

华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金
2026 年中期报告
2026 年 6 月 30 日

基金管理人：华夏基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：二〇二六年八月三十一日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 8 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	16
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	16
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	17
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	18
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	18
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	18
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	19
§5 托管人报告	19
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	19
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	19
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	19
§6 中期报告财务会计报告（未经审计）	19
6.1 资产负债表	19
6.2 利润表	21
6.3 净资产变动表	22
6.4 报表附注	23
§7 投资组合报告	46
7.1 期末基金资产组合情况	46
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	46
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细	47
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	58
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	60
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	61
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	61
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	61
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	61
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	61
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	61
7.12 本报告期投资基金情况	61
7.13 投资组合报告附注	62

§8 基金份额持有人信息	62
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	62
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	63
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	63
§9 开放式基金份额变动	63
§10 重大事件揭示	64
10.1 基金份额持有人大会决议	64
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	64
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	64
10.4 基金投资策略的改变	64
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	64
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	64
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	65
10.8 其他重大事件	66
§11 影响投资者决策的其他重要信息	66
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	66
§12 备查文件目录	66
12.1 备查文件目录	66
12.2 存放地点	67
12.3 查阅方式	67

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金		
基金简称	华夏沪深 300ETF 联接		
基金主代码	000051		
交易代码	000051		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2009 年 7 月 10 日		
基金管理人	华夏基金管理有限公司		
基金托管人	中国工商银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	7,936,274,365.43 份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称	华夏沪深 300ETF 联接 A	华夏沪深 300ETF 联接 C	华夏沪深 300ETF 联接 Y
下属分级基金的交易代码	000051	005658	022983
报告期末下属分级基金的份额总额	6,699,124,678.14 份	1,181,216,909.70 份	55,932,777.59 份

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	510330
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2012 年 12 月 25 日
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2013 年 1 月 16 日
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	采用指数化投资方式，追求对标的指数的有效跟踪，获得与标的指数收益相似的回报及适当的其他收益。
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、债券投资策略、衍生品投资策略、资产支持证券投资策略、参与转融通证券出借业务策略等。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为沪深 300 指数收益率 $\times$ 95%+1%（指年收益

	率，评价时应按期间折算）。
风险收益特征	本基金属于股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。

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

2.3 基金管理人和基金托管人

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

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.ChinaAMC.com
基金中期报告置备地点	基金管理人和/或基金托管人的住所/办公地址

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	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（2026 年 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日）		
	华夏沪深 300ETF 联接 A	华夏沪深 300ETF 联接 C	华夏沪深 300ETF 联接 Y
本期已实现收益	310,809,211.03	47,442,296.32	2,330,995.08
本期利润	968,728,921.25	196,533,439.83	7,660,902.26
加权平均基金份额本期利润	0.1414	0.1657	0.1493
本期加权平均净值利润率	7.93%	9.54%	8.37%
本期基金份额净值增长率	8.07%	7.91%	8.07%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2026年6月30日）		
	华夏沪深 300ETF 联接 A	华夏沪深 300ETF 联接 C	华夏沪深 300ETF 联接 Y
期末可供分配利润	5,900,190,723.56	983,677,944.38	49,262,320.63
期末可供分配基金份额利润	0.8807	0.8328	0.8807
期末基金资产净值	12,599,315,401.70	2,164,894,854.08	105,195,098.22
期末基金份额净值	1.8807	1.8328	1.8807
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2026年6月30日）		
	华夏沪深 300ETF 联接 A	华夏沪深 300ETF 联接 C	华夏沪深 300ETF 联接 Y
基金份额累计净值增长率	88.07%	33.39%	29.71%

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

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

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

④本基金自 2018 年 2 月 2 日增加 C 类基金份额类别;本基金自 2024 年 12 月 13 日增加 Y 类基金份额类别。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华夏沪深 300ETF 联接 A:

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	12.09%	1.19%	11.57%	1.19%	0.52%	0.00%
过去六个月	8.07%	1.07%	7.73%	1.07%	0.34%	0.00%
过去一年	27.90%	0.97%	26.25%	0.97%	1.65%	0.00%
过去三年	37.40%	1.06%	31.40%	1.06%	6.00%	0.00%
过去五年	6.53%	1.06%	1.17%	1.06%	5.36%	0.00%
过去七年	48.09%	1.11%	36.40%	1.11%	11.69%	0.00%
过去十年	88.45%	1.09%	66.01%	1.09%	22.44%	0.00%
自基金合同生效起至今	88.07%	1.30%	63.12%	1.32%	24.95%	-0.02%

华夏沪深 300ETF 联接 C:

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	12.01%	1.19%	11.57%	1.19%	0.44%	0.00%
过去六个月	7.91%	1.07%	7.73%	1.07%	0.18%	0.00%
过去一年	27.53%	0.97%	26.25%	0.97%	1.28%	0.00%
过去三年	36.18%	1.06%	31.40%	1.06%	4.78%	0.00%
过去五年	4.95%	1.06%	1.17%	1.06%	3.78%	0.00%
过去七年	45.00%	1.11%	36.40%	1.11%	8.60%	0.00%
自新增份额类别以来至今	33.39%	1.16%	25.10%	1.16%	8.29%	0.00%

注：本基金自 2018 年 2 月 2 日增加 C 类基金份额类别。

华夏沪深 300ETF 联接 Y:

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	12.09%	1.19%	11.57%	1.19%	0.52%	0.00%
过去六个月	8.07%	1.07%	7.73%	1.07%	0.34%	0.00%
过去一年	27.90%	0.97%	26.25%	0.97%	1.65%	0.00%
自新增份额类别以来至今	29.71%	0.96%	26.95%	0.96%	2.76%	0.00%

