

---

华夏上证 580 交易型开放式指数  
证券投资基金联接基金  
2025 年年度报告  
2025 年 12 月 31 日

基金管理人：华夏基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：二〇二六年三月三十一日

## §1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2026 年 3 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中的财务资料经审计，安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2025 年 10 月 31 日起至 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况.....	4
3.1 主要会计数据和财务指标 .....	4
3.2 基金净值表现.....	5
3.3 过去三年基金的利润分配情况 .....	8
§4 管理人报告 .....	8
§5 托管人报告 .....	15
§6 审计报告 .....	15
§7 年度财务报表 .....	18
7.1 资产负债表.....	18
7.2 利润表.....	19
7.3 净资产变动表.....	20
7.4 报表附注.....	21
§8 投资组合报告 .....	42
8.1 期末基金资产组合情况.....	42
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	42
8.3 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 .....	43
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	57
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	59
8.6 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 .....	59
8.7 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 .....	59
8.8 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 .....	59
8.9 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 .....	59
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	59
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	60
8.12 本报告期投资基金情况 .....	60
8.13 投资组合报告附注 .....	60
§9 基金份额持有人信息 .....	61
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	61
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	61
9.3 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 .....	61
§10 开放式基金份额变动 .....	62
§11 重大事件揭示 .....	62
§12 影响投资者决策的其他重要信息 .....	65
§13 备查文件目录 .....	65

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华夏上证 580 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	
基金简称	华夏上证 580ETF 联接	
基金主代码	024943	
交易代码	024943	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2025 年 10 月 31 日	
基金管理人	华夏基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	857,707,723.89 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 580ETF 联接 A	华夏上证 580ETF 联接 C
下属分级基金的交易代码	024943	024944
报告期末下属分级基金的份额总额	783,490,959.62 份	74,216,764.27 份

#### 2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	华夏上证 580 交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	530530
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2025 年 8 月 20 日
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2025 年 8 月 29 日
基金管理人名称	华夏基金管理有限公司
基金托管人名称	中国工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，参与转融通证券出借业务策略等。
业绩比较基准	上证 580 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，因此本基金的风险与收益高于混合基金、债券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，衍生品投资策略，债券投资策略，可转换债券、可交换债券投资策略，资产支

	持证券投资策略，融资、转融通证券出借业务投资策略等。
业绩比较基准	上证 580 指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华夏基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李彬	郭明
	联系电话	400-818-6666	010-66105799
	电子邮箱	service@ChinaAMC.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-818-6666	95588
传真		010-63136700	010-66105798
注册地址		北京市顺义区安庆大街甲3号院	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址		北京市朝阳区北辰西路6号院 北辰中心C座5层	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码		100101	100140
法定代表人		邹迎光	廖林

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.ChinaAMC.com
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)	北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层
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、基金净值表现及利润分配情况

### 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	2025 年 10 月 31 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日	
	华夏上证 580ETF 联接 A	华夏上证 580ETF 联接 C
本期已实现收益	2,474,619.61	209,500.62
本期利润	19,379,561.58	1,810,337.30

加权平均基金份额本期利润	0.0247	0.0244
本期加权平均净值利润率	2.47%	2.43%
本期基金份额净值增长率	2.47%	2.44%
3.1.2 期末数据和指标	2025 年末	
	华夏上证 580ETF 联接 A	华夏上证 580ETF 联接 C
期末可供分配利润	2,474,619.61	209,500.62
期末可供分配基金份额利润	0.0032	0.0028
期末基金资产净值	802,870,521.20	76,027,101.57
期末基金份额净值	1.0247	1.0244
3.1.3 累计期末指标	2025 年末	
	华夏上证 580ETF 联接 A	华夏上证 580ETF 联接 C
基金份额累计净值增长率	2.47%	2.44%

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 10 月 31 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 580ETF 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
自基金合同生效起至今	2.47%	0.39%	3.24%	0.99%	-0.77%	-0.60%

##### 华夏上证 580ETF 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
自基金合同生效起至今	2.44%	0.39%	3.24%	0.99%	-0.80%	-0.60%

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

华夏上证 580 交易型开放式指数证券投资基金联接基金  
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  
(2025 年 10 月 31 日至 2025 年 12 月 31 日)

华夏上证 580ETF 联接 A



华夏上证 580ETF 联接 C



注：①本基金合同于 2025 年 10 月 31 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

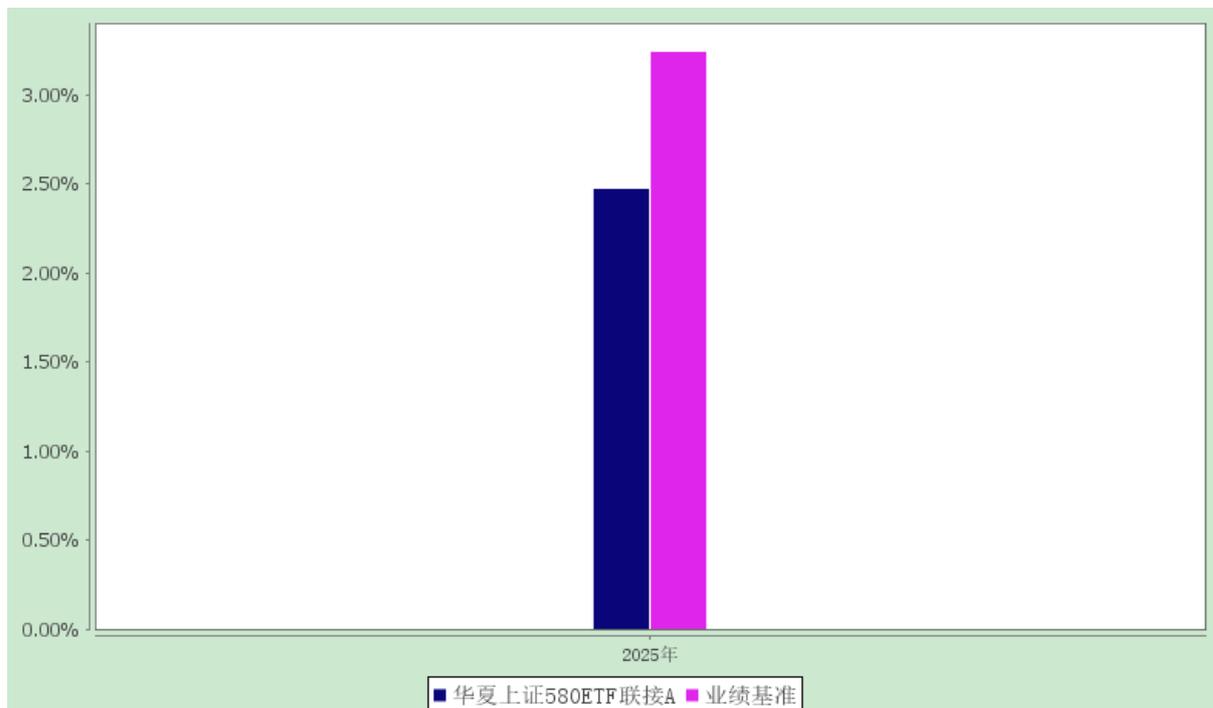
符合本基金合同中投资范围、投资限制的有关约定。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

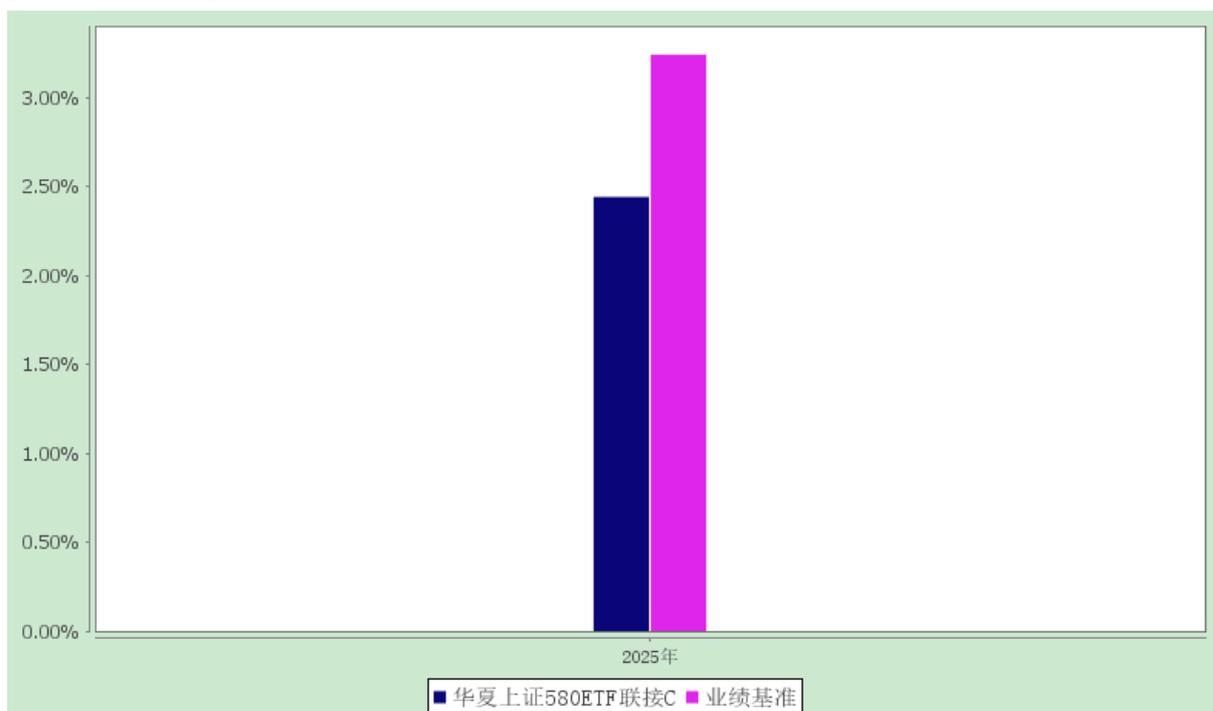
华夏上证 580 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图

