60	0.01
76	600919	江苏银行	38,800	463,272.00	0.01
77	000831	中国稀土	12,800	462,336.00	0.01
78	600760	中航沈飞	7,740	453,718.80	0.01
79	002241	歌尔股份	19,400	452,408.00	0.01
80	002463	沪电股份	10,500	447,090.00	0.01
81	605117	德业股份	8,380	441,290.80	0.01
82	600315	上海家化	20,900	440,363.00	0.01
83	002422	科伦药业	12,200	438,224.00	0.01
84	688599	天合光能	30,048	436,597.44	0.01
85	600019	宝钢股份	66,200	436,258.00	0.01
86	300763	锦浪科技	7,600	436,164.00	0.01
87	601985	中国核电	46,600	434,312.00	0.01
88	000938	紫光股份	18,000	431,820.00	0.01
89	688390	固德威	9,863	428,547.35	0.01
90	600031	三一重工	23,800	427,210.00	0.01
91	002625	光启技术	10,600	423,788.00	0.01
92	000977	浪潮信息	8,300	422,304.00	0.01
93	002027	分众传媒	57,700	421,210.00	0.01
94	603806	福斯特	31,900	413,424.00	0.01
95	601628	中国人寿	10,000	411,900.00	0.01
96	688235	百济神州	1,746	407,935.44	0.01
97	002384	东山精密	10,800	407,916.00	0.01
98	000963	华东医药	10,100	407,636.00	0.01
99	000338	潍柴动力	26,400	406,032.00	0.01
100	603605	珀莱雅	4,900	405,671.00	0.01
101	002128	电投能源	20,100	397,578.00	0.01
102	600000	浦发银行	28,600	396,968.00	0.01
103	601919	中远海控	26,300	395,552.00	0.01
104	002294	信立泰	8,300	392,839.00	0.01
105	300073	当升科技	8,800	386,056.00	0.01
106	603993	洛阳钼业	44,700	376,374.00	0.01
107	601127	赛力斯	2,800	376,096.00	0.01
108	688271	联影医疗	2,913	372,106.62	0.01
109	600406	国电南瑞	16,600	372,006.00	0.01
110	600010	包钢股份	206,400	369,456.00	0.01

111	600655	豫园股份	66,400	368,520.00	0.01
112	000001	平安银行	30,300	365,721.00	0.01
113	600570	恒生电子	10,700	358,878.00	0.01
114	000661	长春高新	3,600	357,048.00	0.01
115	300433	蓝思科技	16,000	356,800.00	0.01
116	600893	航发动力	9,200	354,568.00	0.01
117	601766	中国中车	50,100	352,704.00	0.01
118	300408	三环集团	10,500	350,700.00	0.01
119	002049	紫光国微	5,300	349,058.00	0.01
120	688005	容百科技	15,459	345,044.88	0.01
121	688617	惠泰医疗	1,146	340,362.00	0.01
122	600584	长电科技	10,000	336,900.00	0.01
123	600196	复星医药	13,400	336,206.00	0.01
124	002179	中航光电	8,300	334,988.00	0.01
125	300015	爱尔眼科	26,800	334,464.00	0.01
126	600547	山东黄金	10,400	332,072.00	0.01
127	300347	泰格医药	6,200	330,584.00	0.01
128	002831	裕同科技	13,900	325,538.00	0.01
129	000988	华工科技	6,900	324,369.00	0.01
130	002709	天赐材料	17,700	320,724.00	0.01
131	000792	盐湖股份	18,600	317,688.00	0.01
132	300339	润和软件	6,200	315,146.00	0.01
133	300568	星源材质	24,700	313,196.00	0.01
134	600009	上海机场	9,800	311,346.00	0.01
135	000425	徐工机械	40,000	310,800.00	0.01
136	002821	凯莱英	3,500	308,875.00	0.01
137	688180	君实生物	9,085	308,708.30	0.01
138	600660	福耀玻璃	5,400	307,854.00	0.01
139	000625	长安汽车	24,000	306,240.00	0.01
140	600150	中国船舶	9,400	305,876.00	0.01
141	300759	康龙化成	12,300	301,842.00	0.01
142	300394	天孚通信	3,660	292,214.40	0.01
143	000538	云南白药	5,200	290,108.00	0.01
144	000932	华菱钢铁	65,800	289,520.00	0.01
145	600938	中国海油	10,900	284,599.00	0.01
146	300558	贝达药业	4,900	283,955.00	0.01
147	688036	传音控股	3,531	281,420.70	0.01
148	002007	华兰生物	17,900	280,493.00	0.01
149	600436	片仔癀	1,400	280,014.00	0.01
150	600392	盛和资源	21,200	279,204.00	0.01
151	002456	欧菲光	23,500	278,475.00	0.01
152	002318	久立特材	11,900	278,341.00	0.01
153	601988	中国银行	49,500	278,190.00	0.01

