华夏上证综合全收益指数增强型
证券投资基金
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：交通银行股份有限公司

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。

基金托管人交通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 3 月 4 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 7
§5 托管人报告 11
§6 中期报告财务会计报告（未经审计） 11
6.1 资产负债表 11
6.2 利润表 13
6.3 净资产变动表 14
6.4 报表附注 14
§7 投资组合报告 36
7.1 期末基金资产组合情况 37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 37
7.3 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 38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 51
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 52
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 52
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 52
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 52
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 52
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 52
7.13 投资组合报告附注 52
§8 基金份额持有人信息 53
§9 开放式基金份额变动 54
§10 重大事件揭示 55
§11 影响投资者决策的其他重要信息 57
§12 备查文件目录 57

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华夏上证综合全收益指数增强型证券投资基金	
基金简称	华夏上证综合全收益指数增强	
基金主代码	022857	
交易代码	022857	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2025 年 3 月 4 日	
基金管理人	华夏基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	74,044,730.59 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华夏上证综合全收益指数增强 A	华夏上证综合全收益指数增强 C
下属分级基金的交易代码	022857	022858
报告期末下属分级基金的份额总额	41,447,912.18 份	32,596,818.41 份

2.2 基金产品说明

投资目标	通过量化方法进行积极的投资组合管理与风险控制，力争在控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 7.75%的基础上，追求获得超越标的指数的回报。
投资策略	主要投资策略包括股票投资策略，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，融资、 转融通证券出借业务投资策略等。
业绩比较基准	上证综合全收益指数收益率×95%＋银行活期存款利率（税后）×5%。
风险收益特征	本基金为股票指数增强型基金，其预期风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金还将通过港股通渠道投资于香港证券市场，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还将面临汇率风险、香港市场风险等特殊投资风险。

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	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李彬	方圆
	联系电话	400-818-6666	95559
	电子邮箱	service@ChinaAMC.com	fangy_20@bankcomm.com
客户服务电话		400-818-6666	95559
传真		010-63136700	021-62701216
注册地址		北京市顺义区安庆大街甲3号院	中国（上海）自由贸易试验区银城中路188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	中国（上海）长宁区仙霞路18号
邮政编码	100101	200336
法定代表人	张佑君	任德奇

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金中期报告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 3 月 4 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日）	
	华夏上证综合全收益指数增强 A	华夏上证综合全收益指数增强 C
本期已实现收益	5,885,575.02	3,261,315.45
本期利润	8,003,361.99	4,702,596.79
加权平均基金份额本期利润	0.0720	0.0511
本期加权平均净值利润率	7.08%	5.04%
本期基金份额净值增长率	10.86%	10.76%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)	
	华夏上证综合全收益指数增强 A	华夏上证综合全收益指数增强 C
期末可供分配利润	4,057,109.84	3,156,474.80
期末可供分配基金份额利润	0.0979	0.0968
期末基金资产净值	45,951,048.75	36,103,892.22
期末基金份额净值	1.1086	1.1076
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)	
	华夏上证综合全收益指数增强 A	华夏上证综合全收益指数增强 C
基金份额累计净值增长率	10.86%	10.76%

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本基金合同于 2025 年 3 月 4 日生效。

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

华夏上证综合全收益指数增强 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	4.15%	0.57%	3.45%	0.52%	0.70%	0.05%
过去三个月	11.23%	0.56%	4.04%	1.06%	7.19%	-0.50%
自基金合同生效起至今	10.86%	0.49%	4.60%	0.96%	6.26%	-0.47%

华夏上证综合全收益指数增强 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	4.13%	0.57%	3.45%	0.52%	0.68%	0.05%
过去三个月	11.15%	0.56%	4.04%	1.06%	7.11%	-0.50%
自基金合同生效起至今	10.76%	0.49%	4.60%	0.96%	6.16%	-0.47%

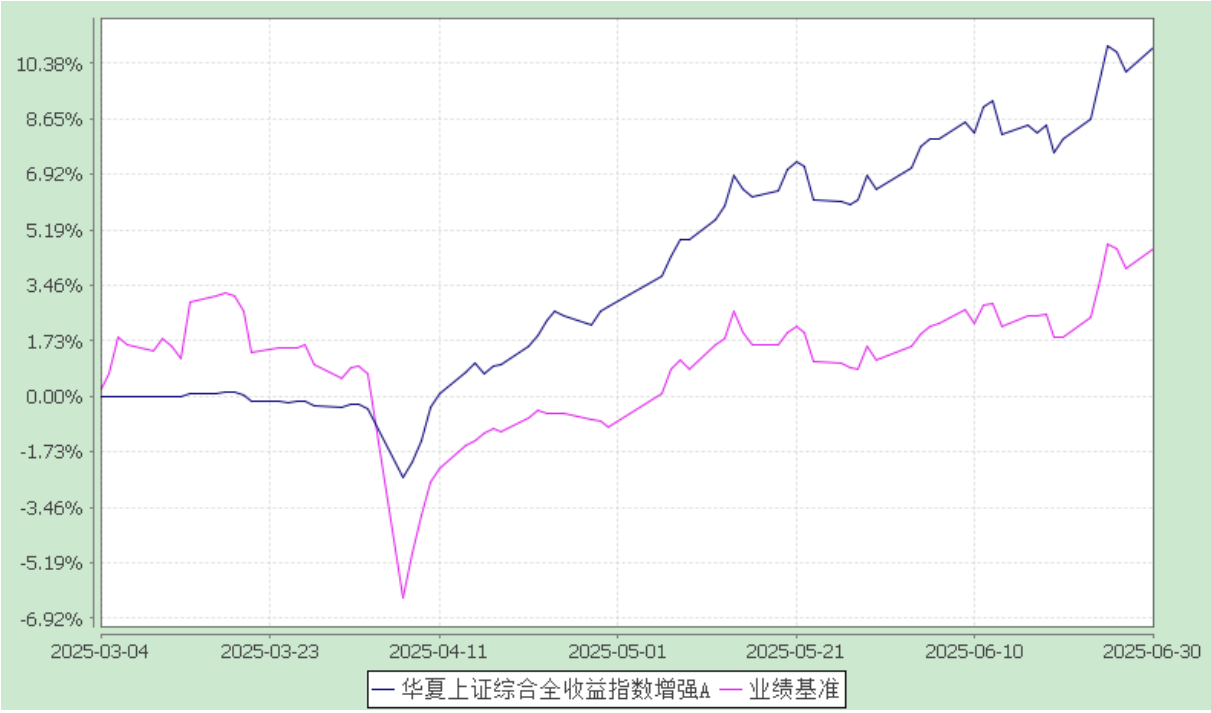
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华夏上证综合全收益指数增强型证券投资基金