华夏上证 580ETF 联接 A



华夏上证 580ETF 联接 C



注：本基金合同于 2025 年 10 月 31 日生效，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年

度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自基金合同生效以来无利润分配事项。

## §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。

华夏基金是境内权益 ETF 管理规模最大的基金管理公司之一，在指数基金管理方面积累了丰富的经验，形成了覆盖宽基、港股、行业主题、策略、跨境、商品等较为完整的指数产品线。

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 12 月 31 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 TMT 与信息技术行业偏股型基金(A 类)中华夏数字产业混合排名第 3/62；在混合型 FOF(权益资产 30%-60%)(A 类)中华夏聚源优选三个月持有混合（FOF）排名第 3/25；在养老目标日期 FOF(2050)(A 类)中华夏养老 2050 五年持有混合（FOF）排名第 4/16。

固收与固收+产品：在普通债券型基金(可投转债)(A 类)中华夏聚利债券排名第 2/273；在可转换债券型基金(A 类)中华夏可转债增强债券排名第 3/38；在普通偏债型基金(股票上限不高于 30%)(A

类)中华夏永康添福混合排名第 4/313;在短期纯债债券型基金(A类)中华夏安益短债债券排名第 4/132;在债券型 FOF(A类)中华夏聚顺优选六个月持有债券(FOF)排名第 5/17;在普通偏债型基金(股票上限不高于 30%)(A类)中华夏永顺一年持有混合排名前 5%(第 14/313),华夏兴源稳健一年持有混合排名前 5%(第 15/313)。

在客户服务方面,2025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、交易时间预估、交易场景密码验证功能给客户更方便直观安全的使用体验;(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,优化长辈模式下的业务办理功能,从客户投资需求出发,进一步提升操作体验;(3)与云湾基金、日照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“一些 ETF 小妙招送给大家”、“当你持有红利低波的时间越长,就越能感到它的可贵”“黄金的信仰比黄金贵”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	2025-10-31	-	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

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

					式指数证券投资基金基金经理（2019 年 11 月 28 日至 2025 年 6 月 3 日期间）等。
--	--	--	--	--	---

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

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

#### 4.1.3 基金经理薪酬机制

本基金管理人旗下基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的，基金经理个人薪酬激励与其管理的私募资产管理计划浮动管理费或产品业绩表现不直接挂钩，公司对其进行年度综合考核，考核结果作为确定其薪酬激励的重要参考因素之一。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规制定了《华夏基金管理有限公司公平交易制度》。公司通过科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时，通过监察稽核、事后分析和信息披露来保证公平交易过程和结果的监督。

##### 4.3.2 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。

###### 4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

本基金管理人一贯严格执行公平交易原则，对兼任基金经理的交易情况进行持续监测。本年度所有相关组合的交易行为均符合法规、制度和流程要求，未发现违反公平交易原则的情况。本年度

同一基金经理管理的不同组合在邻近交易日的同向和反向交易，交易时机和交易价差均可合理解释，未发现异常。

本基金管理人根据《基金经理兼任私募资产管理计划投资经理工作指引（试行）》要求，针对同经理管理多个组合间的收益率差异进行归因分析，本年度各组合间收益率差异均属正常情况，主要原因为业绩基准不同、投资策略不同，收益率差异可以合理解释。

#### 4.3.3 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 137 次，均为指数量化投资组合因投资策略需要发生的反向交易。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金跟踪的标的指数为上证 580 指数，基金业绩比较基准为：上证 580 指数收益率\*95%+人民币活期存款利率(税后)\*5%。上证 580 指数从沪市证券中选取市值规模较小、流动性较好的 580 只证券作为样本，反映上海证券市场市值较小上市公司证券的整体表现。本基金通过交易所买卖或申购赎回的方式投资于目标 ETF（华夏上证 580 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上证 580 指数成份股来跟踪标的指数。

2025 年，国际环境复杂多变。随着美国进入特朗普 2.0 时代，美国逐渐对其全球战略进行系统性调整，国际环境出现了一些新的变化，体现在推动俄乌会谈，转身深耕美洲地区，并频频在格陵兰岛、中东等关乎自身利益的地区强势出击。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，当下扰动的风波虽逐渐减缓，但关税大棒仍然在利益的角逐中不时出现。货币政策方面，上半年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；下半年面对就业市场降温的风险与未来可能高企的通胀担忧进行微妙的权衡，选择了中间道路，进行预防式降息。

国内方面，年初经济延续过去的良好开局，2 季度虽然受到美国关税政策的冲击，但经济运行仍然较为平稳，显示了中国出口乃至中国经济强大的韧性。一些国际投行也上调中国经济增长预期。尤其拉长时间看，经济转型切切实实地发生着，诸多新质生产力领域正展现出强劲的活力。当然，我们面临的挑战依然不小，房地产的拖累依然不容忽视，就业压力依然较大，有效需求不足并没有太多改观，而这背后，如何走出内卷，如何提高居民收入是不得不去面对的课题。中央经济工作对明年重点工作任务做出部署，坚持内需主导，建设强大国内市场，成为明年经济工作的首要重点任

务。政策整体维持宽松，报告期内，人民币对美元汇率出现明显升值。

市场方面，年初 DeepSeek 的横空出世是一个重大的事件，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，引起市场对中国科技板块和中国核心资产的重新定价。2 季度关税问题引发市场剧烈调整，但影响逐渐钝化后，市场重新聚焦于存款利率持续下行背景下风险资产性价比抬升、自下而上的新兴产业的蓬勃发展等因素带动的中国资产重估，市场持续上行。4 季度面对美联储 12 月降息不及预期的担忧、对全球流动性收紧的担忧、对 AI 强资本开支持续性的质疑以及 AI 泡沫论的热议，都引致风险偏好降温，市场随之调整，但随着美联储降息落地，市场情绪逐渐恢复，在利好因素带动下，市场逐渐收复失地。

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 12 月 31 日，华夏上证 580ETF 联接 A 份额净值为 1.0247 元，本报告期份额净值增长率为 2.47%，同期业绩比较基准增长率 3.24%，本报告期跟踪偏离度为-0.77%；华夏上证 580ETF 联接 C 份额净值为 1.0244 元，本报告期份额净值增长率为 2.44%，同期业绩比较基准增长率 3.24%，本报告期跟踪偏离度为-0.80%。与业绩比较基准产生偏离的主要原因为基金尚处于建仓期，基金组合的结构与指数结构尚存在差异等产生的差异。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，国际环境方面，我们需要关注美国全球战略调整带来的扰动。政策方面，全球主要经济体的财政政策将更为积极；美联储将迎来新的主席，在就业与通胀之间，保持美联储独立与屈从政治之间如何抉择牵动着世人的神经。

国内方面，在过去较长的时间里，我们经历着新旧动能的切换，经济转型仍在深化。新能源领域：光伏、风电、储能产业全球领先，电动汽车产销连续多年世界第一；数字经济方面：5G、云计算、大数据、工业互联网赋能千行百业；高端制造：大飞机、航天工程、高端装备不断突破；绿色转型：ESG 理念深入企业，可持续发展成为新增长点。整体经济正在从要素驱动到创新驱动，从跟随发展到并跑领跑，从规模扩张到质量提升。展望 2026 年，沉寂数年后中国 CPI 和 PPI 或将逐步进入低位回升或温和修复的通道。

市场方面，如果国内经济修复较好，结合中国在科技领域的突围，从全球视角看，中国资产的重估逻辑将继续，市场将迎来整体性的机会。如果国内经济修复不及预期，那么依然还是 2025 年的逻辑，但与 2025 年不同在于权益资产的估值已抬升，如果美联储降息节奏改变，可能会有一定的压力。需要关注产业层面的利好，好在经过过去较长时间的积淀，新型产业的突破，正在从积蓄势能

到加速爆发，从 AI、创新药、机器人到商业航天、太空光伏等等领域，它们将逐步成长为拉动就业和经济增长的新引擎，也蕴含着巨大的投资机会。

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

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

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

在合规管理方面，公司通过合规审核、合规检查、合规咨询、合规宣传与合规培训等对合规风险进行管理，确保公司合规体系高效运行，合规风险有效控制。报告期内，公司持续推进制度体系建设，结合法律法规和业务实际，在保密管理、专兼合规人员管理、投资管理人员职业道德与行为规范、洗钱风险管理等方面新增和修订多项管理制度，制度化水平显著提高。持续开展合规培训，在全员覆盖的基础上，着重加强投资研究和关键涉密岗位等重点人员的合规督导培训，强化员工主动合规意识和红线意识。持续优化合规管理的机制化和系统化，完善合规管理综合服务平台，提高合规管理效能。持续做好信息披露业务，通过流程优化、系统优化及强化培训持续保障信息披露的完整性、准确性、及时性。持续做好《推动公募基金高质量发展行动方案》及相关法规配套落实工作。公司高度重视洗钱风险管理，深入贯彻基于风险的原则，依法采取预防、管控措施，建立健全反洗钱内部控制制度，切实履行客户尽职调查、客户身份资料和交易记录保存、可疑交易报告、反洗钱特别预防措施等反洗钱义务，持续提升洗钱风险管理的有效性。

在风险控制方面，公司秉承数字化管理理念，持续升级优化内部风险管理系统、积极探索智能化业务应用，稳步夯实投资风险管理基础。紧密跟踪各项法律法规要求、加强风险研究，在严格管控基金日常投资运作风险的同时，持续完善风险管理制度建设，提升基金流动性风险、市场风险、合规风险、操作风险等关键风险的管控水平，努力保障各项风险管理措施落实到位。