154	300142	沃森生物	24,800	272,800.00	0.01
155	601607	上海医药	15,200	271,776.00	0.01
156	300122	智飞生物	13,800	270,342.00	0.01
157	600183	生益科技	8,900	268,335.00	0.01
158	600362	江西铜业	11,400	267,102.00	0.01
159	600867	通化东宝	32,500	266,500.00	0.01
160	600535	天士力	16,900	264,485.00	0.01
161	002508	老板电器	13,800	262,338.00	0.01
162	000708	中信特钢	22,200	261,072.00	0.01
163	000629	钒钛股份	101,400	259,584.00	0.01
164	600516	方大炭素	55,200	256,128.00	0.01
165	600115	中国东航	63,400	255,502.00	0.01
166	600489	中金黄金	17,400	254,562.00	0.01
167	688120	华海清科	1,508	254,399.60	0.01
168	600905	三峡能源	59,600	253,896.00	0.01
169	002195	岩山科技	44,800	252,224.00	0.01
170	601360	三六零	24,700	251,940.00	0.01
171	301236	软通动力	4,600	251,344.00	0.01
172	603392	万泰生物	4,100	250,100.00	0.01
173	002236	大华股份	15,700	249,316.00	0.01
174	600104	上汽集团	15,500	248,775.00	0.01
175	600089	特变电工	20,700	246,951.00	0.01
176	000768	中航西飞	9,000	246,060.00	0.01
177	300661	圣邦股份	3,280	238,685.60	0.01
178	300601	康泰生物	15,700	238,483.00	0.01
179	600048	保利发展	29,400	238,140.00	0.01
180	603799	华友钴业	6,400	236,928.00	0.01
181	002916	深南电路	2,170	233,947.70	0.01
182	601006	大秦铁路	35,400	233,640.00	0.01
183	600988	赤峰黄金	9,200	228,896.00	0.00
184	600418	江淮汽车	5,700	228,513.00	0.00
185	000630	铜陵有色	68,300	228,122.00	0.00
186	300866	安克创新	2,000	227,200.00	0.00
187	600879	航天电子	21,700	227,199.00	0.00
188	000066	中国长城	15,200	224,960.00	0.00
189	688002	睿创微纳	3,224	224,777.28	0.00
190	688047	龙芯中科	1,651	220,226.89	0.00
191	302132	中航成飞	2,500	219,850.00	0.00
192	002273	水晶光电	11,000	219,670.00	0.00
193	600862	中航高科	8,400	219,072.00	0.00
194	688099	晶晨股份	3,083	218,923.83	0.00
195	600487	亨通光电	14,300	218,790.00	0.00
196	002028	思源电气	3,000	218,730.00	0.00