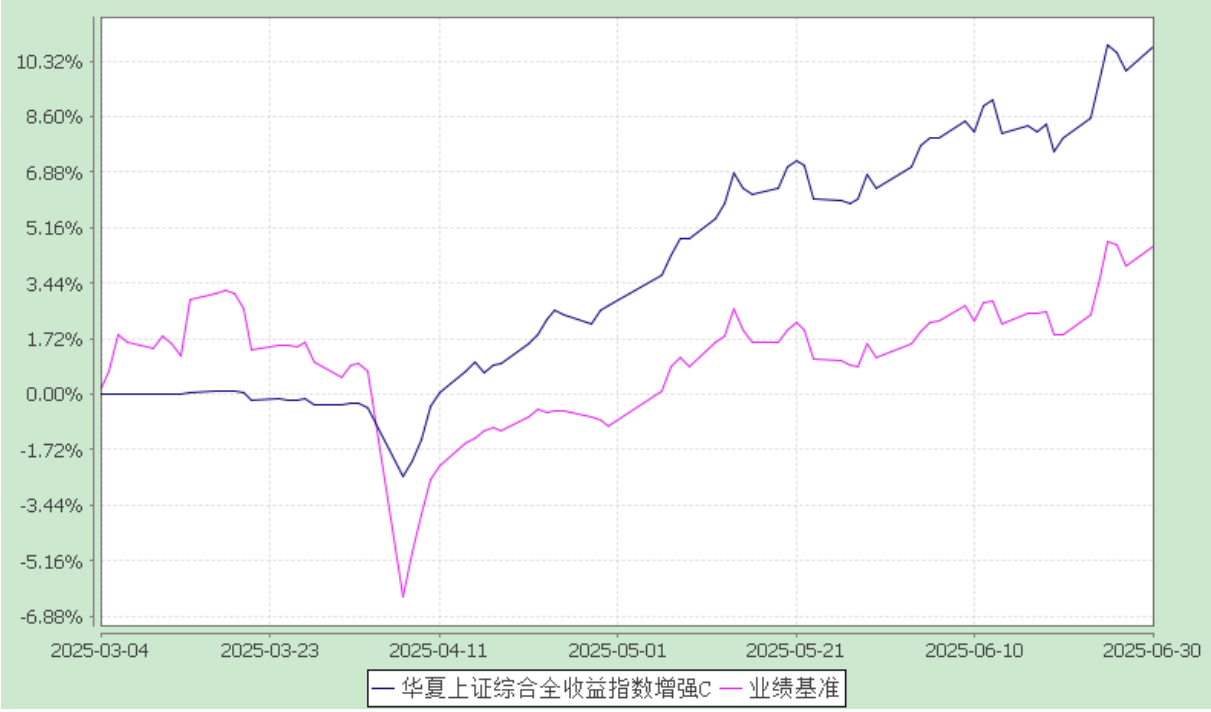
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2025 年 3 月 4 日至 2025 年 6 月 30 日)

华夏上证综合全收益指数增强 A



华夏上证综合全收益指数增强 C



注：①本基金合同于 2025 年 3 月 4 日生效。

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

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

华夏基金管理有限公司成立于 1998 年 4 月 9 日，是经中国证监会批准成立的首批全国性基金管理公司之一。公司总部设在北京，在北京、上海、深圳、成都、南京、杭州、广州、青岛、武汉及沈阳设有分公司，在香港、深圳、上海、北京设有子公司。公司是首批全国社保基金管理人、首批企业年金基金管理人、境内首批 QDII 基金管理人、境内首只 ETF 基金管理人、境内首只沪港通 ETF 基金管理人、首批内地与香港基金互认基金管理人、首批基本养老保险基金投资管理人资格、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		
孙然晔	本基金的基金经理	2025-03-04	-	11 年	博士。曾任美国银行企业投资部资深量化研究员，美国 AQR 资本管理公司量化研究员。2019 年 8 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、华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金基金经理（2022 年 7 月 4 日至 2024 年 8 月 7 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上证综合全收益指数，业绩比较基准为：上证综合全收益指数收益率×95%＋银行活期存款利率(税后)×5%。本基金作为增强型指数基金，一方面采用指数化被动投资以追求有效跟踪标的指数，另一方面采用量化模型调整投资组合力求超越标的指数表现。

上半年，A 股市场波动较大，在经历了贸易战冲击回调后企稳上行，结构性行情明显。行业间分化较大：综合金融、有色金属、银行等行业表现较好，而煤炭、房地产、食品饮料等行业表现较差。基金持仓继续保持均衡，期间量化策略整体表现稳定。

基金投资运作方面，本基金以多因子量化投资策略为主，在依据量化模型进行股票投资决策之外，还积极参与了科创板、创业板新股申购，以获取收益增厚的机会。同时，本基金秉承尽职尽责的态度，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，华夏上证综合全收益指数增强 A 基金份额净值为 1.1086 元，本报告期份额净值增长率为 10.86%；华夏上证综合全收益指数增强 C 基金份额净值为 1.1076 元，本报告期份额净值增长率为 10.76%，同期业绩比较基准增长率为 4.60%。本基金本报告期 A 类份额跟踪偏离度为+6.26%，C 类份额跟踪偏离度为+6.16%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，考虑到供给侧改革的逐渐落地以及政府对科技创新、绿色经济等新质生产力方面的政策支持因素，预计中国经济复苏有望加强。市场预计以震荡为主，行业或者风格板块可能持续保持轮动特征，建议均衡配置。

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，基金托管人在华夏上证综合全收益指数增强型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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，华夏基金管理有限公司在华夏上证综合全收益指数增强型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

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

本报告期内，由华夏基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关华夏上证综合全收益指数增强型证券投资基金的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§6 中期报告财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华夏上证综合全收益指数增强型证券投资基金

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
资产：		
货币资金	6.4.7.1	5,315,405.08
结算备付金		4,416,191.63
存出保证金		378,206.95

交易性金融资产	6.4.7.2	72,833,172.16
其中：股票投资		72,829,171.81
基金投资		-
债券投资		4,000.35
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		70,300.88
应收股利		-
应收申购款		2,556,458.85
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.5	-
资产总计		85,569,735.55
负债和净资产	**附注号**	**本期末 2025 年 6 月 30 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		98,935.26
应付赎回款		3,150,495.58
应付管理人报酬		48,586.30
应付托管费		6,940.91
应付销售服务费		8,901.38
应付投资顾问费		-
应交税费		730.10
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.6	200,205.05
负债合计		3,514,794.58
净资产：		
实收基金	6.4.7.7	74,044,730.59
未分配利润	6.4.7.8	8,010,210.38
净资产合计		82,054,940.97
负债和净资产总计		85,569,735.55

注：①报告截止日 2025 年 6 月 30 日，华夏上证综合全收益指数增强 A 基金份额净值 1.1086 元，华夏上证综合全收益指数增强 C 基金份额净值 1.1076 元；华夏上证综合全收益指数增强基金份额总额 74,044,730.59 份（其中 A 类 41,447,912.18 份，C 类 32,596,818.41 份）。

②本基金合同于 2025 年 3 月 4 日生效，本报告期自 2025 年 3 月 4 日至 2025 年 6 月 30 日。

6.2 利润表

会计主体：华夏上证综合全收益指数增强型证券投资基金

本报告期：2025 年 3 月 4 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025 年 3 月 4 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		13,368,693.44
1.利息收入		387,732.49
其中：存款利息收入	6.4.7.9	387,732.49
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）		9,416,679.85
其中：股票投资收益	6.4.7.10	8,238,234.20
基金投资收益	6.4.7.11	-
债券投资收益	6.4.7.12	17,756.17
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	442,221.22
股利收益	6.4.7.16	718,468.26
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	3,559,068.31
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	5,212.79
减：二、营业总支出		662,734.66
1.管理人报酬		455,408.64
2.托管费		65,058.39
3.销售服务费		87,746.54
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		1,597.91
8.其他费用	6.4.7.21	52,923.18
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		12,705,958.78
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填		12,705,958.78

列）		
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		12,705,958.78

注：本基金合同于 2025 年 3 月 4 日生效，本报告期自 2025 年 3 月 4 日至 2025 年 6 月 30 日。

6.3 净资产变动表

会计主体：华夏上证综合全收益指数增强型证券投资基金

本报告期：2025 年 3 月 4 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	**本期** **2025 年 3 月 4 日（基金合同生效日）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	-	-	-
二、本期期初净资产	363,135,262.79	-	363,135,262.79
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-289,090,532.20	8,010,210.38	-281,080,321.82
（一）、综合收益总额	-	12,705,958.78	12,705,958.78
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-289,090,532.20	-4,695,748.40	-293,786,280.60
其中：1.基金申购款	48,035,834.86	3,320,599.02	51,356,433.88
2.基金赎回款	-337,126,367.06	-8,016,347.42	-345,142,714.48
（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	74,044,730.59	8,010,210.38	82,054,940.97