在监察稽核方面，公司按照法规要求，做好日常合规监控，开展内部检查，排查业务风险隐患，促进公司整体业务合规运作、稳健经营。

报告期内，本基金管理人所管理的基金整体运作合法合规。本基金管理人将继续以风险控制为核心，坚持基金份额持有人利益优先的原则，提高监察稽核工作的科学性和有效性，切实保障基金合规稳健运作。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及基金合同约定，本基金管理人准确、及时进行基金估值和份额净值计价，制定了基金估值和份额净值计价的业务管理制度，建立了估值委员会，使用可靠的估值业务系统，设有完善的风险监测、控制和报告机制。本基金托管人审阅本基金管理人采用的估值原则及技术，并复核、审查基金资产净值和基金份额申购、赎回价格。会计师事务所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。

#### 4.8 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。

#### 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

## §5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

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

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对华夏基金管理有限公司编制和披露的本基金 2025 年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## §6 审计报告

安永华明（2026）审字第 70035283\_A221 号

华夏上证 580 交易型开放式指数证券投资基金联接基金全体基金份额持有人：

## 6.1 审计意见

我们审计了华夏上证 580 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的财务报表，包括 2025 年 12 月 31 日的资产负债表，2025 年 10 月 31 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日止期间的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。

我们认为，后附的华夏上证 580 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了华夏上证 580 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及 2025 年 10 月 31 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

## 6.2 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照《中国注册会计师独立性准则第 1 号——财务报表审计和审阅业务对独立性的要求》和中国注册会计师职业道德守则，我们独立于华夏上证 580 交易型开放式指数证券投资基金联接基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们在审计中遵循了对公众利益实体审计的独立性要求。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

## 6.3 其他信息

华夏上证 580 交易型开放式指数证券投资基金联接基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。

我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。

结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。

基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。

## 6.4 管理层和治理层对财务报表的责任

管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时，管理层负责评估华夏上证 580 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。

治理层负责监督华夏上证 580 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的财务报告过程。

#### 6.5 注册会计师对财务报表审计的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

(3) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

(4) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对华夏上证 580 交易型开放式指数证券投资基金联接基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致华夏上证 580 交易型开放式指数证券投资基金联接基金不能持续经营。

(5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

中国注册会计师

蒋燕华 王海彦

北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层

2026 年 3 月 27 日

## §7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：华夏上证 580 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

报告截止日：2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		
货币资金	7.4.7.1	269,420,833.04
结算备付金		2,120,383.50
存出保证金		46,087.22
交易性金融资产	7.4.7.2	622,314,950.31
其中：股票投资		15,317,509.52
基金投资		606,970,700.00
债券投资		26,740.79
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
其他投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
应收清算款		-
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.5	5,857,745.91
资产总计		899,759,999.98
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2025 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付清算款		20,591,094.26
应付赎回款		-
应付管理人报酬		58,121.51
应付托管费		19,373.83
应付销售服务费		12,690.57
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	7.4.7.6	181,097.04
负债合计		20,862,377.21
<b>净资产：</b>		
实收基金	7.4.7.7	857,707,723.89
未分配利润	7.4.7.8	21,189,898.88
净资产合计		878,897,622.77
负债和净资产总计		899,759,999.98

注：①报告截止日 2025 年 12 月 31 日，华夏上证 580ETF 联接 A 基金份额净值 1.0247 元，华夏上证 580ETF 联接 C 基金份额净值 1.0244 元；华夏上证 580ETF 联接基金份额总额 857,707,723.89 份（其中 A 类 783,490,959.62 份，C 类 74,216,764.27 份）。

②本基金合同于 2025 年 10 月 31 日生效，本报告期自 2025 年 10 月 31 日至 2025 年 12 月 31 日。

## 7.2 利润表

会计主体：华夏上证 580 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

本报告期：2025 年 10 月 31 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期
		2025 年 10 月 31 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		21,488,296.21
1.利息收入		344,955.53
其中：存款利息收入	7.4.7.9	344,955.53
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）		2,637,562.03
其中：股票投资收益	7.4.7.10	2,640,768.01
基金投资收益	7.4.7.11	-10,983.96
债券投资收益	7.4.7.12	1.49
资产支持证券投资收益	7.4.7.13	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-
股利收益	7.4.7.16	7,776.49
其他投资收益		-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	18,505,778.65
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-

5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	-
<b>减：二、营业总支出</b>		298,397.33
1.管理人报酬		148,500.75
2.托管费		49,500.24
3.销售服务费		24,860.34
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	7.4.7.20	-
7.税金及附加		-
8.其他费用	7.4.7.21	75,536.00
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		21,189,898.88
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		21,189,898.88
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-
<b>六、综合收益总额</b>		21,189,898.88

注：本基金合同于 2025 年 10 月 31 日生效，本报告期自 2025 年 10 月 31 日至 2025 年 12 月 31 日。

### 7.3 净资产变动表

会计主体：华夏上证 580 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

本报告期：2025 年 10 月 31 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 10 月 31 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 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	857,707,723.89	-	857,707,723.89
三、本期增减变动额 （减少以“-”号填列）	-	21,189,898.88	21,189,898.88
（一）、综合收益总额	-	21,189,898.88	21,189,898.88
（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）	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
（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	857,707,723.89	21,189,898.88	878,897,622.77

注：本基金合同于 2025 年 10 月 31 日生效，本报告期自 2025 年 10 月 31 日至 2025 年 12 月 31 日。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：邹迎光，主管会计工作负责人：朱威，会计机构负责人：朱威

#### 7.4 报表附注

##### 7.4.1 基金基本情况

华夏上证 580 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（以下简称“本基金”）已获中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可〔2025〕1411 号文《关于准予华夏上证 580 交易型开放式指数证券投资基金联接基金注册的批复》，由华夏基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《华夏上证 580 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》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 9 月 29 日至 2025 年 10 月 29 日共募集 857,207,698.70 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\_A51 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华夏上证 580 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》于 2025 年 10 月 31 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 857,707,723.89 份基金份额，其中认购资金利息折合 500,025.19 份基金份额。本基金的基金管理人为华夏基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和本基金基金合同的有关规定，本基金的标的指数为上证 580 指数。本基金主要投资于目标 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、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%，且不低于

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，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。

#### 7.4.2 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 7.4.4 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。

#### 7.4.3 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。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 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 10 月 31 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 7.4.4.3 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商业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 and 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。

### 7.4.4.4 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。

#### 7.4.4.5 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。

#### 7.4.4.6 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。

#### 7.4.4.7 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。

#### 7.4.4.8 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）。

#### 7.4.4.9 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。

#### 7.4.4.10 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。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

1、在符合有关基金分红条件的前提下，基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

3、基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4、由于基金费用的不同，不同类别的基金份额在收益分配数额方面可能有所不同，基金管理人可对各类别基金份额分别制定收益分配方案，同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在不违反法律法规且对现有基金份额持有人利益无实质不利影响的情况下，基金管理人、基金托管人协商一致并按照监管部门要求履行适当程序后可对基金收益分配原则进行调整，并应于变更

实施日前在规定媒介公告。

#### 7.4.4.12 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(包括涨跌停时的交易不活跃)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》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

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。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

##### 7.4.5.3 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。

#### 7.4.6 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》、财政部税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》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。2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。

(6) 对基金取得的债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

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

(8) 对基金在境内取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利收入时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不征收企业所得税。基金在境内从上市公司分配取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，全额计入应纳税所得额，持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，减按 50% 计入应纳税所得额，持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金通过沪股通/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。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 货币资金

单位: 人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日
活期存款	269,420,833.04
等于: 本金	269,385,262.28
加: 应计利息	35,570.76
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	269,420,833.04

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位: 人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动

股票		14,869,659.46	-	15,317,509.52	447,850.06
贵金属投资- 金交所黄金 合约		-	-	-	-
债券	交易所 市场	17,000.00	1.49	26,740.79	9,739.30
	银行间 市场	-	-	-	-
	合计	17,000.00	1.49	26,740.79	9,739.30
资产支持证 券		-	-	-	-
基金		588,922,510.71	-	606,970,700.00	18,048,189.29
其他		-	-	-	-
合计		603,809,170.17	1.49	622,314,950.31	18,505,778.65

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

#### 7.4.7.5 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日
应收利息	-
其他应收款	-
待摊费用	-
可收退补款	5,857,745.91
合计	5,857,745.91

#### 7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 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	106,097.04

其中：交易所市场	106,097.04
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	75,000.00
合计	181,097.04

#### 7.4.7.7 实收基金

##### 华夏上证 580ETF 联接 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2025年10月31日（基金合同生效日）至2025年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	783,490,959.62	783,490,959.62
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	783,490,959.62	783,490,959.62

##### 华夏上证 580ETF 联接 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2025年10月31日（基金合同生效日）至2025年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	74,216,764.27	74,216,764.27
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	74,216,764.27	74,216,764.27

注：本基金在募集期间共募集有效净认购资金 857,207,698.70 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 500,025.19 元在本基金合同生效后折算为 500,025.19 份基金份额，计入基金份额持有人账户。

#### 7.4.7.8 未分配利润

##### 华夏上证 580ETF 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
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	2,474,619.61	16,904,941.97	19,379,561.58
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,474,619.61	16,904,941.97	19,379,561.58

华夏上证 580ETF 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
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	209,500.62	1,600,836.68	1,810,337.30
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	209,500.62	1,600,836.68	1,810,337.30

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 10 月 31 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	344,283.54
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	494.67
其他	177.32
合计	344,955.53

7.4.7.10 股票投资收益

7.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 10 月 31 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-142,494.28
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	2,783,262.29
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	2,640,768.01