197	601600	中国铝业	31,000	218,240.00	0.00
198	688126	沪硅产业	11,564	216,478.08	0.00
199	688072	拓荆科技	1,407	216,269.97	0.00
200	601989	中国重工	46,500	215,760.00	0.00
201	600029	南方航空	36,500	215,350.00	0.00
202	002156	通富微电	8,400	215,208.00	0.00
203	601168	西部矿业	12,900	214,527.00	0.00
204	002920	德赛西威	2,100	214,473.00	0.00
205	600839	四川长虹	22,000	213,840.00	0.00
206	000002	万科 A	33,200	213,144.00	0.00
207	002517	恺英网络	10,900	210,479.00	0.00
208	000733	振华科技	4,200	210,210.00	0.00
209	002465	海格通信	15,000	209,100.00	0.00
210	600460	士兰微	8,400	208,488.00	0.00
211	600585	海螺水泥	9,700	208,259.00	0.00
212	002129	TCL 中环	27,100	208,128.00	0.00
213	300017	网宿科技	19,400	207,968.00	0.00
214	000878	云南铜业	16,300	207,336.00	0.00
215	300782	卓胜微	2,900	206,973.00	0.00
216	600745	闻泰科技	6,100	204,533.00	0.00
217	002185	华天科技	20,200	204,020.00	0.00
218	600372	中航机载	16,900	203,814.00	0.00
219	688122	西部超导	3,924	203,577.12	0.00
220	601111	中国国航	25,800	203,562.00	0.00
221	688396	华润微	4,295	202,552.20	0.00
222	002252	上海莱士	29,300	201,291.00	0.00
223	600795	国电电力	40,988	198,381.92	0.00
224	600588	用友网络	14,800	197,876.00	0.00
225	601319	中国人保	22,700	197,717.00	0.00
226	688608	恒玄科技	560	194,868.80	0.00
227	601021	春秋航空	3,500	194,775.00	0.00
228	002558	巨人网络	8,200	193,110.00	0.00
229	600497	驰宏锌锗	36,000	190,440.00	0.00
230	601390	中国中铁	33,800	189,618.00	0.00
231	002001	新和成	8,700	185,049.00	0.00
232	002281	光迅科技	3,700	182,484.00	0.00
233	002460	赣锋锂业	5,400	182,358.00	0.00
234	002414	高德红外	17,600	180,400.00	0.00
235	300223	北京君正	2,600	179,920.00	0.00
236	300454	深信服	1,900	178,942.00	0.00
237	002180	纳思达	7,800	178,932.00	0.00
238	300395	菲利华	3,500	178,850.00	0.00
239	002138	顺络电子	6,300	177,156.00	0.00

240	300251	光线传媒	8,700	176,349.00	0.00
241	002074	国轩高科	5,400	175,284.00	0.00
242	300896	爱美客	1,000	174,810.00	0.00
243	002436	兴森科技	13,200	174,768.00	0.00
244	300136	信维通信	7,800	174,720.00	0.00
245	600886	国投电力	11,800	173,932.00	0.00
246	000157	中联重科	24,000	173,520.00	0.00
247	601669	中国电建	35,600	173,372.00	0.00
248	002648	卫星化学	9,900	171,567.00	0.00
249	300346	南大光电	5,420	171,488.80	0.00
250	000975	山金国际	9,000	170,460.00	0.00
251	600160	巨化股份	5,900	169,212.00	0.00
252	002065	东华软件	17,600	168,960.00	0.00
253	002938	鹏鼎控股	5,200	166,556.00	0.00
254	300496	中科创达	2,900	165,938.00	0.00
255	600316	洪都航空	4,400	165,880.00	0.00
256	300054	鼎龙股份	5,700	163,476.00	0.00
257	002466	天齐锂业	5,100	163,404.00	0.00
258	300383	光环新网	11,400	163,020.00	0.00
259	600038	中直股份	4,200	163,002.00	0.00
260	600118	中国卫星	5,700	162,849.00	0.00
261	000807	云铝股份	10,100	161,398.00	0.00
262	002555	三七互娱	9,300	160,797.00	0.00
263	300474	景嘉微	2,200	160,600.00	0.00
264	002405	四维图新	18,800	160,552.00	0.00
265	300002	神州泰岳	13,600	160,480.00	0.00
266	300699	光威复材	5,000	158,350.00	0.00
267	002340	格林美	24,900	158,115.00	0.00
268	603979	金诚信	3,400	157,896.00	0.00
269	000408	藏格矿业	3,700	157,879.00	0.00
270	001979	招商蛇口	17,700	155,229.00	0.00
271	003816	中国广核	42,300	153,972.00	0.00
272	601727	上海电气	20,800	153,712.00	0.00
273	300604	长川科技	3,400	152,694.00	0.00
274	601186	中国铁建	18,900	151,389.00	0.00
275	002601	龙佰集团	9,300	150,753.00	0.00
276	688506	百利天恒	504	149,244.48	0.00
277	603087	甘李药业	2,700	147,906.00	0.00
278	600161	天坛生物	7,700	147,763.00	0.00
279	600989	宝丰能源	9,100	146,874.00	0.00
280	300207	欣旺达	7,300	146,438.00	0.00
281	300253	卫宁健康	13,800	146,280.00	0.00
282	600845	宝信软件	6,100	144,082.00	0.00