注：本基金合同于 2025 年 3 月 4 日生效，本报告期自 2025 年 3 月 4 日至 2025 年 6 月 30 日。

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

华夏上证综合全收益指数增强型证券投资基金（以下简称“本基金”）已获中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可〔2024〕1716 号文《关于准予华夏上证综合全收益指数增强型证券投资基金注册的批复》，由华夏基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《华夏上证综合全收益指数增强型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。本基金为契约型开放式，存续期限为不定期。本基金自 2025 年 2 月 10 日至 2025 年 2 月 28 日共募集

363,039,589.00 元（不含认购资金利息），业经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）安永华明（2025）验字第 70035283_A07 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华夏上证综合全收益指数增强型证券投资基金基金合同》于 2025 年 3 月 4 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 363,135,262.79 份基金份额，其中认购资金利息折合 95,673.79 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，基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和本基金基金合同的有关规定，本基金的标的指数为上证综合全收益指数。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（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）、港股通标的股票、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、转融通证券出借业务。

本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产的 80%，港股通标的股票的投资比例为股票资产的 0%-50%，投资于标的指数成份股及其备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%；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，现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%，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 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本会计报表的实际编制期间为 2025 年 3 月 4 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

1、金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

（1）债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益。基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资、资产支持证券投资和基金投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

（2）权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

2、金融负债的分类

本基金的金融负债于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变

动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

3、衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，其公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益。

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益。

本基金对以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础，进行减值处理并确认损失准备。本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况。当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产。当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

1、存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

2、当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

3、如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。对于曾经实施份额拆分或折算的基金，由于基金份额拆分或折算引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日或基金份额折算日根据拆分前或折算前的基金份额数及确定的拆分或折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。对于已开放转换业务的基金，上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/（累计亏损）。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

境内基金投资在持有期间应取得的现金红利于除息日确认为投资收益；境外基金投资在持有期间应取得的基金分红收益扣除基金交易所在地适用的预缴所得税后的净额确认投资收益。境内股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益；境外股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除股票交易所在地适用的预缴所得税后的净额确认为投资收益。境内债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。境外债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在交易所在地适用的预缴所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；处置时其公允价值与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的按直线法近似计算。

6.4.4.10 费用的确认和计量

针对基金合同约定费率和计算方法的费用，本基金在费用涵盖期间按合同约定进行确认。

其他以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的按直线法近似计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

同一类别内的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红权益再投资日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。期末可供分配利润指期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

由于本基金各基金份额类别在费用收取上不同，其对应的可分配收益可能有所不同。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

6.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，与所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

6.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：（1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；（2）本基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；（3）本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个经营分部运作。

6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

1、对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况参考《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》对重大影响基金资产净值的特殊事项停牌股票进行估值。

2、对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6 号《关于发布<

证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》进行估值。

3、对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566 号《关于发布<关于固定收益品种的估值处理标准>的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场交易的固定收益品种，按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

4、本基金作为境外投资者在各个国家和地区证券市场的投资所得的相关税负是基于其现行的税法法规。各个国家和地区的税收规定可能发生变化，或者实施具有追溯力的修订，从而导致本基金在正常的经营活动中，部分交易和事项的最终税务处理存在不确定性。在计提和处理税收费用时，本基金需要作出相关会计估计。

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	5,315,405.08
等于：本金	5,314,106.79
加：应计利息	1,298.29
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	5,315,405.08

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		69,343,423.50	-	72,829,171.81	3,485,748.31
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	4,000.00	0.35	4,000.35	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	4,000.00	0.35	4,000.35	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		69,347,423.50	0.35	72,833,172.16	3,485,748.31

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

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2025 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	2,349,640.00	-	-	-
其中：股指期货	2,349,640.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	2,349,640.00	-	-	-

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
IM2507	中证 1000 期货 IM2507 合约	1	1,257,880.00	48,640.00
IC2508	中证 500 期货 IC2508 合约	1	1,165,080.00	24,680.00
合计	-	-	-	73,320.00
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	73,320.00
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 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	148,010.46
其中：交易所市场	148,010.46
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	52,194.59
合计	200,205.05

6.4.7.7 实收基金

华夏上证综合全收益指数增强 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2025年3月4日（基金合同生效日）至2025年6月30日	
	基金份额	账面金额
基金合同生效日	185,709,222.62	185,709,222.62
本期申购	8,165,315.75	8,165,315.75
本期赎回（以“-”号填列）	-152,426,626.19	-152,426,626.19
本期末	41,447,912.18	41,447,912.18

华夏上证综合全收益指数增强 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2025年3月4日（基金合同生效日）至2025年6月30日	
	基金份额	账面金额
基金合同生效日	177,426,040.17	177,426,040.17
本期申购	39,870,519.11	39,870,519.11
本期赎回（以“-”号填列）	-184,699,740.87	-184,699,740.87
本期末	32,596,818.41	32,596,818.41

注：本基金在募集期间共募集有效净认购资金 363,039,589.00 元，根据本基金招募说明书的规定，认购资金在募集期间产生的利息 95,673.79 元在本基金合同生效后折算为 95,673.79 份基金份额，计入基金份额持有者账户。

6.4.7.8 未分配利润

华夏上证综合全收益指数增强 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
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	5,885,575.02	2,117,786.97	8,003,361.99
本期基金份额交易产生的变动数	-1,828,465.18	-1,671,760.24	-3,500,225.42
其中：基金申购款	514,627.95	53,288.78	567,916.73
基金赎回款	-2,343,093.13	-1,725,049.02	-4,068,142.15

本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,057,109.84	446,026.73	4,503,136.57

华夏上证综合全收益指数增强 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
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	3,261,315.45	1,441,281.34	4,702,596.79
本期基金份额交易产生的变动数	-104,840.65	-1,090,682.33	-1,195,522.98
其中：基金申购款	2,428,039.24	324,643.05	2,752,682.29
基金赎回款	-2,532,879.89	-1,415,325.38	-3,948,205.27
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,156,474.80	350,599.01	3,507,073.81

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 3 月 4 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	107,846.23
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	279,766.51
其他	119.75
合计	387,732.49

6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 3 月 4 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	398,205,260.69
减：卖出股票成本总额	389,544,885.08
减：交易费用	422,141.41
买卖股票差价收入	8,238,234.20

6.4.7.11 基金投资收益

无。

6.4.7.12 债券投资收益

6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025年3月4日（基金合同生效日）至2025年6月30日
债券投资收益——利息收入	4.04
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	17,752.13
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	17,756.17

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3月4日（基金合同生效日）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	75,758.85
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	58,000.00
减：应计利息总额	3.69
减：交易费用	3.03
买卖债券差价收入	17,752.13

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3月4日（基金合同生效日）至2025年6月30日
股指期货投资收益	442,221.22

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025年3月4日（基金合同生效日）至2025年6月30日

股票投资产生的股利收益	718,468.26
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	718,468.26

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3月4日（基金合同生效日）至2025年6月30日
1.交易性金融资产	3,485,748.31
——股票投资	3,485,748.31
——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	73,320.00
——权证投资	-
——期货投资	73,320.00
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	3,559,068.31

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年3月4日（基金合同生效日）至2025年6月30日
基金赎回费收入	5,212.79
合计	5,212.79

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3月4日（基金合同生效日）至2025年6月30日
审计费用	12,921.02
信息披露费	39,273.57

证券出借违约金	-
银行费用	280.00
存托服务费	48.59
其他	400.00
合计	52,923.18

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
交通银行股份有限公司（“交通银行”）	基金托管人
中信证券股份有限公司（“中信证券”）	基金管理人的股东
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

无。

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 债券交易

无。

6.4.10.1.4 债券回购交易

无。

6.4.10.1.5 基金交易

无。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025年3月4日（基金合同生效日）至2025年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	455,408.64
其中：应支付销售机构的客户维护费	218,658.01
应支付基金管理人的净管理费	236,750.63