7.4.7.10.2 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 10 月 31 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	54,531.00
减：卖出股票成本总额	56,207.00

减：交易费用	140,818.28
买卖股票差价收入	-142,494.28

7.4.7.10.3 股票投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 10 月 31 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日
申购基金份额总额	586,759,200.00
减：现金支付申购款总额	57,128,588.54
减：申购股票成本总额	526,847,349.17
减：交易费用	-
申购差价收入	2,783,262.29

7.4.7.11 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 10 月 31 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日
卖出/赎回基金成交总额	-
减：卖出/赎回基金成本总额	-
减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额	-
减：交易费用	10,983.96
基金投资收益	-10,983.96

7.4.7.12 债券投资收益

7.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025年10月31日（基金合同生效日）至2025年 12月31日
债券投资收益——利息收入	1.49
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期 兑付）差价收入	-
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	1.49

7.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

7.4.7.13 资产支持证券投资收益

无。

7.4.7.14 贵金属投资收益

无。

#### 7.4.7.15 衍生工具收益

##### 7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

##### 7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

#### 7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025年10月31日（基金合同生效日）至2025年 12月31日
股票投资产生的股利收益	7,776.49
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	7,776.49

#### 7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025年10月31日（基金合同生效日）至2025年 12月31日
1.交易性金融资产	18,505,778.65
——股票投资	447,850.06
——债券投资	9,739.30
——资产支持证券投资	-
——基金投资	18,048,189.29
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	18,505,778.65

#### 7.4.7.18 其他收入

无。

#### 7.4.7.19 持有基金产生的费用

无。

#### 7.4.7.20 信用减值损失

无。

#### 7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2025年10月31日（基金合同生效日）至2025年12月31日
审计费用	45,000.00
信息披露费	30,000.00
证券出借违约金	-
银行费用	136.00
其他	400.00
合计	75,536.00

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无或有事项。

##### 7.4.8.2 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。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
华夏基金管理有限公司	基金管理人
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	基金托管人
华夏上证 580 交易型开放式指数证券投资基金（“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
Qatar Holding LLC	基金管理人的股东
MACKENZIE FINANCIAL CORPORATION	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
华夏资本管理有限公司（“华夏资本”）	基金管理人的子公司
华夏股权投资基金管理（北京）有限公司	基金管理人的子公司
北京华夏金科信息服务有限公司	基金管理人的子公司
China Asset Management (Hong Kong) Limited（中文名：华夏基金（香港）有限公司）	基金管理人的子公司

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。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.10.1.1 股票交易

无。

7.4.10.1.2 权证交易

无。

7.4.10.1.3 债券交易

无。

7.4.10.1.4 债券回购交易

无。

7.4.10.1.5 基金交易

无。

7.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

无。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025年10月31日（基金合同生效日）至2025年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	148,500.75
其中：应支付销售机构的客户维护费	106,811.32
应支付基金管理人的净管理费	41,689.43

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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2025年10月31日（基金合同生效日）至2025年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	49,500.24

注：①支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值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。

#### 7.4.10.2.3 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10月31日（基金合同生效日）至2025年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华夏上证 580ETF 联接 A	华夏上证 580ETF 联接 C	合计
中国工商银行	-	17,780.83	17,780.83
华夏基金管理有限公司	-	914.44	914.44
华夏财富	-	0.61	0.61
合计	-	18,695.88	18,695.88

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 0.20%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。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

#### 7.4.10.4 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

##### 7.4.10.4.1 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。

##### 7.4.10.4.2 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。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.4.10.5.2 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。

7.4.10.6 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10月31日（基金合同生效日）至2025年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行活期存款	269,420,833.04	344,283.54

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

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

7.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

截至 2025 年 12 月 31 日止，本基金持有 581,000,000 份目标 ETF 基金份额，占其总份额的比例为 94.10%。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配事项。

7.4.12 期末（2025 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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。

#### 7.4.13.2 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。

#### 7.4.13.3 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“7.4.12 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。

##### 7.4.13.3.1 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。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 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。

##### 7.4.13.4.2 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。

##### 7.4.13.4.3 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。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 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	15,317,509.52	1.74
交易性金融资产—基金投资	606,970,700.00	69.06
交易性金融资产—债券投资	26,740.79	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	622,314,950.31	70.81

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。

##### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除上证 580 指数以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）
		本期末 2025 年 12 月 31 日
	-5%	-30,852,241.70
	+5%	30,852,241.70

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 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 12 月 31 日
第一层次	622,314,950.31
第二层次	-
第三层次	-
合计	622,314,950.31

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券等投资，若出现交易不活跃（包括重大事项停牌、境内证券涨跌停等导致的交易不活跃）和非公开发行等导致流通受限的情况，本基金根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值所属层次。本基金政策以导致各层次之间转换的事项发生日作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

无。

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

截至 2025 年 12 月 31 日止，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

7.4.14.4 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。

7.4.15 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。

## §8 投资组合报告

8.1 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	15,317,509.52	1.70
	其中：股票	15,317,509.52	1.70
2	基金投资	606,970,700.00	67.46
3	固定收益投资	26,740.79	0.00
	其中：债券	26,740.79	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	271,541,216.54	30.18
8	其他各项资产	5,903,833.13	0.66
9	合计	899,759,999.98	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	20,600.00	0.00
B	采矿业	181,579.00	0.02
C	制造业	10,896,346.84	1.24
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	341,092.00	0.04
E	建筑业	186,049.00	0.02
F	批发和零售业	186,856.00	0.02
G	交通运输、仓储和邮政业	285,573.00	0.03
H	住宿和餐饮业	34,596.00	0.00

I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,897,084.68	0.22
J	金融业	431,296.00	0.05
K	房地产业	54,043.00	0.01
L	租赁和商务服务业	104,054.00	0.01
M	科学研究和技术服务业	448,463.00	0.05
N	水利、环境和公共设施管理业	119,057.00	0.01
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	130,820.00	0.01
S	综合	-	-
	合计	15,317,509.52	1.74

8.3 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

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	688110	东芯股份	8,213	1,078,777.55	0.12
2	600601	方正科技	75,100	880,172.00	0.10
3	688343	云天励飞	7,250	551,580.00	0.06
4	688498	源杰科技	800	513,592.00	0.06
5	600331	宏达股份	35,100	448,929.00	0.05
6	688322	奥比中光	3,800	340,746.00	0.04
7	688331	荣昌生物	3,816	296,846.64	0.03
8	603881	数据港	8,000	243,440.00	0.03
9	688336	三生国健	3,800	226,366.00	0.03
10	600967	内蒙一机	12,900	216,720.00	0.02
11	688621	阳光诺和	3,200	198,880.00	0.02
12	688536	思瑞浦	1,200	191,856.00	0.02
13	688539	高华科技	3,800	188,138.00	0.02
14	688088	虹软科技	3,800	188,100.00	0.02
15	601519	大智慧	14,500	186,615.00	0.02
16	688167	炬光科技	1,000	175,070.00	0.02
17	688709	成都华微	3,800	174,762.00	0.02
18	600602	云赛智联	9,300	173,817.00	0.02
19	688068	热景生物	1,000	162,000.00	0.02
20	603662	柯力传感	1,900	136,800.00	0.02
21	605598	上海港湾	1,900	132,012.00	0.02
22	688595	芯海科技	3,998	131,134.40	0.01
23	601963	重庆银行	10,900	118,047.00	0.01
24	688326	经纬恒润	1,000	117,500.00	0.01
25	688087	英科再生	3,800	117,116.00	0.01
26	688253	英诺特	3,800	114,684.00	0.01

27	688598	金博股份	3,800	111,568.00	0.01
28	688585	上纬新材	800	101,896.00	0.01
29	600103	青山纸业	22,200	93,018.00	0.01
30	688381	帝奥微	3,800	86,678.00	0.01
31	688261	东微半导	1,000	82,010.00	0.01
32	688305	科德数控	1,309	80,896.20	0.01
33	688366	昊海生科	1,800	79,020.00	0.01
34	688601	力芯微	1,800	76,662.00	0.01
35	688334	西高院	3,800	73,568.00	0.01
36	688202	美迪西	1,200	67,680.00	0.01
37	688788	科思科技	1,000	67,340.00	0.01
38	600308	华泰股份	15,900	62,010.00	0.01
39	601827	三峰环境	7,300	61,831.00	0.01
40	688626	翔宇医疗	1,000	60,500.00	0.01
41	603931	格林达	1,900	60,002.00	0.01
42	603890	春秋电子	3,700	59,681.00	0.01
43	688486	龙迅股份	800	59,448.00	0.01
44	688337	普源精电	1,600	59,024.00	0.01
45	600790	轻纺城	15,200	58,216.00	0.01
46	600523	贵航股份	3,700	58,127.00	0.01
47	603010	万盛股份	5,500	57,860.00	0.01
48	603035	常熟汽饰	3,700	57,239.00	0.01
49	688173	希荻微	3,800	55,860.00	0.01
50	688609	九联科技	5,369	54,817.49	0.01
51	600300	维维股份	15,600	54,756.00	0.01
52	600880	博瑞传播	11,000	54,340.00	0.01
53	603998	方盛制药	4,800	53,952.00	0.01
54	688653	康希通信	4,404	53,508.60	0.01
55	603212	赛伍技术	3,700	52,873.00	0.01
56	603270	金帝股份	1,900	51,357.00	0.01
57	600101	明星电力	5,500	50,875.00	0.01
58	601065	江盐集团	6,100	50,630.00	0.01
59	605365	立达信	1,900	50,274.00	0.01
60	603889	新澳股份	6,300	50,085.00	0.01
61	688429	时创能源	3,800	49,742.00	0.01
62	603277	银都股份	2,900	48,807.00	0.01
63	605286	同力天启	1,200	48,732.00	0.01
64	688155	先惠技术	800	48,360.00	0.01
65	688035	德邦科技	1,000	48,250.00	0.01
66	603611	诺力股份	1,900	46,455.00	0.01
67	603566	普莱柯	3,700	45,991.00	0.01
68	603609	禾丰股份	6,400	45,376.00	0.01
69	688275	万润新能	600	45,240.00	0.01
70	603004	鼎龙科技	1,900	44,593.00	0.01