283	601100	恒立液压	2,000	144,000.00	0.00
284	600563	法拉电子	1,300	141,817.00	0.00
285	601058	赛轮轮胎	10,800	141,696.00	0.00
286	600028	中国石化	24,800	139,872.00	0.00
287	002624	完美世界	9,200	139,564.00	0.00
288	002410	广联达	10,400	139,464.00	0.00
289	300628	亿联网络	4,000	139,040.00	0.00
290	002202	金风科技	13,500	138,375.00	0.00
291	300450	先导智能	5,500	136,675.00	0.00
292	600498	烽火通信	6,300	132,489.00	0.00
293	000034	神州数码	3,500	131,740.00	0.00
294	002152	广电运通	9,800	131,712.00	0.00
295	601800	中国交建	14,500	128,905.00	0.00
296	600426	华鲁恒升	5,900	127,853.00	0.00
297	688188	柏楚电子	952	125,340.32	0.00
298	688578	艾力斯	1,344	125,045.76	0.00
299	000933	神火股份	7,500	124,800.00	0.00
300	600004	白云机场	13,700	124,670.00	0.00
301	002223	鱼跃医疗	3,500	124,600.00	0.00
302	300627	华测导航	3,540	123,900.00	0.00
303	600085	同仁堂	3,400	122,604.00	0.00
304	300003	乐普医疗	8,800	121,264.00	0.00
305	600096	云天化	5,500	120,835.00	0.00
306	002409	雅克科技	2,200	120,318.00	0.00
307	001965	招商公路	10,000	120,000.00	0.00
308	000519	中兵红箭	5,400	118,206.00	0.00
309	601689	拓普集团	2,500	118,125.00	0.00
310	601868	中国能建	52,600	117,298.00	0.00
311	300316	晶盛机电	4,300	116,745.00	0.00
312	601117	中国化学	15,200	116,584.00	0.00
313	300088	长信科技	19,500	116,220.00	0.00
314	688223	晶科能源	22,257	115,513.83	0.00
315	002131	利欧股份	32,900	115,150.00	0.00
316	300058	蓝色光标	17,320	113,619.20	0.00
317	002025	航天电器	2,200	113,102.00	0.00
318	002532	天山铝业	13,600	113,016.00	0.00
319	300315	掌趣科技	18,600	112,902.00	0.00
320	603613	国联股份	4,700	111,343.00	0.00
321	002841	视源股份	3,200	110,720.00	0.00
322	600219	南山铝业	28,900	110,687.00	0.00
323	000738	航发控制	5,300	109,975.00	0.00
324	000423	东阿阿胶	2,100	109,830.00	0.00
325	300459	汤姆猫	19,600	109,760.00	0.00