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 0.70%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 2025年3月4日（基金合同生效日）至2025年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	65,058.39

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 0.10%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

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2025年3月4日（基金合同生效日）至2025年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华夏上证综合全收益指数增强 A	华夏上证综合全收益指数增强 C	合计
交通银行	-	77,978.49	77,978.49
华夏基金管理有限公司	-	788.68	788.68
中信证券	-	0.42	0.42
合计	-	78,767.59	78,767.59

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

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

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3月4日（基金合同生效日）至2025年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
交通银行活期存款	5,315,405.08	107,846.23

注：本基金的活期银行存款由基金托管人交通银行保管，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 3 月 4 日（基金合同生效日）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	688755	汉邦科技	新股发行	2,023	46,063.71
中信证券	688775	影石创新	新股发行	836	39,517.72

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

本基金本报告期通过中信期货买卖期货成交额为 29,558,920.00 元，支付给中信期货的佣金为 681.92 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（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	84	3,970.68	10,429.44	-
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	-
603014	威高血净	2025-05-12	6个月	新发流通受限	26.50	32.68	87	2,305.50	2,843.16	-
603400	华之杰	2025-06-12	6个月	新发流通受限	19.88	43.81	42	834.96	1,840.02	-
603382	海阳科技	2025-06-05	6个月	新发流通受限	11.50	22.39	76	874.00	1,701.64	-

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(张)	期末成本总额	期末估值总额	备注

118056	路维转债	2025-06-11	1 个月内（含）	新发流通受限	100.00	100.01	40	4,000.00	4,000.35	期末估值单价为含息价格

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

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

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

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

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

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，本基金主要投资于基金合同约定的具有良好流动性的金融工具。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开放期内投资者历史申赎、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及比例，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。

本基金为指数增强型基金，以上证综合全收益指数为标的指数，基金股票投资方面将主要采用指数增强量化投资策略。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。

本基金为指数增强型基金，主要采用指数增强量化投资策略，运用多因子分析模型构建投资组合，同时优化组合交易并严格控制组合风险。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	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产－股票投资	72,829,171.81	88.76
交易性金融资产—基金投资	-	-
交易性金融资产－债券投资	4,000.35	0.00
交易性金融资产－贵金属投资	-	-
衍生金融资产－权证投资	-	-
其他	-	-
合计	72,833,172.16	88.76

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

②由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除上证综合全收益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
	-5%	-3,908,699.23
	+5%	3,908,699.23

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	72,804,373.56
第二层次	4,000.35
第三层次	24,798.25
合计	72,833,172.16

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	72,829,171.81	85.11
	其中：股票	72,829,171.81	85.11
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	4,000.35	0.00
	其中：债券	4,000.35	0.00
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	9,731,596.71	11.37
8	其他各项资产	3,004,966.68	3.51
9	合计	85,569,735.55	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 指数投资期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	6,545,178.54	7.98
C	制造业	25,068,641.74	30.55
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,333,725.00	4.06
E	建筑业	968,961.00	1.18
F	批发和零售业	674,998.00	0.82
G	交通运输、仓储和邮政业	2,000,721.00	2.44
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	876,904.00	1.07
J	金融业	19,144,537.00	23.33
K	房地产业	13,536.00	0.02
L	租赁和商务服务业	55,020.00	0.07
M	科学研究和技术服务业	294,696.00	0.36
N	水利、环境和公共设施管理业	2,440.00	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	342,883.00	0.42
S	综合	5,815.00	0.01
	合计	59,328,056.28	72.30

7.2.2 积极投资期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	168,540.00	0.21
C	制造业	11,119,612.53	13.55
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	38,607.00	0.05
E	建筑业	93,156.00	0.11
F	批发和零售业	54,750.00	0.07
G	交通运输、仓储和邮政业	284,828.00	0.35
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	89,851.00	0.11
J	金融业	558,308.00	0.68
K	房地产业	10,132.00	0.01
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	345,019.00	0.42
N	水利、环境和公共设施管理业	86,688.00	0.11
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	651,624.00	0.79
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	13,501,115.53	16.45

7.3 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

7.3.1 期末指数投资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	601857	中国石油	253,600	2,168,280.00	2.64
2	601988	中国银行	356,500	2,003,530.00	2.44
3	601398	工商银行	254,600	1,932,414.00	2.36

4	601288	农业银行	285,500	1,678,740.00	2.05
5	600519	贵州茅台	1,100	1,550,472.00	1.89
6	600036	招商银行	32,800	1,507,160.00	1.84
7	601628	中国人寿	35,800	1,474,602.00	1.80
8	600000	浦发银行	101,600	1,410,208.00	1.72
9	600900	长江电力	45,100	1,359,314.00	1.66
10	601088	中国神华	33,001	1,337,860.54	1.63
11	601319	中国人保	151,600	1,320,436.00	1.61
12	601211	国泰海通	62,300	1,193,668.00	1.45
13	601318	中国平安	20,400	1,131,792.00	1.38
14	600919	江苏银行	94,000	1,122,360.00	1.37
15	601225	陕西煤业	58,300	1,121,692.00	1.37
16	601919	中远海控	54,000	812,160.00	0.99
17	688047	龙芯中科	5,400	720,306.00	0.88
18	601939	建设银行	74,900	707,056.00	0.86
19	688183	生益电子	13,800	706,560.00	0.86
20	601018	宁波港	192,900	706,014.00	0.86
21	603367	辰欣药业	48,800	684,176.00	0.83
22	605196	华通线缆	37,700	663,897.00	0.81
23	600028	中国石化	117,200	661,008.00	0.81
24	603858	步长制药	40,100	651,224.00	0.79
25	688552	航天南湖	16,200	646,542.00	0.79
26	603087	甘李药业	11,800	646,404.00	0.79
27	603213	镇洋发展	57,800	645,626.00	0.79
28	605122	四方新材	54,400	638,656.00	0.78
29	600482	中国动力	27,500	634,425.00	0.77
30	600938	中国海油	24,100	629,251.00	0.77
31	688129	东来技术	22,800	620,160.00	0.76
32	603173	福斯达	17,400	618,570.00	0.75
33	603655	朗博科技	21,700	609,119.00	0.74
34	688103	国力股份	10,000	608,400.00	0.74
35	603586	金麒麟	33,200	608,224.00	0.74
36	601601	中国太保	16,000	600,160.00	0.73
37	600789	鲁抗医药	59,300	593,593.00	0.72
38	601133	柏诚股份	45,100	573,221.00	0.70
39	605169	洪通燃气	53,000	563,390.00	0.69
40	688578	艾力斯	6,000	558,240.00	0.68
41	601998	中信银行	57,800	491,300.00	0.60
42	605028	世茂能源	24,600	477,978.00	0.58
43	600809	山西汾酒	2,600	458,614.00	0.56
44	600722	金牛化工	64,200	408,954.00	0.50
45	601519	大智慧	39,100	398,429.00	0.49
46	688041	海光信息	2,800	395,612.00	0.48