71	601700	风范股份	7,700	43,582.00	0.00
72	605377	华旺科技	5,100	43,554.00	0.00
73	603439	三力制药	3,700	43,290.00	0.00
74	688031	星环科技	400	43,276.00	0.00
75	603357	设计总院	5,300	43,195.00	0.00
76	601121	宝地矿业	5,500	40,590.00	0.00
77	600207	安彩高科	7,700	39,655.00	0.00
78	603499	翔港科技	1,900	38,836.00	0.00
79	603381	永臻股份	1,900	37,734.00	0.00
80	603960	克来机电	1,900	37,696.00	0.00
81	603718	海利生物	6,000	36,600.00	0.00
82	603178	圣龙股份	1,900	35,853.00	0.00
83	603258	电魂网络	1,900	35,169.00	0.00
84	603119	浙江荣泰	300	34,701.00	0.00
85	605108	同庆楼	1,800	34,596.00	0.00
86	688195	腾景科技	200	33,910.00	0.00
87	603801	志邦家居	3,700	33,855.00	0.00
87	600283	钱江水利	3,700	33,855.00	0.00
88	600581	八一钢铁	10,100	33,734.00	0.00
89	603113	金能科技	5,500	33,605.00	0.00
90	603082	北自科技	900	33,210.00	0.00
91	603206	嘉环科技	1,900	32,851.00	0.00
92	600105	永鼎股份	1,300	32,630.00	0.00
93	600617	国新能源	10,100	31,714.00	0.00
94	601518	吉林高速	11,100	31,302.00	0.00
95	601199	江南水务	5,600	31,192.00	0.00
96	600897	厦门空港	1,800	30,960.00	0.00
97	603107	上海汽配	1,900	28,177.00	0.00
98	603132	金徽股份	1,900	27,873.00	0.00
99	603877	太平鸟	1,900	27,607.00	0.00
100	688205	德科立	200	27,496.00	0.00
101	603170	宝立食品	1,900	27,132.00	0.00
102	603719	良品铺子	2,300	26,933.00	0.00
103	600410	华胜天成	1,500	26,820.00	0.00
104	600595	中孚实业	3,400	26,690.00	0.00
105	603205	健尔康	900	25,731.00	0.00
106	603408	建霖家居	1,900	25,726.00	0.00
107	688766	普冉股份	200	25,442.00	0.00
108	688048	长光华芯	200	25,070.00	0.00
109	603308	应流股份	600	25,050.00	0.00
110	600180	瑞茂通	7,100	24,850.00	0.00
111	688668	鼎通科技	200	24,800.00	0.00
112	603070	万控智造	1,900	24,624.00	0.00
113	600151	航天机电	1,400	24,570.00	0.00

114	600343	航天动力	500	24,485.00	0.00
115	688270	臻镭科技	200	24,414.00	0.00
116	601208	东材科技	900	24,381.00	0.00
117	600229	城市传媒	3,700	23,458.00	0.00
118	603060	国检集团	3,700	22,496.00	0.00
119	688523	航天环宇	400	22,384.00	0.00
120	603516	淳中科技	100	22,350.00	0.00
121	688372	伟测科技	200	21,818.00	0.00
122	600388	龙净环保	1,300	21,203.00	0.00
123	603053	成都燃气	2,200	21,120.00	0.00
124	600201	生物股份	1,400	21,098.00	0.00
125	600179	安通控股	3,800	20,976.00	0.00
126	600728	佳都科技	3,000	20,040.00	0.00
127	688313	仕佳光子	224	19,886.72	0.00
128	600783	鲁信创投	800	19,784.00	0.00
129	688698	伟创电气	200	19,776.00	0.00
130	688652	京仪装备	200	19,662.00	0.00
131	601606	长城军工	400	19,248.00	0.00
132	600113	浙江东日	300	18,951.00	0.00
133	600416	湘电股份	1,200	18,936.00	0.00
134	603306	华懋科技	300	18,903.00	0.00
135	601020	华钰矿业	700	18,802.00	0.00
136	688327	云从科技	1,308	18,795.96	0.00
137	600155	华创云信	2,800	18,536.00	0.00
138	600330	天通股份	1,400	18,382.00	0.00
139	600114	东睦股份	600	18,330.00	0.00
140	603291	联合水务	1,900	18,316.00	0.00
141	600877	电科芯片	1,000	17,550.00	0.00
142	605050	福然德	1,300	17,511.00	0.00
143	600859	王府井	1,100	17,083.00	0.00
144	688102	斯瑞新材	436	16,890.64	0.00
145	600259	中稀有金	300	16,878.00	0.00
146	600759	洲际油气	5,400	16,848.00	0.00
147	603123	翠微股份	1,000	16,810.00	0.00
148	603848	好太太	900	16,443.00	0.00
149	688789	宏华数科	200	16,314.00	0.00
150	688519	南亚新材	200	16,172.00	0.00
151	603360	百傲化学	500	16,110.00	0.00
152	601375	中原证券	3,700	15,910.00	0.00
153	601975	招商南油	5,200	15,704.00	0.00
154	600635	大众公用	2,400	15,696.00	0.00
155	600986	浙文互联	2,000	15,640.00	0.00
156	600226	亨通股份	2,900	15,457.00	0.00
157	688798	艾为电子	200	15,222.00	0.00

158	603358	华达科技	300	15,150.00	0.00
158	603323	苏农银行	3,000	15,150.00	0.00
159	603686	福龙马	500	14,845.00	0.00
160	603009	北特科技	300	14,448.00	0.00
161	600320	振华重工	2,800	14,420.00	0.00
162	600326	西藏天路	1,300	14,339.00	0.00
163	600572	康恩贝	3,200	14,272.00	0.00
164	600206	有研新材	700	14,231.00	0.00
165	601778	晶科科技	3,800	14,136.00	0.00
166	688567	孚能科技	900	14,085.00	0.00
167	600872	中炬高新	800	14,040.00	0.00
168	600490	鹏欣资源	1,800	13,914.00	0.00
169	605196	华通线缆	400	13,896.00	0.00
170	601918	新集能源	2,100	13,881.00	0.00
171	600596	新安股份	1,200	13,764.00	0.00
172	600186	莲花控股	2,300	13,754.00	0.00
173	601333	广深铁路	4,500	13,680.00	0.00
173	600650	锦江在线	900	13,680.00	0.00
174	603275	众辰科技	300	13,674.00	0.00
175	601005	重庆钢铁	9,300	13,578.00	0.00
176	688239	航宇科技	200	13,534.00	0.00
177	688409	富创精密	200	13,480.00	0.00
178	688433	华曙高科	200	13,234.00	0.00
179	688531	日联科技	200	13,206.00	0.00
180	600718	东软集团	1,300	13,091.00	0.00
181	688548	广钢气体	900	13,086.00	0.00
182	600867	通化东宝	1,600	13,072.00	0.00
183	688382	益方生物	476	12,966.24	0.00
184	600797	浙大网新	1,300	12,883.00	0.00
185	600022	山东钢铁	8,400	12,684.00	0.00
186	600619	海立股份	600	12,660.00	0.00
187	600389	江山股份	500	12,640.00	0.00
188	603859	能科科技	300	12,615.00	0.00
189	688147	微导纳米	200	12,558.00	0.00
190	603997	继峰股份	900	12,510.00	0.00
191	688300	联瑞新材	200	12,418.00	0.00
192	688543	国科军工	200	12,414.00	0.00
193	600366	宁波韵升	900	12,411.00	0.00
194	600056	中国医药	1,200	12,396.00	0.00
195	688717	艾罗能源	200	12,320.00	0.00
196	688513	苑东生物	200	12,310.00	0.00
197	600739	辽宁成大	1,100	12,298.00	0.00
198	600480	凌云股份	1,000	12,290.00	0.00
199	600528	中铁工业	1,500	12,270.00	0.00

200	688503	聚和材料	200	12,200.00	0.00
201	688508	芯朋微	200	12,180.00	0.00
202	600869	远东股份	1,500	12,075.00	0.00
203	601929	吉视传媒	3,500	12,040.00	0.00
203	600959	江苏有线	3,500	12,040.00	0.00
204	600835	上海机电	400	12,004.00	0.00
205	601609	金田股份	1,100	11,880.00	0.00
206	601678	滨化股份	2,800	11,872.00	0.00
207	600908	无锡银行	2,000	11,860.00	0.00
208	600456	宝钛股份	300	11,835.00	0.00
209	600133	东湖高新	1,300	11,804.00	0.00
210	688003	天准科技	200	11,780.00	0.00
210	600063	皖维高新	2,000	11,780.00	0.00
211	600531	豫光金铅	1,000	11,750.00	0.00
212	600478	科力远	1,700	11,713.00	0.00
213	688403	汇成股份	712	11,662.56	0.00
214	600550	保变电气	1,100	11,605.00	0.00
215	688499	利元亨	200	11,544.00	0.00
216	600301	华锡有色	300	11,508.00	0.00
217	603809	豪能股份	800	11,480.00	0.00
218	688063	派能科技	200	11,364.00	0.00
219	600821	金开新能	2,200	11,220.00	0.00
220	600552	凯盛科技	900	11,160.00	0.00
221	688685	迈信林	200	11,096.00	0.00
222	601860	紫金银行	4,000	11,040.00	0.00
223	603319	美湖股份	300	10,974.00	0.00
224	688141	杰华特	252	10,944.36	0.00
225	600267	海正药业	1,100	10,879.00	0.00
226	603887	城地香江	800	10,816.00	0.00
227	600509	天富能源	1,300	10,738.00	0.00
228	603220	中贝通信	500	10,650.00	0.00
229	600864	哈投股份	1,600	10,608.00	0.00
230	603663	三祥新材	300	10,605.00	0.00
231	688049	炬芯科技	200	10,520.00	0.00
232	605123	派克新材	100	10,390.00	0.00
233	601718	际华集团	3,100	10,385.00	0.00
234	600556	天下秀	1,700	10,319.00	0.00
235	688158	优刻得	364	10,224.76	0.00
236	600037	歌华有线	1,400	10,220.00	0.00
237	688362	甬矽电子	312	10,111.92	0.00
238	600645	中源协和	400	10,080.00	0.00
239	600996	贵广网络	1,000	10,040.00	0.00
240	600744	华银电力	1,700	9,996.00	0.00
241	600717	天津港	2,200	9,834.00	0.00