326	002078	太阳纸业	8,100	109,026.00	0.00
327	300724	捷佳伟创	2,000	108,600.00	0.00
328	600482	中国动力	4,700	108,429.00	0.00
329	600352	浙江龙盛	10,600	107,696.00	0.00
330	600741	华域汽车	6,100	107,665.00	0.00
331	300285	国瓷材料	6,200	107,570.00	0.00
332	601877	正泰电器	4,700	106,549.00	0.00
333	002738	中矿资源	3,300	106,128.00	0.00
334	000786	北新建材	4,000	105,920.00	0.00
335	000999	华润三九	3,370	105,413.60	0.00
336	300012	华测检测	9,000	105,210.00	0.00
337	002353	杰瑞股份	3,000	105,000.00	0.00
338	002607	中公教育	34,300	104,958.00	0.00
339	600039	四川路桥	10,600	104,940.00	0.00
340	600176	中国巨石	9,000	102,600.00	0.00
341	300832	新产业	1,800	102,096.00	0.00
342	600885	宏发股份	4,560	101,733.60	0.00
343	600131	国网信通	5,700	100,890.00	0.00
344	600521	华海药业	5,400	100,602.00	0.00
345	601799	星宇股份	800	100,000.00	0.00
346	002739	万达电影	8,700	99,441.00	0.00
347	600066	宇通客车	4,000	99,440.00	0.00
348	002085	万丰奥威	6,200	98,518.00	0.00
349	300413	芒果超媒	4,500	98,190.00	0.00
350	300296	利亚德	16,000	97,600.00	0.00
351	601633	长城汽车	4,500	96,660.00	0.00
352	300144	宋城演艺	11,300	96,615.00	0.00
353	300037	新宙邦	2,600	91,520.00	0.00
354	000009	中国宝安	10,200	90,576.00	0.00
355	000617	中油资本	12,400	90,520.00	0.00
356	600549	厦门钨业	4,300	89,956.00	0.00
357	000623	吉林敖东	5,300	89,835.00	0.00
358	000547	航天发展	10,600	89,040.00	0.00
359	600233	圆通速递	6,900	88,941.00	0.00
360	002439	启明星辰	5,500	87,945.00	0.00
361	603129	春风动力	400	86,600.00	0.00
362	601618	中国中冶	29,000	86,420.00	0.00
363	605358	立昂微	3,700	86,210.00	0.00
364	002271	东方雨虹	8,000	85,840.00	0.00
365	603939	益丰药房	3,500	85,645.00	0.00
366	601615	明阳智能	7,400	85,026.00	0.00
367	002812	恩捷股份	2,900	84,941.00	0.00
368	002444	巨星科技	3,300	84,183.00	0.00

369	000960	锡业股份	5,500	84,150.00	0.00
370	601872	招商轮船	13,200	82,632.00	0.00
371	300001	特锐德	3,400	81,498.00	0.00
372	300118	东方日升	8,400	80,472.00	0.00
373	002389	航天彩虹	3,100	79,360.00	0.00
374	002044	美年健康	15,200	78,128.00	0.00
375	600859	王府井	5,600	77,784.00	0.00
376	600765	中航重机	4,600	77,648.00	0.00
377	600529	山东药玻	3,500	77,490.00	0.00
378	002432	九安医疗	2,100	76,503.00	0.00
379	300182	捷成股份	13,800	76,038.00	0.00
380	600143	金发科技	7,300	75,263.00	0.00
381	600153	建发股份	7,200	74,664.00	0.00
382	300676	华大基因	1,500	74,655.00	0.00
383	601216	君正集团	13,500	74,520.00	0.00
384	688303	大全能源	3,489	74,385.48	0.00
385	600763	通策医疗	1,800	74,304.00	0.00
386	002091	江苏国泰	10,200	74,154.00	0.00
387	603885	吉祥航空	5,500	74,085.00	0.00
388	603596	伯特利	1,400	73,766.00	0.00
389	300567	精测电子	1,200	72,732.00	0.00
390	002544	普天科技	3,100	72,695.00	0.00
391	600998	九州通	14,097	72,458.58	0.00
392	300919	中伟股份	2,200	72,336.00	0.00
393	000683	博源化工	15,100	72,329.00	0.00
394	600699	均胜电子	4,100	71,504.00	0.00
395	688775	影石创新	573	71,143.68	0.00
396	002245	蔚蓝锂芯	5,500	70,565.00	0.00
397	000039	中集集团	8,900	69,954.00	0.00
398	000400	许继电气	3,200	69,664.00	0.00
399	300751	迈为股份	1,000	69,560.00	0.00
400	002407	多氟多	5,700	69,483.00	0.00
401	601238	广汽集团	9,200	68,908.00	0.00
402	600704	物产中大	13,000	68,510.00	0.00
403	300068	南都电源	4,300	68,456.00	0.00
404	600398	海澜之家	9,700	67,512.00	0.00
405	603606	东方电缆	1,300	67,223.00	0.00
406	600177	雅戈尔	9,200	67,160.00	0.00
407	600332	白云山	2,500	65,900.00	0.00
408	601677	明泰铝业	5,300	65,826.00	0.00
409	600018	上港集团	11,500	65,665.00	0.00
410	002064	华峰化学	9,900	65,439.00	0.00
411	000887	中鼎股份	3,700	65,083.00	0.00