47	600595	中孚实业	86,600	379,308.00	0.46
48	603616	韩建河山	78,800	377,452.00	0.46
49	605499	东鹏饮料	1,200	376,860.00	0.46
50	600084	中信尼雅	63,500	353,060.00	0.43
51	603296	华勤技术	3,900	314,652.00	0.38
52	600104	上汽集团	19,400	311,370.00	0.38
53	601009	南京银行	26,500	307,930.00	0.38
54	600660	福耀玻璃	5,400	307,854.00	0.38
55	600183	生益科技	10,000	301,500.00	0.37
56	600926	杭州银行	17,700	297,714.00	0.36
57	603379	三美股份	5,900	283,908.00	0.35
58	688018	乐鑫科技	1,940	283,434.00	0.35
59	601991	大唐发电	88,100	279,277.00	0.34
60	600968	海油发展	68,300	278,664.00	0.34
61	688208	道通科技	9,000	275,400.00	0.34
62	601799	星宇股份	2,200	275,000.00	0.34
63	600729	重庆百货	9,200	274,436.00	0.33
64	603486	科沃斯	4,700	273,681.00	0.33
65	603103	横店影视	17,000	272,850.00	0.33
66	688351	微电生理	13,800	271,860.00	0.33
67	600578	京能电力	60,500	271,645.00	0.33
68	601579	会稽山	13,600	270,776.00	0.33
69	601665	齐鲁银行	42,700	269,864.00	0.33
70	600114	东睦股份	13,000	264,420.00	0.32
71	688789	宏华数科	3,600	262,944.00	0.32
72	601963	重庆银行	24,200	262,812.00	0.32
73	603337	杰克股份	7,100	254,748.00	0.31
74	689009	九号公司	4,300	254,431.00	0.31
75	603259	药明康德	3,400	236,470.00	0.29
76	688235	百济神州	1,000	233,640.00	0.28
77	688270	臻镭科技	4,800	223,488.00	0.27
78	603920	世运电路	7,100	216,621.00	0.26
79	603236	移远通信	2,500	214,500.00	0.26
80	688008	澜起科技	2,600	213,200.00	0.26
81	600276	恒瑞医药	4,100	212,790.00	0.26
82	688608	恒玄科技	600	208,788.00	0.25
83	601668	中国建筑	35,800	206,566.00	0.25
84	603039	泛微网络	3,700	206,090.00	0.25
85	688278	特宝生物	2,800	201,908.00	0.25
86	688117	圣诺生物	5,800	195,170.00	0.24
87	688261	东微半导	4,600	189,750.00	0.23
88	603019	中科曙光	2,600	183,040.00	0.22
89	601838	成都银行	9,100	182,910.00	0.22

90	600887	伊利股份	6,500	181,220.00	0.22
91	605599	菜百股份	10,000	163,500.00	0.20
92	600160	巨化股份	5,700	163,476.00	0.20
93	600585	海螺水泥	7,400	158,878.00	0.19
94	601117	中国化学	20,200	154,934.00	0.19
95	601899	紫金矿业	7,900	154,050.00	0.19
96	600909	华安证券	25,200	146,916.00	0.18
97	605288	凯迪股份	2,800	145,908.00	0.18
98	605589	圣泉集团	5,100	141,525.00	0.17
99	688300	联瑞新材	3,000	139,650.00	0.17
100	600548	深高速	13,100	137,157.00	0.17
101	601515	东峰集团	33,200	126,824.00	0.15
102	600236	桂冠电力	19,800	124,146.00	0.15
103	601058	赛轮轮胎	9,200	120,704.00	0.15
104	600882	妙可蓝多	3,900	119,067.00	0.15
105	600025	华能水电	11,700	111,735.00	0.14
106	600018	上港集团	19,500	111,345.00	0.14
107	688279	峰岹科技	600	111,300.00	0.14
108	688266	泽璟制药	1,000	107,510.00	0.13
109	601728	中国电信	13,600	105,400.00	0.13
110	605376	博迁新材	2,500	95,825.00	0.12
111	601658	邮储银行	15,900	86,973.00	0.11
112	688128	中国电研	3,400	83,300.00	0.10
113	603726	朗迪集团	4,700	76,093.00	0.09
114	603116	红蜻蜓	12,900	75,852.00	0.09
115	688055	龙腾光电	20,424	75,568.80	0.09
116	600517	国网英大	14,700	74,970.00	0.09
117	600082	海泰发展	19,000	74,670.00	0.09
118	600318	新力金融	7,300	72,124.00	0.09
119	600830	香溢融通	7,100	71,852.00	0.09
120	601898	中煤能源	6,400	70,016.00	0.09
121	600109	国金证券	7,400	64,898.00	0.08
122	600050	中国联通	12,100	64,614.00	0.08
123	601015	陕西黑猫	18,200	59,696.00	0.07
124	601169	北京银行	8,600	58,738.00	0.07
125	600350	山东高速	5,400	57,564.00	0.07
126	601111	中国国航	7,100	56,019.00	0.07
127	600795	国电电力	11,000	53,240.00	0.06
128	688538	和辉光电	22,356	52,313.04	0.06
129	688469	芯联集成	10,855	51,778.35	0.06
130	688522	纳睿雷达	1,000	51,220.00	0.06
131	600343	航天动力	4,100	50,799.00	0.06
132	603766	隆鑫通用	3,900	49,764.00	0.06

133	601881	中国银河	2,900	49,735.00	0.06
134	600120	浙江东方	8,200	49,610.00	0.06
135	600438	通威股份	2,900	48,575.00	0.06
136	605566	福莱蒽特	2,300	47,955.00	0.06
137	600053	九鼎投资	3,100	47,678.00	0.06
138	603260	合盛硅业	1,000	47,400.00	0.06
139	603195	公牛集团	980	47,285.00	0.06
140	600703	三安光电	3,700	45,954.00	0.06
141	600721	百花医药	6,300	45,801.00	0.06
142	603970	中农立华	3,300	45,705.00	0.06
143	600668	尖峰集团	3,200	45,280.00	0.06
144	603159	上海亚虹	2,700	45,171.00	0.06
145	603237	五芳斋	2,700	45,117.00	0.05
146	600372	中航机载	3,700	44,622.00	0.05
147	605198	安德利	1,100	44,341.00	0.05
148	600131	国网信通	2,500	44,250.00	0.05
149	600188	兖矿能源	3,600	43,812.00	0.05
150	600674	川投能源	2,700	43,308.00	0.05
151	688377	迪威尔	1,800	42,966.00	0.05
152	600377	宁沪高速	2,700	41,418.00	0.05
153	600759	洲际油气	17,500	41,125.00	0.05
154	601336	新华保险	700	40,950.00	0.05
155	600115	中国东航	10,100	40,703.00	0.05
156	601900	南方传媒	2,600	40,664.00	0.05
157	688004	博汇科技	2,000	39,800.00	0.05
158	600662	外服控股	7,600	38,836.00	0.05
159	601138	工业富联	1,800	38,484.00	0.05
160	600651	飞乐音响	8,400	37,800.00	0.05
161	600851	海欣股份	5,500	36,795.00	0.04
162	601456	国联民生	3,500	36,225.00	0.04
163	688629	华丰科技	600	34,320.00	0.04
164	601369	陕鼓动力	3,800	33,326.00	0.04
165	600707	彩虹股份	5,100	32,946.00	0.04
166	688670	金迪克	2,200	30,690.00	0.04
167	600713	南京医药	6,000	30,360.00	0.04
168	601399	国机重装	10,100	30,300.00	0.04
169	603698	航天工程	1,700	29,954.00	0.04
170	600346	恒力石化	2,100	29,946.00	0.04
171	603889	新澳股份	5,100	29,580.00	0.04
172	601801	皖新传媒	4,300	29,369.00	0.04
173	600458	时代新材	2,100	28,812.00	0.04
174	600380	健康元	2,600	28,678.00	0.03
175	601818	光大银行	6,900	28,635.00	0.03