242	688401	路维光电	200	9,762.00	0.00
243	600881	亚泰集团	5,200	9,672.00	0.00
243	600353	旭光电子	600	9,672.00	0.00
244	600961	株冶集团	600	9,660.00	0.00
245	688559	海目星	200	9,612.00	0.00
246	603661	恒林股份	300	9,603.00	0.00
247	600787	中储股份	1,700	9,554.00	0.00
248	603929	亚翔集成	100	9,550.00	0.00
249	603011	合锻智能	400	9,484.00	0.00
250	600651	飞乐音响	1,300	9,477.00	0.00
251	600654	中安科	2,500	9,425.00	0.00
252	688091	上海谊众	200	9,400.00	0.00
253	600106	重庆路桥	1,500	9,390.00	0.00
254	600269	赣粤高速	1,800	9,342.00	0.00
255	600017	日照港	3,100	9,300.00	0.00
256	600255	鑫科材料	2,400	9,240.00	0.00
257	688311	盟升电子	200	9,120.00	0.00
258	600475	华光环能	500	9,085.00	0.00
259	688550	瑞联新材	200	9,062.00	0.00
260	601369	陕鼓动力	900	9,009.00	0.00
261	600315	上海家化	400	9,008.00	0.00
262	688321	微芯生物	308	8,999.76	0.00
263	600827	百联股份	1,000	8,990.00	0.00
263	600771	广誉远	500	8,990.00	0.00
264	601568	北元集团	2,400	8,928.00	0.00
265	600361	创新新材	2,100	8,904.00	0.00
266	688212	澳华内镜	200	8,742.00	0.00
267	600158	中体产业	1,000	8,730.00	0.00
268	688418	震有科技	200	8,696.00	0.00
269	600587	新华医疗	600	8,640.00	0.00
270	600307	酒钢宏兴	5,200	8,580.00	0.00
271	601163	三角轮胎	600	8,574.00	0.00
272	603169	兰石重装	800	8,528.00	0.00
273	688591	泰凌微	200	8,512.00	0.00
274	688660	电气风电	500	8,505.00	0.00
275	688400	凌云光	200	8,476.00	0.00
276	688108	赛诺医疗	440	8,465.60	0.00
277	601619	嘉泽新能	1,900	8,436.00	0.00
278	688556	高测股份	732	8,359.44	0.00
279	600461	洪城环境	900	8,343.00	0.00
280	603668	天马科技	500	8,330.00	0.00
281	601969	海南矿业	700	8,316.00	0.00
282	600496	精工钢构	2,000	8,300.00	0.00
283	601890	亚星锚链	800	8,232.00	0.00

284	688306	均普智能	708	8,212.80	0.00
285	600592	龙溪股份	300	8,193.00	0.00
286	605599	菜百股份	500	8,185.00	0.00
287	600789	鲁抗医药	900	8,136.00	0.00
288	688146	中船特气	200	8,080.00	0.00
288	600420	国药现代	800	8,080.00	0.00
289	605020	永和股份	300	8,067.00	0.00
290	600751	海航科技	2,100	8,043.00	0.00
291	688262	国芯科技	264	8,012.40	0.00
292	600649	城投控股	1,800	8,010.00	0.00
293	601069	西部黄金	300	8,004.00	0.00
293	600203	福日电子	600	8,004.00	0.00
294	688522	纳睿雷达	200	7,986.00	0.00
295	600458	时代新材	600	7,962.00	0.00
296	600571	信雅达	500	7,940.00	0.00
297	603511	爱慕股份	500	7,745.00	0.00
298	600125	铁龙物流	1,200	7,728.00	0.00
299	600198	大唐电信	800	7,720.00	0.00
300	600623	华谊集团	1,000	7,710.00	0.00
301	688062	迈威生物	200	7,694.00	0.00
302	600252	中恒集团	2,800	7,672.00	0.00
303	688007	光峰科技	412	7,650.84	0.00
304	600611	大众交通	1,400	7,644.00	0.00
305	603936	博敏电子	600	7,620.00	0.00
305	600621	华鑫股份	500	7,620.00	0.00
306	688097	博众精工	200	7,550.00	0.00
307	600882	妙可蓝多	300	7,542.00	0.00
308	688153	唯捷创芯	200	7,528.00	0.00
308	600590	泰豪科技	800	7,528.00	0.00
309	603876	鼎胜新材	500	7,505.00	0.00
310	603227	雪峰科技	900	7,488.00	0.00
310	600094	大名城	1,800	7,488.00	0.00
311	603026	石大胜华	100	7,481.00	0.00
312	600575	淮河能源	2,200	7,480.00	0.00
313	688320	禾川科技	200	7,464.00	0.00
314	605507	国邦医药	300	7,440.00	0.00
315	688226	威腾电气	200	7,420.00	0.00
316	688319	欧林生物	292	7,405.12	0.00
317	688093	世华科技	200	7,370.00	0.00
318	688552	航天南湖	200	7,264.00	0.00
319	600006	东风股份	1,000	7,180.00	0.00
320	600477	杭萧钢构	2,400	7,128.00	0.00
321	600757	长江传媒	800	7,104.00	0.00
322	600686	金龙汽车	400	7,096.00	0.00

323	600557	康缘药业	500	7,055.00	0.00
324	603301	振德医疗	100	7,050.00	0.00
325	600502	安徽建工	1,500	7,035.00	0.00
326	600033	福建高速	1,700	7,021.00	0.00
327	600682	南京新百	800	6,992.00	0.00
328	688206	概伦电子	200	6,966.00	0.00
329	600610	中毅达	700	6,951.00	0.00
330	603100	川仪股份	300	6,900.00	0.00
331	605488	福莱新材	200	6,870.00	0.00
332	600971	恒源煤电	1,100	6,864.00	0.00
333	600966	博汇纸业	1,000	6,830.00	0.00
334	601500	通用股份	1,400	6,748.00	0.00
335	600928	西安银行	1,800	6,660.00	0.00
336	600812	华北制药	1,200	6,636.00	0.00
337	600108	亚盛集团	2,100	6,615.00	0.00
338	600708	光明地产	1,700	6,613.00	0.00
339	688612	威迈斯	200	6,594.00	0.00
340	603328	依顿电子	600	6,576.00	0.00
341	600973	宝胜股份	900	6,570.00	0.00
342	600664	哈药股份	1,900	6,555.00	0.00
343	605376	博迁新材	100	6,540.00	0.00
344	688639	华恒生物	200	6,516.00	0.00
345	688066	航天宏图	200	6,512.00	0.00
346	688518	联赢激光	268	6,509.72	0.00
347	600748	上实发展	1,200	6,504.00	0.00
348	688549	中巨芯	712	6,493.44	0.00
349	601789	宁波建工	1,300	6,487.00	0.00
350	600710	苏美达	600	6,486.00	0.00
351	600059	古越龙山	700	6,482.00	0.00
352	605016	百龙创园	300	6,480.00	0.00
353	600597	光明乳业	800	6,472.00	0.00
354	601200	上海环境	800	6,440.00	0.00
355	688380	中微半导	200	6,430.00	0.00
356	600305	恒顺醋业	800	6,336.00	0.00
357	688136	科兴制药	200	6,334.00	0.00
358	600855	航天长峰	300	6,312.00	0.00
359	600268	国电南自	600	6,288.00	0.00
360	601326	秦港股份	1,800	6,282.00	0.00
361	600425	青松建化	1,500	6,240.00	0.00
362	600055	万东医疗	400	6,232.00	0.00
363	688352	颀中科技	492	6,204.12	0.00
364	600979	广安爱众	1,400	6,146.00	0.00
365	603008	喜临门	300	6,144.00	0.00
366	603128	华贸物流	1,000	6,100.00	0.00