412	600486	扬农化工	1,100	63,800.00	0.00
413	600258	首旅酒店	4,500	63,585.00	0.00
414	600637	东方明珠	8,487	63,397.89	0.00
415	002145	中核钛白	15,200	63,080.00	0.00
416	600026	中远海能	6,100	63,013.00	0.00
417	002497	雅化集团	5,500	62,700.00	0.00
418	300529	健帆生物	2,900	62,553.00	0.00
419	002312	川发龙蟒	5,400	61,992.00	0.00
420	600499	科达制造	6,200	60,760.00	0.00
421	000818	航锦科技	2,700	60,750.00	0.00
422	300573	兴齐眼药	1,160	60,076.40	0.00
423	600141	兴发集团	2,900	59,537.00	0.00
424	002176	江特电机	8,200	59,532.00	0.00
425	000830	鲁西化工	5,500	56,650.00	0.00
426	002603	以岭药业	4,000	56,400.00	0.00
427	601567	三星医疗	2,500	56,050.00	0.00
428	300390	天华新能	2,900	55,303.00	0.00
429	688009	中国通号	10,593	54,448.02	0.00
430	601179	中国西电	8,600	52,804.00	0.00
431	601018	宁波港	14,400	52,704.00	0.00
432	688063	派能科技	1,166	52,563.28	0.00
433	601155	新城控股	3,800	51,984.00	0.00
434	000998	隆平高科	5,200	51,220.00	0.00
435	300070	碧水源	11,300	50,850.00	0.00
436	603833	欧派家居	900	50,805.00	0.00
437	002756	永兴材料	1,600	50,800.00	0.00
438	601000	唐山港	12,200	49,532.00	0.00
439	002120	韵达股份	7,200	48,240.00	0.00
440	603260	合盛硅业	1,000	47,400.00	0.00
441	300418	昆仑万维	1,400	47,082.00	0.00
442	300438	鹏辉能源	1,700	46,937.00	0.00
443	601880	辽港股份	30,100	45,150.00	0.00
444	603077	和邦生物	25,100	43,925.00	0.00
445	603816	顾家家居	1,700	43,384.00	0.00
446	002292	奥飞娱乐	4,400	42,768.00	0.00
447	603000	人民网	2,100	42,441.00	0.00
448	601658	邮储银行	7,600	41,572.00	0.00
449	300457	赢合科技	1,800	41,400.00	0.00
450	601866	中远海发	16,300	40,261.00	0.00
451	002572	索菲亚	2,800	39,228.00	0.00
452	600895	张江高科	1,500	38,550.00	0.00
453	601966	玲珑轮胎	2,600	38,142.00	0.00
454	600166	福田汽车	14,000	37,940.00	0.00