176	601869	长飞光纤	700	28,504.00	0.03
177	600935	华塑股份	11,600	28,072.00	0.03
178	601388	怡球资源	11,100	27,972.00	0.03
179	603937	丽岛新材	2,800	27,384.00	0.03
180	605008	长鸿高科	1,700	26,775.00	0.03
181	600925	苏能股份	5,000	26,150.00	0.03
182	688217	睿昂基因	1,000	25,300.00	0.03
183	600594	益佰制药	6,500	25,025.00	0.03
184	601113	华鼎股份	6,300	24,885.00	0.03
185	600023	浙能电力	4,200	22,260.00	0.03
186	600015	华夏银行	2,800	22,148.00	0.03
187	600959	江苏有线	6,400	22,016.00	0.03
188	600815	厦工股份	7,900	21,567.00	0.03
189	603168	莎普爱思	2,900	21,431.00	0.03
190	600219	南山铝业	5,500	21,065.00	0.03
191	603043	广州酒家	1,300	20,254.00	0.02
192	603317	天味食品	1,800	20,016.00	0.02
193	603378	亚士创能	3,200	19,392.00	0.02
194	600989	宝丰能源	1,200	19,368.00	0.02
195	601766	中国中车	2,700	19,008.00	0.02
196	600337	美克家居	8,500	18,785.00	0.02
197	603599	广信股份	1,700	18,139.00	0.02
198	600685	中船防务	600	16,314.00	0.02
199	601106	中国一重	5,800	16,240.00	0.02
200	601828	美凯龙	5,600	16,184.00	0.02
201	600488	津药药业	3,700	15,429.00	0.02
202	600423	柳化股份	4,500	15,345.00	0.02
203	603949	雪龙集团	800	15,120.00	0.02
204	688335	复洁环保	1,200	14,640.00	0.02
205	601231	环旭电子	1,000	14,630.00	0.02
206	600998	九州通	2,800	14,392.00	0.02
207	603661	恒林股份	500	14,300.00	0.02
208	601800	中国交建	1,600	14,224.00	0.02
209	600741	华域汽车	800	14,120.00	0.02
210	688387	信科移动	2,483	14,028.95	0.02
211	601985	中国核电	1,500	13,980.00	0.02
212	600675	中华企业	4,700	13,536.00	0.02
213	600020	中原高速	2,800	13,384.00	0.02
214	603132	金徽股份	1,000	13,270.00	0.02
215	601965	中国汽研	700	12,425.00	0.02
216	600676	交运股份	2,600	12,298.00	0.01
217	600237	铜峰电子	1,600	11,600.00	0.01
218	600080	金花股份	1,600	11,328.00	0.01

219	601158	重庆水务	2,400	11,136.00	0.01
220	601607	上海医药	600	10,728.00	0.01
221	603118	共进股份	900	10,143.00	0.01
222	600800	渤海化学	2,400	10,104.00	0.01
223	601186	中国铁建	1,200	9,612.00	0.01
224	600667	太极实业	1,400	9,212.00	0.01
224	600653	申华控股	4,900	9,212.00	0.01
225	600031	三一重工	500	8,975.00	0.01
226	600655	豫园股份	1,500	8,325.00	0.01
227	605166	聚合顺	700	7,833.00	0.01
228	603033	三维股份	600	6,726.00	0.01
229	603730	岱美股份	1,140	6,486.60	0.01
230	600312	平高电气	400	6,156.00	0.01
231	603866	桃李面包	1,100	5,940.00	0.01
232	688310	迈得医疗	400	5,896.00	0.01
233	600673	东阳光	500	5,815.00	0.01
234	600169	太原重工	2,300	5,566.00	0.01
235	603713	密尔克卫	100	5,332.00	0.01
236	600029	南方航空	800	4,720.00	0.01
237	600664	哈药股份	900	3,312.00	0.00
238	688260	昀冢科技	200	3,296.00	0.00
239	600019	宝钢股份	500	3,295.00	0.00
240	601238	广汽集团	400	2,996.00	0.00
241	601298	青岛港	300	2,607.00	0.00
242	688057	金达莱	200	2,440.00	0.00
243	601339	百隆东方	500	2,360.00	0.00
244	600956	新天绿能	300	2,316.00	0.00
245	600285	羚锐制药	100	2,267.00	0.00
246	601567	三星医疗	100	2,242.00	0.00
247	600750	江中药业	100	2,183.00	0.00
248	688079	美迪凯	200	2,008.00	0.00
248	603803	瑞斯康达	200	2,008.00	0.00
249	600877	电科芯片	100	1,268.00	0.00
250	601618	中国中冶	400	1,192.00	0.00
251	600609	金杯汽车	200	1,058.00	0.00
252	603669	灵康药业	100	540.00	0.00
253	600724	宁波富达	100	455.00	0.00

7.3.2 期末积极投资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	301103	何氏眼科	29,300.00	650,460.00	0.79

2	301151	冠龙节能	36,800.00	642,160.00	0.78
3	002495	佳隆股份	247,400.00	638,292.00	0.78
4	301326	捷邦科技	7,800.00	621,972.00	0.76
5	301285	鸿日达	19,000.00	616,550.00	0.75
6	001238	浙江正特	15,400.00	603,680.00	0.74
7	300834	星辉环材	26,300.00	601,481.00	0.73
8	688726	拉普拉斯	13,800.00	594,780.00	0.72
9	301132	满坤科技	16,701.00	589,211.28	0.72
10	301413	安培龙	7,600.00	581,020.00	0.71
11	301356	天振股份	32,100.00	571,059.00	0.70
12	300473	德尔股份	17,400.00	566,370.00	0.69
13	300218	安利股份	25,600.00	383,488.00	0.47
14	000729	燕京啤酒	22,700.00	293,511.00	0.36
15	002461	珠江啤酒	24,800.00	279,992.00	0.34
16	300124	汇川技术	4,200.00	271,194.00	0.33
17	002597	金禾实业	11,500.00	270,825.00	0.33
18	003035	南网能源	58,900.00	270,351.00	0.33
19	002352	顺丰控股	5,300.00	258,428.00	0.31
20	301498	乖宝宠物	2,300.00	251,551.00	0.31
21	002311	海大集团	4,200.00	246,078.00	0.30
22	002142	宁波银行	8,200.00	224,352.00	0.27
23	000776	广发证券	11,500.00	193,315.00	0.24
24	002625	光启技术	3,700.00	147,926.00	0.18
25	002648	卫星化学	8,000.00	138,640.00	0.17
26	000990	诚志股份	18,100.00	136,836.00	0.17
27	002906	华阳集团	4,100.00	133,291.00	0.16
28	301004	嘉益股份	2,000.00	132,460.00	0.16
29	301608	博实结	1,400.00	124,712.00	0.15
30	002595	豪迈科技	2,100.00	124,362.00	0.15
31	002248	华东数控	13,100.00	114,625.00	0.14
32	002318	久立特材	4,800.00	112,272.00	0.14
33	002031	巨轮智能	13,800.00	112,056.00	0.14
34	000426	兴业银锡	6,300.00	99,540.00	0.12
35	300517	海波重科	8,400.00	93,156.00	0.11
36	300492	华图山鼎	1,100.00	74,668.00	0.09
37	002701	奥瑞金	12,500.00	74,375.00	0.09
38	000050	深天马 A	8,600.00	73,272.00	0.09
39	002266	浙富控股	23,600.00	72,688.00	0.09
40	000567	海德股份	12,200.00	72,224.00	0.09
41	000937	冀中能源	12,000.00	69,000.00	0.08
42	002423	中粮资本	5,500.00	67,265.00	0.08
43	002638	勤上股份	20,600.00	54,178.00	0.07
44	300765	新诺威	900.00	46,521.00	0.06