367	601579	会稽山	300	6,081.00	0.00
368	600963	岳阳林纸	1,300	6,071.00	0.00
369	603969	银龙股份	600	6,066.00	0.00
370	688001	华兴源创	200	6,036.00	0.00
371	600501	航天晨光	200	6,026.00	0.00
372	600609	金杯汽车	1,300	6,019.00	0.00
373	603693	江苏新能	500	5,930.00	0.00
374	603636	南威软件	500	5,920.00	0.00
375	603002	宏昌电子	800	5,912.00	0.00
376	688182	灿勤科技	200	5,904.00	0.00
377	600975	新五丰	1,000	5,890.00	0.00
378	600284	浦东建设	700	5,880.00	0.00
379	688277	天智航	384	5,832.96	0.00
380	688128	中国电研	200	5,816.00	0.00
381	600199	金种子酒	600	5,808.00	0.00
382	600313	农发种业	900	5,796.00	0.00
383	600073	光明肉业	900	5,760.00	0.00
384	603118	共进股份	500	5,750.00	0.00
385	600184	光电股份	300	5,718.00	0.00
386	603181	皇马科技	400	5,716.00	0.00
387	601886	江河集团	700	5,712.00	0.00
387	600217	中再资环	1,400	5,712.00	0.00
388	603638	艾迪精密	300	5,679.00	0.00
389	688138	清溢光电	200	5,632.00	0.00
390	600167	联美控股	800	5,624.00	0.00
391	601515	衢州东峰	1,300	5,590.00	0.00
392	603713	密尔克卫	100	5,577.00	0.00
393	603977	国泰集团	400	5,560.00	0.00
394	600604	市北高新	1,000	5,540.00	0.00
395	600251	冠农股份	600	5,538.00	0.00
396	600643	爱建集团	1,000	5,530.00	0.00
397	603416	信捷电气	100	5,523.00	0.00
398	603171	税友股份	100	5,513.00	0.00
399	600195	中牧股份	700	5,509.00	0.00
400	600861	北京人力	300	5,502.00	0.00
401	605555	德昌股份	300	5,490.00	0.00
402	603111	康尼机电	800	5,480.00	0.00
403	688443	智翔金泰	200	5,448.00	0.00
404	688107	安路科技	200	5,436.00	0.00
405	603995	甬金股份	300	5,424.00	0.00
406	600163	中闽能源	1,000	5,420.00	0.00
407	601388	怡球资源	1,800	5,418.00	0.00
408	600736	苏州高新	800	5,408.00	0.00
409	688150	莱特光电	200	5,406.00	0.00

410	601096	宏盛华源	1,300	5,395.00	0.00
411	600694	大商股份	300	5,379.00	0.00
412	601900	南方传媒	400	5,364.00	0.00
413	603078	江化微	300	5,355.00	0.00
414	603039	泛微网络	100	5,354.00	0.00
415	603368	柳药集团	300	5,346.00	0.00
416	601801	皖新传媒	800	5,264.00	0.00
417	600846	同济科技	400	5,260.00	0.00
418	600292	远达环保	400	5,220.00	0.00
419	603112	华翔股份	300	5,211.00	0.00
420	600335	国机汽车	800	5,208.00	0.00
421	601177	杭齿前进	300	5,205.00	0.00
422	603367	辰欣药业	300	5,196.00	0.00
423	600770	综艺股份	1,000	5,170.00	0.00
424	603477	巨星农牧	300	5,163.00	0.00
425	688739	成大生物	200	5,152.00	0.00
426	688165	埃夫特	216	5,132.16	0.00
427	603826	坤彩科技	300	5,100.00	0.00
428	600929	雪天盐业	900	5,085.00	0.00
429	688658	悦康药业	224	5,064.64	0.00
430	601686	友发集团	800	5,024.00	0.00
430	600640	国脉文化	400	5,024.00	0.00
431	688219	会通股份	404	5,017.68	0.00
432	600468	百利电气	700	4,970.00	0.00
433	688432	有研硅	400	4,964.00	0.00
433	688232	新点软件	200	4,964.00	0.00
434	603229	奥翔药业	500	4,960.00	0.00
435	688586	江航装备	380	4,955.20	0.00
436	600138	中青旅	500	4,940.00	0.00
437	600433	冠豪高新	1,500	4,920.00	0.00
438	600775	南京熊猫	400	4,888.00	0.00
439	603800	洪田股份	100	4,877.00	0.00
440	688707	振华新材	352	4,875.20	0.00
441	601107	四川成渝	800	4,864.00	0.00
442	600088	中视传媒	300	4,854.00	0.00
443	688593	新相微	240	4,843.20	0.00
444	600212	绿能慧充	600	4,830.00	0.00
445	600987	航民股份	700	4,823.00	0.00
446	603366	日出东方	500	4,805.00	0.00
447	688562	航天软件	200	4,776.00	0.00
448	600874	创业环保	800	4,752.00	0.00
449	603738	泰晶科技	300	4,713.00	0.00
450	603166	福达股份	300	4,710.00	0.00
451	603918	金桥信息	300	4,707.00	0.00

452	601226	华电科工	600	4,704.00	0.00
453	601921	浙版传媒	600	4,692.00	0.00
454	688222	成都先导	200	4,690.00	0.00
455	688298	东方生物	200	4,686.00	0.00
455	600020	中原高速	1,100	4,686.00	0.00
456	603466	风语筑	500	4,680.00	0.00
456	603312	西典新能	100	4,680.00	0.00
457	688351	微电生理	200	4,630.00	0.00
458	688177	百奥泰	200	4,628.00	0.00
459	603135	中重科技	500	4,605.00	0.00
460	600997	开滦股份	800	4,600.00	0.00
461	603985	恒润股份	300	4,572.00	0.00
462	603031	安孚科技	100	4,430.00	0.00
463	600223	福瑞达	600	4,416.00	0.00
464	688584	上海合晶	200	4,388.00	0.00
465	600713	南京医药	800	4,368.00	0.00
466	603337	杰克科技	100	4,333.00	0.00
467	603033	三维股份	400	4,324.00	0.00
468	601101	昊华能源	600	4,296.00	0.00
469	600035	楚天高速	1,100	4,268.00	0.00
470	601008	连云港	800	4,256.00	0.00
471	601038	一拖股份	300	4,251.00	0.00
472	688252	天德钰	200	4,234.00	0.00
473	600510	黑牡丹	500	4,195.00	0.00
474	600403	大有能源	600	4,188.00	0.00
475	603098	森特股份	300	4,173.00	0.00
476	605305	中际联合	100	4,166.00	0.00
477	600935	华塑股份	1,700	4,165.00	0.00
478	600197	伊力特	300	4,152.00	0.00
479	600657	信达地产	1,200	4,140.00	0.00
480	601116	三江购物	300	4,131.00	0.00
481	688151	华强科技	200	4,124.00	0.00
482	603530	神马电力	100	4,108.00	0.00
482	603271	永杰新材	100	4,108.00	0.00
483	603992	松霖科技	100	4,092.00	0.00
484	603072	天和磁材	100	4,069.00	0.00
485	688105	诺唯赞	200	4,004.00	0.00
486	600742	富维股份	400	4,000.00	0.00
487	688209	英集芯	200	3,988.00	0.00
488	600780	通宝能源	700	3,976.00	0.00
489	600903	贵州燃气	600	3,966.00	0.00
490	600491	龙元建设	1,500	3,960.00	0.00
491	603194	中力股份	100	3,931.00	0.00
492	600368	五洲交通	1,000	3,920.00	0.00

493	688225	亚信安全	200	3,880.00	0.00
494	603698	航天工程	100	3,875.00	0.00
495	605368	蓝天燃气	500	3,860.00	0.00
496	605168	三人行	100	3,858.00	0.00
497	688505	复旦张江	464	3,851.20	0.00
498	603322	超讯通信	100	3,836.00	0.00
499	600569	安阳钢铁	1,700	3,825.00	0.00
500	600310	广西能源	1,000	3,810.00	0.00
501	600981	苏豪汇鸿	1,200	3,768.00	0.00
502	600576	祥源文旅	600	3,744.00	0.00
503	600825	新华传媒	600	3,708.00	0.00
503	600449	宁夏建材	300	3,708.00	0.00
504	600894	广日股份	400	3,700.00	0.00
505	603197	保隆科技	100	3,699.00	0.00
506	605128	上海沿浦	100	3,686.00	0.00
507	603256	宏和科技	100	3,681.00	0.00
508	603203	快克智能	100	3,661.00	0.00
509	603162	海通发展	300	3,612.00	0.00
510	603383	顶点软件	100	3,611.00	0.00
511	600810	神马股份	400	3,596.00	0.00
512	600726	华电能源	1,500	3,585.00	0.00
513	603567	珍宝岛	400	3,572.00	0.00
514	600400	红豆股份	1,500	3,570.00	0.00
515	600618	氯碱化工	300	3,564.00	0.00
516	605088	冠盛股份	100	3,560.00	0.00
517	688553	汇宇制药-W	200	3,558.00	0.00
518	603708	家家悦	300	3,549.00	0.00
519	600508	上海能源	300	3,531.00	0.00
520	600548	深高速	400	3,520.00	0.00
521	605133	嵘泰股份	100	3,429.00	0.00
522	600054	黄山旅游	300	3,396.00	0.00
523	688365	光云科技	200	3,374.00	0.00
524	603310	巍华新材	200	3,362.00	0.00
525	600976	健民集团	100	3,357.00	0.00
526	601083	锦江航运	300	3,348.00	0.00
527	603983	丸美生物	100	3,315.00	0.00
528	600279	重庆港	600	3,276.00	0.00
529	601949	中国出版	500	3,225.00	0.00
530	600990	四创电子	100	3,165.00	0.00
531	600826	兰生股份	300	3,162.00	0.00
532	600162	香江控股	1,700	3,145.00	0.00
533	603299	苏盐井神	300	3,126.00	0.00
534	601279	英利汽车	600	3,120.00	0.00
535	600429	三元股份	600	3,108.00	0.00