455	600820	隧道股份	6,000	36,600.00	0.00
456	300769	德方纳米	1,100	36,322.00	0.00
457	603650	彤程新材	1,100	35,365.00	0.00
458	600754	锦江酒店	1,500	33,660.00	0.00
459	603899	晨光股份	1,100	31,889.00	0.00
460	601636	旗滨集团	6,200	31,062.00	0.00
461	603049	中策橡胶	724	31,023.40	0.00
462	001914	招商积余	2,100	25,977.00	0.00
463	600667	太极实业	3,900	25,662.00	0.00
464	600515	海南机场	6,900	24,426.00	0.00
465	600170	上海建工	10,200	24,378.00	0.00
466	000069	华侨城 A	10,800	24,300.00	0.00
467	002372	伟星新材	2,300	23,828.00	0.00
468	600129	太极集团	1,100	23,441.00	0.00
469	301275	汉朔科技	397	22,307.43	0.00
470	301501	恒鑫生活	349	15,781.78	0.00
471	001388	信通电子	937	15,385.54	0.00
472	603202	天有为	166	15,049.56	0.00
473	600335	国机汽车	2,200	14,190.00	0.00
474	301479	弘景光电	182	14,172.34	0.00
475	301535	浙江华远	734	13,938.66	0.00
476	688757	胜科纳米	536	13,903.84	0.00
477	600007	中国国贸	600	12,348.00	0.00
478	301662	宏工科技	143	11,797.50	0.00
479	600325	华发股份	2,400	11,688.00	0.00
480	301658	首航新能	437	10,042.26	0.00
481	600803	新奥股份	500	9,450.00	0.00
482	301665	泰禾股份	393	8,799.27	0.00
483	688755	汉邦科技	203	7,983.99	0.00
484	001382	新亚电缆	366	7,396.86	0.00
485	603014	威高血净	205	6,699.40	0.00
486	301636	泽润新能	128	6,074.88	0.00
487	301595	太力科技	196	5,703.60	0.00
488	301560	众捷汽车	190	5,215.50	0.00
489	603210	泰鸿万立	286	4,464.46	0.00
490	603271	永杰新材	126	4,420.08	0.00
491	603124	江南新材	88	4,075.28	0.00
492	603409	汇通控股	100	3,332.00	0.00
493	001390	古麒绒材	178	3,225.36	0.00
494	603257	中国瑞林	78	2,922.66	0.00
495	603400	华之杰	57	2,497.17	0.00
496	603382	海阳科技	105	2,350.95	0.00
497	001335	信凯科技	80	2,244.00	0.00

498	603120	肯特催化	65	2,172.95	0.00
499	600256	广汇能源	100	602.00	0.00

7.5 报告期内股票投资组合的重大变动

7.5.1 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	600519	贵州茅台	3,490,045.00	0.08
2	601318	中国平安	2,053,316.00	0.05
3	300750	宁德时代	2,047,545.00	0.05
4	600900	长江电力	1,396,637.00	0.03
5	601899	紫金矿业	1,168,401.00	0.03
6	600036	招商银行	1,126,195.00	0.03
7	603659	璞泰来	1,056,833.00	0.02
8	300014	亿纬锂能	1,051,347.00	0.02
9	600887	伊利股份	1,032,881.00	0.02
10	688981	中芯国际	937,591.47	0.02
11	688041	海光信息	870,777.57	0.02
12	600276	恒瑞医药	811,378.00	0.02
13	601088	中国神华	783,912.00	0.02
14	603288	海天味业	773,360.92	0.02
15	600030	中信证券	752,435.00	0.02
16	002475	立讯精密	752,281.00	0.02
17	688777	中控技术	747,739.76	0.02
18	300124	汇川技术	714,634.40	0.02
19	603486	科沃斯	712,174.00	0.02
20	688169	石头科技	708,850.71	0.02

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。

7.5.2 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	600519	贵州茅台	2,320,247.00	0.05
2	300750	宁德时代	1,605,113.00	0.04
3	600036	招商银行	1,555,340.42	0.04
4	601318	中国平安	1,394,704.00	0.03
5	600900	长江电力	1,096,947.00	0.03
6	601166	兴业银行	1,026,748.00	0.02
7	688775	影石创新	900,022.65	0.02
8	000333	美的集团	897,713.00	0.02
9	601398	工商银行	819,440.00	0.02
10	002594	比亚迪	793,894.00	0.02