45	300549	优德精密	2,500.00	45,725.00	0.06
46	300625	三雄极光	3,800.00	45,182.00	0.06
47	300119	瑞普生物	2,300.00	44,666.00	0.05
48	300889	爱克股份	3,300.00	44,418.00	0.05
49	000623	吉林敖东	2,600.00	44,070.00	0.05
50	301418	协昌科技	1,200.00	43,848.00	0.05
51	301528	多浦乐	800.00	43,056.00	0.05
52	000553	安道麦 A	5,700.00	41,154.00	0.05
53	301160	翔楼新材	500.00	40,040.00	0.05
54	002752	昇兴股份	7,100.00	39,547.00	0.05
55	002267	陕天然气	5,100.00	38,607.00	0.05
56	000725	京东方 A	9,400.00	37,506.00	0.05
57	300935	盈建科	1,500.00	37,050.00	0.05
58	300855	图南股份	1,500.00	35,670.00	0.04
59	002821	凯莱英	400.00	35,300.00	0.04
60	002414	高德红外	3,200.00	32,800.00	0.04
61	300140	节能环境	5,200.00	32,084.00	0.04
62	000078	海王生物	13,100.00	31,702.00	0.04
63	000425	徐工机械	3,800.00	29,526.00	0.04
64	301321	翰博高新	1,900.00	29,051.00	0.04
65	001965	招商公路	2,200.00	26,400.00	0.03
66	300155	安居宝	5,100.00	25,602.00	0.03
67	301031	中熔电气	300.00	23,895.00	0.03
68	002373	千方科技	2,500.00	23,250.00	0.03
69	002419	天虹股份	4,300.00	23,048.00	0.03
70	300074	华平股份	4,300.00	20,984.00	0.03
71	000895	双汇发展	700.00	17,087.00	0.02
72	300270	中威电子	2,100.00	16,506.00	0.02
73	002662	峰璟股份	4,500.00	15,390.00	0.02
74	300774	倍杰特	1,600.00	14,000.00	0.02
75	301056	森赫股份	1,300.00	13,728.00	0.02
76	002871	伟隆股份	1,200.00	13,356.00	0.02
77	000045	深纺织 A	1,200.00	13,308.00	0.02
78	002330	得利斯	2,600.00	11,908.00	0.01
79	688775	影石创新	84.00	10,429.44	0.01
80	300389	艾比森	900.00	10,422.00	0.01
81	000631	顺发恒业	3,400.00	10,132.00	0.01
82	002755	奥赛康	600.00	9,588.00	0.01
83	300689	澄天伟业	200.00	8,914.00	0.01
84	000509	华塑控股	2,600.00	8,658.00	0.01
85	300365	恒华科技	1,300.00	8,567.00	0.01
86	002415	海康威视	300.00	8,319.00	0.01
87	300082	奥克股份	1,100.00	8,206.00	0.01

88	688755	汉邦科技	203.00	7,983.99	0.01
89	002028	思源电气	100.00	7,291.00	0.01
90	000017	深中华 A	1,100.00	7,216.00	0.01
91	002346	柘中股份	500.00	6,800.00	0.01
92	300696	爱乐达	300.00	6,774.00	0.01
93	300034	钢研高纳	400.00	6,652.00	0.01
94	301033	迈普医学	100.00	6,006.00	0.01
95	300320	海达股份	500.00	4,970.00	0.01
96	300414	中光防雷	300.00	4,644.00	0.01
97	300126	锐奇股份	600.00	4,356.00	0.01
98	002745	木林森	500.00	3,940.00	0.00
99	300772	运达股份	300.00	3,864.00	0.00
100	300633	开立医疗	100.00	2,972.00	0.00
101	603014	威高血净	87.00	2,843.16	0.00
102	301395	仁信新材	200.00	2,698.00	0.00
103	002011	盾安环境	200.00	2,320.00	0.00
104	301113	雅艺科技	100.00	2,091.00	0.00
105	603400	华之杰	42.00	1,840.02	0.00
106	002226	江南化工	300.00	1,740.00	0.00
107	603382	海阳科技	76.00	1,701.64	0.00
108	000800	一汽解放	200.00	1,372.00	0.00
109	002498	汉缆股份	400.00	1,352.00	0.00
110	002622	皓宸医疗	400.00	1,164.00	0.00
111	002736	国信证券	100.00	1,152.00	0.00
112	000727	冠捷科技	200.00	486.00	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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	9,630,131.00	11.74
2	601857	中国石油	7,267,337.00	8.86
3	601398	工商银行	6,623,232.00	8.07
4	601088	中国神华	6,064,910.35	7.39
5	600036	招商银行	5,751,400.00	7.01
6	601988	中国银行	5,342,625.00	6.51
7	601166	兴业银行	5,034,602.00	6.14
8	601628	中国人寿	4,849,787.00	5.91
9	601288	农业银行	4,559,371.00	5.56
10	601998	中信银行	4,490,353.00	5.47
11	600000	浦发银行	4,431,263.00	5.40
12	600926	杭州银行	4,422,551.00	5.39
13	601225	陕西煤业	4,221,610.00	5.14

14	600900	长江电力	4,159,292.00	5.07
15	601318	中国平安	3,898,491.00	4.75
16	600482	中国动力	3,338,470.74	4.07
17	601688	华泰证券	2,859,534.00	3.48
18	301285	鸿日达	2,686,637.00	3.27
19	601211	国泰海通	2,579,283.00	3.14
20	600015	华夏银行	2,511,610.00	3.06
21	688343	云天励飞	2,492,297.60	3.04
22	688235	百济神州	2,485,608.91	3.03
23	600809	山西汾酒	2,472,152.00	3.01
24	600028	中国石化	2,457,531.00	2.99
25	688578	艾力斯	2,446,483.43	2.98
26	689009	九号公司	2,356,531.89	2.87
27	601000	唐山港	2,324,968.00	2.83
28	600938	中国海油	2,282,691.00	2.78
29	688538	和辉光电	2,225,127.65	2.71
30	601989	中国重工	2,207,045.00	2.69
31	603577	汇金通	2,193,172.00	2.67
32	605162	新中港	2,182,287.00	2.66
33	301507	民生健康	2,149,208.00	2.62
34	002926	华西证券	2,147,207.00	2.62
35	002382	蓝帆医疗	2,145,016.11	2.61
36	601059	信达证券	2,120,765.00	2.58
37	600020	中原高速	2,116,192.00	2.58
38	688387	信科移动	2,103,878.18	2.56
39	301051	信濠光电	2,074,318.20	2.53
40	600815	厦工股份	2,046,114.00	2.49
41	301218	华是科技	2,042,676.00	2.49
42	603779	威龙股份	2,033,899.00	2.48
43	603201	常润股份	1,996,323.00	2.43
44	603788	宁波高发	1,986,022.00	2.42
45	301328	维峰电子	1,979,016.00	2.41
46	600525	ST 长园	1,971,588.00	2.40
47	688616	西力科技	1,944,356.08	2.37
48	605069	正和生态	1,933,289.80	2.36
49	301608	博实结	1,933,199.00	2.36
50	002102	能特科技	1,928,324.00	2.35
51	603193	润本股份	1,915,710.00	2.33
52	301231	荣信文化	1,910,505.00	2.33
53	603139	康惠制药	1,900,954.00	2.32
54	301132	满坤科技	1,893,067.83	2.31
55	603062	麦加芯彩	1,886,281.00	2.30
56	600784	鲁银投资	1,868,535.00	2.28

57	000651	格力电器	1,865,356.00	2.27
58	301129	瑞纳智能	1,856,332.00	2.26
59	688184	ST 帕瓦	1,850,965.07	2.26
60	605018	长华集团	1,838,524.00	2.24
61	603615	茶花股份	1,787,376.00	2.18
62	601022	宁波远洋	1,786,458.00	2.18
63	603156	养元饮品	1,773,865.00	2.16
64	605116	奥锐特	1,762,763.00	2.15
65	603291	联合水务	1,761,629.00	2.15
66	603637	镇海股份	1,755,203.00	2.14
67	301305	朗坤科技	1,746,945.00	2.13
68	600269	赣粤高速	1,741,282.00	2.12
69	688733	壹石通	1,739,346.34	2.12
70	688370	丛麟科技	1,735,453.78	2.11
71	301366	一博科技	1,730,823.00	2.11
72	301391	卡莱特	1,718,450.00	2.09
73	600846	同济科技	1,705,645.49	2.08
74	688041	海光信息	1,702,842.61	2.08
75	688506	百利天恒	1,698,355.20	2.07
76	001238	浙江正特	1,677,713.00	2.04
77	605303	园林股份	1,648,406.46	2.01