536	605009	豪悦护理	100	3,090.00	0.00
537	688697	纽威数控	200	3,076.00	0.00
538	688046	药康生物	200	3,072.00	0.00
539	603489	八方股份	100	3,058.00	0.00
540	688526	科前生物	200	3,052.00	0.00
541	601086	国芳集团	300	3,051.00	0.00
542	600841	动力新科	500	3,045.00	0.00
543	600278	东方创业	400	3,040.00	0.00
544	603131	上海沪工	100	3,025.00	0.00
545	601003	柳钢股份	600	3,018.00	0.00
546	605118	力鼎光电	100	3,011.00	0.00
547	600605	汇通能源	100	3,000.00	0.00
548	605296	神农集团	100	2,932.00	0.00
549	600644	乐山电力	300	2,925.00	0.00
550	603395	红四方	100	2,923.00	0.00
551	603950	长源东谷	100	2,895.00	0.00
551	601339	百隆东方	500	2,895.00	0.00
552	600724	宁波富达	500	2,880.00	0.00
553	600983	惠而浦	300	2,868.00	0.00
554	688588	凌志软件	200	2,862.00	0.00
555	600939	重庆建工	900	2,853.00	0.00
556	603055	台华新材	300	2,832.00	0.00
557	603223	恒通股份	300	2,790.00	0.00
558	603069	海汽集团	100	2,715.00	0.00
559	601330	绿色动力	400	2,692.00	0.00
560	603629	利通电子	100	2,665.00	0.00
561	688315	诺禾致源	200	2,656.00	0.00
562	688389	普门科技	200	2,596.00	0.00
563	605116	奥锐特	100	2,505.00	0.00
564	603013	亚普股份	100	2,467.00	0.00
565	600551	时代出版	300	2,436.00	0.00
566	600814	杭州解百	300	2,430.00	0.00
567	603193	润本股份	100	2,423.00	0.00
568	601089	福元医药	100	2,400.00	0.00
569	605277	新亚电子	100	2,200.00	0.00
570	600071	凤凰光学	100	2,150.00	0.00
571	603121	华培动力	100	2,116.00	0.00
572	605319	无锡振华	100	2,104.00	0.00
573	605179	一鸣食品	100	2,091.00	0.00
574	600746	江苏索普	300	2,064.00	0.00
575	605011	杭州热电	100	2,044.00	0.00
576	603057	紫燕食品	100	2,034.00	0.00
577	605183	确成股份	100	1,992.00	0.00
578	600053	九鼎投资	100	1,987.00	0.00

579	603093	南华期货	100	1,949.00	0.00
580	603210	泰鸿万立	100	1,946.00	0.00
581	603855	华荣股份	100	1,935.00	0.00
582	603348	文灿股份	100	1,926.00	0.00
583	605005	合兴股份	100	1,918.00	0.00
584	605222	起帆电缆	100	1,839.00	0.00
585	603050	科林电气	100	1,802.00	0.00
586	600828	茂业商业	300	1,752.00	0.00
587	603153	上海建科	100	1,700.00	0.00
588	603125	常青科技	100	1,688.00	0.00
589	603219	富佳股份	100	1,684.00	0.00
590	603989	艾华集团	100	1,678.00	0.00
591	603103	横店影视	100	1,658.00	0.00
592	605056	咸亨国际	100	1,650.00	0.00
593	601068	中铝国际	300	1,587.00	0.00
594	603680	今创集团	100	1,541.00	0.00
595	601133	柏诚股份	100	1,540.00	0.00
596	605008	长鸿高科	100	1,427.00	0.00
597	603711	香飘飘	100	1,343.00	0.00
598	603587	地素时尚	100	1,336.00	0.00
599	605577	龙版传媒	100	1,307.00	0.00
600	600081	东风科技	100	1,183.00	0.00
601	605300	佳禾食品	100	1,160.00	0.00
602	600817	宇通重工	100	1,137.00	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	603516	淳中科技	4,909,215.00	0.56
2	688313	仕佳光子	4,832,260.45	0.55
3	600601	方正科技	4,092,515.00	0.47
4	688205	德科立	3,973,954.66	0.45
5	688110	东芯股份	3,936,037.90	0.45
6	688766	普冉股份	3,797,756.35	0.43
7	688048	长光华芯	3,789,441.50	0.43
8	600410	华胜天成	3,627,746.00	0.41
9	688536	思瑞浦	3,533,087.45	0.40
10	600105	永鼎股份	3,519,017.00	0.40
11	603308	应流股份	3,506,557.00	0.40
12	688652	京仪装备	3,422,037.66	0.39

13	688372	伟测科技	3,348,290.96	0.38
14	600595	中孚实业	3,276,030.00	0.37
15	601020	华钰矿业	3,256,860.00	0.37
16	601606	长城军工	3,050,301.00	0.35
17	603119	浙江荣泰	3,045,616.00	0.35
18	688668	鼎通科技	2,976,920.24	0.34
19	688270	臻镭科技	2,904,582.30	0.33
20	688789	宏华数科	2,797,213.91	0.32

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。

8.4.2 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	600169	ST 太重	54,531.00	0.01
2	-	-	-	-
3	-	-	-	-
4	-	-	-	-
5	-	-	-	-
6	-	-	-	-
7	-	-	-	-
8	-	-	-	-
9	-	-	-	-
10	-	-	-	-
11	-	-	-	-
12	-	-	-	-
13	-	-	-	-
14	-	-	-	-
15	-	-	-	-
16	-	-	-	-
17	-	-	-	-
18	-	-	-	-
19	-	-	-	-
20	-	-	-	-

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。

8.4.3 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	541,773,215.63
卖出股票收入（成交）总额	54,531.00

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。

8.5 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）	26,740.79	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	26,740.79	0.00

8.6 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	118062	天淮转债	170	26,740.79	0.00
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末无股指期货投资。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 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。

8.11.2 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。

8.12 本报告期投资基金情况

8.12.1 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

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	华夏上证 580ETF	股票型	交易型开放式	华夏基金管理有限公司	606,970,700.00	69.06

8.13 投资组合报告附注

8.13.1 报告期内，本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求，未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.13.2 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。

8.13.3 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	46,087.22
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	5,857,745.91
9	合计	5,903,833.13

8.13.4 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。

8.13.5 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。

8.13.6 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。

## §9 基金份额持有人信息

9.1 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
华夏上证 580ETF 联接 A	3,060	256,042.80	-	-	783,490,959.62	100.00%
华夏上证 580ETF 联接 C	5,718	12,979.50	-	-	74,216,764.27	100.00%
合计	8,778	97,711.06	-	-	857,707,723.89	100.00%

注：本章节持有人户数合计按份额级别汇总，未予以合并别重。

9.2 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 580ETF 联接 A	1,011.95	0.00%
	华夏上证 580ETF 联接 C	1.00	0.00%
	合计	1,012.95	0.00%

9.3 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 580ETF 联接 A	0
	华夏上证 580ETF 联接 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	华夏上证 580ETF 联接 A	0
	华夏上证 580ETF 联接 C	0
	合计	0

## §10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华夏上证 580ETF 联接 A	华夏上证 580ETF 联接 C
基金合同生效日（2025 年 10 月 31 日）基金份额总额	783,490,959.62	74,216,764.27
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	-	-
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	-	-
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	783,490,959.62	74,216,764.27

注：本基金合同于 2025 年 10 月 31 日生效。

## §11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 11.2 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，邹迎光先生担任本基金管理人董事长，李一梅女士担任本基金管理人副董事长，张佑君先生离任本基金管理人董事长。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 11.3 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。

### 11.4 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。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期应支付给安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为 45,000.00 元人民币。

本基金本报告期内选聘安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）提供首年审计服务。

11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

11.6.1 管理人受调查或处罚等情况

管理人受调查或处罚等情况	内容
受到调查或处罚等措施的主体	华夏基金管理有限公司
受到调查或处罚等措施的时间	2025 年 11 月 4 日
采取调查或处罚等措施的机构	中国证监会北京监管局
受到调查或处罚等措施类型	行政监管措施
受到的具体措施类型	出具警示函
受到调查或处罚等措施的原因	人员管理、其他问题（内部控制、销售管理等）
受到处罚的依据	《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》《公开募集证券投资基金运作管理办法》《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》《证券发行与承销管理办法(2018 年修订)》《公开募集证券投资基金宣传推介材料管理暂行规定》《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》《证券期货经营机构及其工作人员廉洁从业规定》《证券基金经营机构信息技术管理办法(2021 年修正)》《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》《证券公司和证券投资基金管理公司境外设立、收购、参股经营机构管理办法(2021 年修正)》
管理人采取整改措施的情况(如提出整改意见)	基金管理人高度重视，从业务改进、制度优化、培训宣贯等方面进行了整改，现已完成全部整改工作，并向监管机构报送整改报告。
其他	无

11.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

管理人相关从业人员受调查或处罚等情况	内容
受到调查或处罚等措施的主体	高级管理人员
受到调查或处罚等措施的时间	2025 年 12 月 26 日
采取调查或处罚等措施的机构	中国证监会北京监管局
受到调查或处罚等措施类型	行政监管措施
受到的具体措施类型	出具警示函
受到调查或处罚等措施的原因	人员管理、其他问题（内部控制、销售管理等）
受到处罚的依据	《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》
管理人采取整改措施的情况(如提出整改意见)	基金管理人高度重视，从业务改进、制度优化、培训宣贯等方面进行了整改，现已完成全部整改工作，并向监管机构报送整改报告。
其他	无

11.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内托管人无受调查或处罚等情况。

#### 11.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内托管人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

#### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

##### 11.7.1 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	
中国银河证券	2	283,363,458.59	52.30%	55,473.58	52.29%	-
招商证券	1	258,464,288.04	47.70%	50,623.46	47.71%	-

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 10 月 31 日生效，除本表列示外，本基金本报告期末选择其他交易单元作为本基金交易单元。

##### 11.7.2 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
中国银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	2,088,014.70	100.00%

### 11.8 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 580 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同生效公告	中国证监会规定报刊及网站	2025-11-01
2	华夏上证 580 交易型开放式指数证券投资基金联接基金开放日常申购、赎回、转换、定期定额申购业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025-12-31

## §12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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。

## §13 备查文件目录

### 13.1 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。

### 13.2 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。

### 13.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的住所免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

华夏基金管理有限公司

二〇二六年三月三十一日