11	601899	紫金矿业	728,198.00	0.02
12	600887	伊利股份	663,342.00	0.02
13	300059	东方财富	657,204.00	0.02
14	601328	交通银行	650,059.00	0.01
15	601288	农业银行	638,073.00	0.01
16	600030	中信证券	623,852.00	0.01
17	000858	五粮液	606,858.00	0.01
18	600919	江苏银行	586,873.00	0.01
19	000568	泸州老窖	584,637.00	0.01
20	600276	恒瑞医药	569,656.00	0.01

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。

7.5.3 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	94,393,558.02
卖出股票收入（成交）总额	68,183,110.24

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。

7.6 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	53,233,592.06	1.16
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）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	53,233,592.06	1.16

7.7 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	019766	25 国债 01	530,000	53,233,592.06	1.16
2	-	-	-	-	-

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

7.8 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。

7.9 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。

7.10 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。

7.11 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。

7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.12.1 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。

7.12.2 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。

7.13 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。本基金为指数型联接基金，主要采取复制策略，招商银行系目标 ETF 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规定的备选股票库。

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	412,911.60
2	应收清算款	18,518,400.46
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	2,698,716.93
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	21,630,028.99

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

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
华夏中证 A500ETF 联接 A	33,679	48,209.69	434,658,626.74	26.77%	1,188,995,363.63	73.23%
华夏中证 A500ETF 联接 C	34,751	85,894.49	604,116,701.29	20.24%	2,380,802,631.11	79.76%
华夏中证 A500ETF 联接 Y	10,674	8,756.02	-	-	93,461,709.71	100.00%
合计	79,104	59,441.18	1,038,775,328.03	22.09%	3,663,259,704.45	77.91%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	华夏中证 A500ETF 联接 A	3,206,078.64	0.20%
	华夏中证 A500ETF 联接 C	459,204.66	0.02%
	华夏中证 A500ETF 联接 Y	258,167.01	0.28%
	合计	3,923,450.31	0.08%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部	华夏中证 A500ETF 联接 A	10~50
	华夏中证 A500ETF 联接 C	0
	华夏中证 A500ETF 联接 Y	0~10

门负责人持有本开放式基金	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	华夏中证 A500ETF 联接 A	0
	华夏中证 A500ETF 联接 C	10~50
	华夏中证 A500ETF 联接 Y	0
	合计	10~50

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华夏中证 A500ETF 联接 A	华夏中证 A500ETF 联接 C	华夏中证 A500ETF 联接 Y
基金合同生效日（2024 年 11 月 18 日）基金份额总额	993,388,046.27	2,066,372,202.48	-
本报告期期初基金份额总额	1,670,945,876.70	2,831,276,845.48	38,255,483.81
本报告期基金总申购份额	455,326,556.72	1,473,932,013.45	63,907,322.38
减：本报告期基金总赎回份额	502,618,443.05	1,320,289,526.53	8,701,096.48
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,623,653,990.37	2,984,919,332.40	93,461,709.71

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，基金托管人无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期未发生影响基金管理人经营或基金运营业务的诉讼。

本报告期内，无涉及基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金所聘用的会计师事务所未发生改变。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人及其高级管理人员在本报告期内无受稽查或处罚等情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中泰证券	1	94,975,952.27	59.02%	18,605.02	59.02%	-
中信证券	2	65,950,614.65	40.98%	12,920.30	40.98%	-

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，本基金还选择了长江证券、华泰证券、华西证券、中金公司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，华泰证券的交易单元为本基金本期新增的交易单元。本期没有剔除的券商交易单元。

10.7.2 基金租用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
中泰证券	92,687,164.00	99.99%	-	-	-	-	710,655,116.31	49.83%
中信证券	9,349.50	0.01%	-	-	-	-	715,644,489.73	50.17%

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办公地址变更的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025-03-07
2	华夏基金管理有限公司关于广州分公司营业场所变更的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025-03-12
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	2025-05-10

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

1、中国证监会准予基金注册的文件；

2、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

二〇二五年八月三十日