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	7,985,268.00	9.73
2	601857	中国石油	5,554,302.02	6.77
3	601166	兴业银行	5,153,414.00	6.28
4	601398	工商银行	5,054,783.00	6.16
5	601088	中国神华	4,913,990.00	5.99
6	600036	招商银行	4,409,706.00	5.37
7	600926	杭州银行	4,358,353.00	5.31
8	601998	中信银行	4,201,555.00	5.12
9	600000	浦发银行	3,682,095.00	4.49
10	601628	中国人寿	3,623,179.00	4.42
11	601988	中国银行	3,480,469.00	4.24
12	601288	农业银行	3,308,207.00	4.03
13	601225	陕西煤业	3,141,269.00	3.83
14	600900	长江电力	2,960,000.00	3.61
15	601318	中国平安	2,944,223.00	3.59
16	601688	华泰证券	2,898,299.00	3.53
17	600482	中国动力	2,701,509.00	3.29

18	688343	云天励飞	2,636,424.20	3.21
19	600015	华夏银行	2,514,363.00	3.06
20	301285	鸿日达	2,388,367.00	2.91
21	688538	和辉光电	2,348,797.08	2.86
22	301507	民生健康	2,341,674.00	2.85
23	688235	百济神州	2,338,507.08	2.85
24	301231	荣信文化	2,335,741.00	2.85
25	301328	维峰电子	2,279,884.00	2.78
26	600020	中原高速	2,263,568.00	2.76
27	605162	新中港	2,258,628.00	2.75
28	601000	唐山港	2,245,704.00	2.74
29	601989	中国重工	2,229,391.00	2.72
30	603577	汇金通	2,224,208.00	2.71
31	603201	常润股份	2,209,592.40	2.69
32	689009	九号公司	2,162,680.32	2.64
33	301129	瑞纳智能	2,137,954.00	2.61
34	002926	华西证券	2,125,185.00	2.59
35	301218	华是科技	2,117,334.00	2.58
36	603788	宁波高发	2,115,141.00	2.58
37	601059	信达证券	2,107,478.00	2.57
38	002382	蓝帆医疗	2,095,314.00	2.55
39	600525	ST 长园	2,090,609.00	2.55
40	688387	信科移动	2,088,200.98	2.54
41	301051	信濠光电	2,079,295.40	2.53
42	605069	正和生态	2,036,318.00	2.48
43	605018	长华集团	2,020,000.00	2.46
44	301608	博实结	2,015,471.00	2.46
45	688578	艾力斯	2,014,453.33	2.46
46	603779	威龙股份	1,999,623.00	2.44
47	600815	厦工股份	1,989,180.00	2.42
48	002102	能特科技	1,959,367.00	2.39
49	688616	西力科技	1,948,308.79	2.37
50	603637	镇海股份	1,924,535.00	2.35
51	603193	润本股份	1,903,225.00	2.32
52	603062	麦加芯彩	1,888,794.00	2.30
53	301366	一博科技	1,886,447.00	2.30
54	688184	ST 帕瓦	1,886,044.68	2.30
55	601022	宁波远洋	1,885,689.00	2.30
56	600809	山西汾酒	1,883,326.00	2.30
57	301305	朗坤科技	1,873,049.00	2.28
58	605116	奥锐特	1,861,420.00	2.27
59	603615	茶花股份	1,860,925.00	2.27
60	603139	康惠制药	1,858,927.00	2.27

61	000651	格力电器	1,857,114.00	2.26
62	603291	联合水务	1,832,542.00	2.23
63	600269	赣粤高速	1,821,262.00	2.22
64	603156	养元饮品	1,818,447.00	2.22
65	600784	鲁银投资	1,814,648.00	2.21
66	600028	中国石化	1,807,640.00	2.20
67	603022	新通联	1,807,289.00	2.20
68	301132	满坤科技	1,795,057.00	2.19
69	301391	卡莱特	1,779,754.00	2.17
70	600846	同济科技	1,766,077.37	2.15
71	688370	丛麟科技	1,744,006.28	2.13
72	688733	壹石通	1,738,623.98	2.12
73	600938	中国海油	1,714,320.00	2.09
74	301096	百诚医药	1,709,400.00	2.08
75	688506	百利天恒	1,693,574.53	2.06
76	300972	万辰集团	1,690,613.00	2.06
77	600621	华鑫股份	1,667,964.00	2.03

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	458,888,308.58
卖出股票收入（成交）总额	398,205,260.69

注：“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	4,000.35	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	4,000.35	0.00

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	118056	路维转债	40	4,000.35	0.00
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金为指数增强型基金，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，投资于标的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，中国银行股份有限公司、上海浦东发展银行股份有限公司、中国工商银行股份有限公司、中国农业银行股份有限公司、招商银行股份有限公司、中国人寿保险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

指数增强型基金，主要采取指数增强量化投资策略，浦发银行、中国银行、农业银行、招商银行、工商银行、中国人寿系标的指数成份股，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	378,206.95
2	应收清算款	70,300.88
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	2,556,458.85
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,004,966.68

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

7.13.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.13.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五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	占总份	持有份额	占总份额

			份额	额比例		比例
华夏上证综合全收益指数增强 A	730	56,777.96	-	-	41,447,912.18	100.00%
华夏上证综合全收益指数增强 C	2,284	14,271.81	-	-	32,596,818.41	100.00%
合计	3,014	24,566.93	-	-	74,044,730.59	100.00%

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	华夏上证综合全收益指数增强 A	-	-
	华夏上证综合全收益指数增强 C	-	-
	合计	-	-

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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	华夏上证综合全收益指数增强 A	0
	华夏上证综合全收益指数增强 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	华夏上证综合全收益指数增强 A	0
	华夏上证综合全收益指数增强 C	0
	合计	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华夏上证综合全收益指数增强 A	华夏上证综合全收益指数增强 C
基金合同生效日（2025 年 3 月 4 日）基金份额总额	185,709,222.62	177,426,040.17
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	8,165,315.75	39,870,519.11
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	152,426,626.19	184,699,740.87
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-

本报告期期末基金份额总额	41,447,912.18	32,596,818.41

注：本基金合同于 2025 年 3 月 4 日生效。

§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，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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

本报告期内托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

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	
国投证券	3	629,295,138.03	73.43%	123,366.76	73.44%	-
招商证券	4	227,672,897.35	26.57%	44,610.88	26.56%	-

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本基金合同于 2025 年 3 月 4 日生效，除本表列示外，本基金还选择了长城证券、东方财富证券、东方证券、东吴证券、东兴证券、方正证券、光大证券、广发证券、国泰海通证券、国信证券、国元证券、华宝证券、华创证券、华泰证券、申万宏源证券、西部证券、西南证券、浙商证券、中国银河证券、中金公司、中泰证券、中信建投证券、中信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国泰君安证券股份有限公司自合并交割日 2025 年 3 月 14 日起吸收合并海通证券股份有限公司。根据《国泰海通证券股份有限公司关于完成公司名称变更、注册资本变更、公司章程修订及相应市场主体变更登记的公告》，自 2025 年 4 月 3 日起，国泰君安证券股份有限公司中文名称变更为“国泰海通证券股份有限公司”。

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	成交	占当期债券	成交	占当期权证	成交	占当期基金

		交总额的比例	金额	回购成交总额的比例	金额	成交总额的比例	金额	成交总额的比例
国投证券	75,758.85	100.00%	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-

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	华夏上证综合全收益指数增强型证券投资基金基金合同生效公告	中国证监会规定报刊及网站	2025-03-05
2	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
3	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
4	华夏上证综合全收益指数增强型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换、定期定额申购业务公告	中国证监会规定报刊及网站	2025-03-28
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	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