注：本基金自 2024 年 12 月 13 日增加 Y 类基金份额类别。

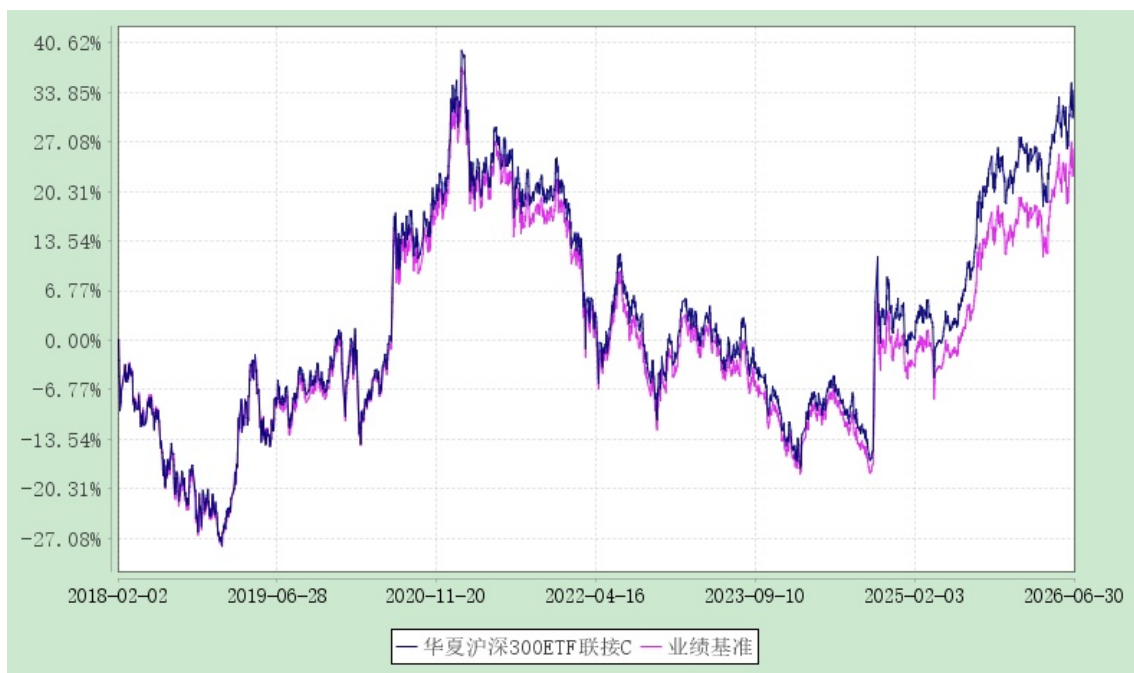
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金
 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
 （2009 年 7 月 10 日至 2026 年 6 月 30 日）

华夏沪深 300ETF 联接 A：

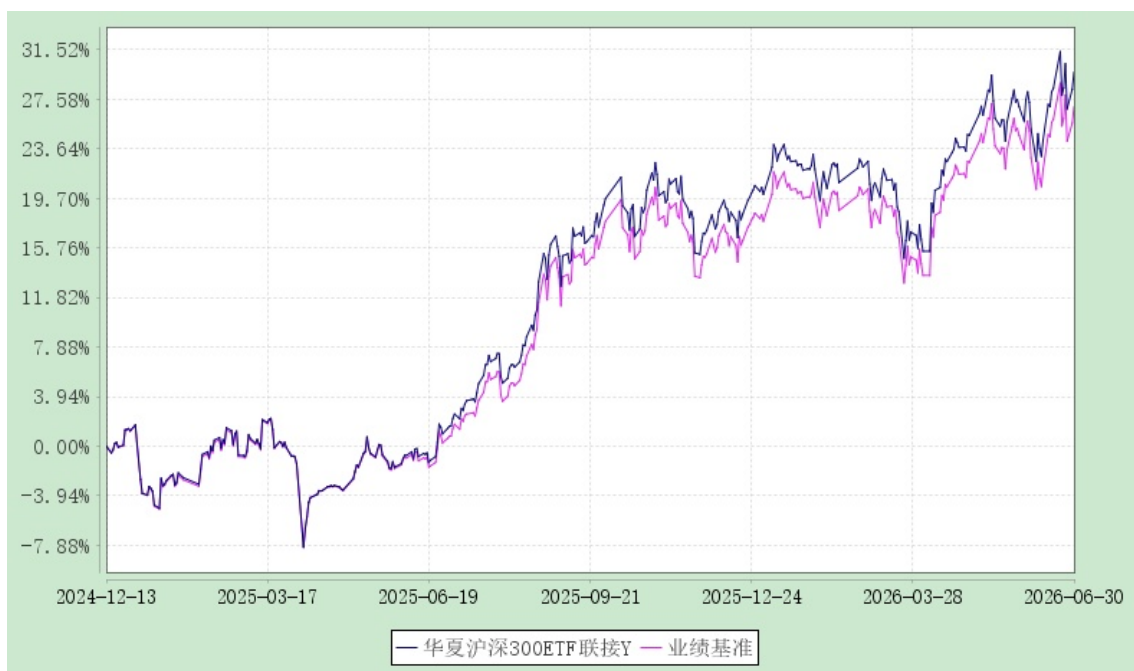


华夏沪深 300ETF 联接 C：



注：本基金自 2018 年 2 月 2 日增加 C 类基金份额类别。

华夏沪深 300ETF 联接 Y：



注：本基金自 2024 年 12 月 13 日增加 Y 类基金份额类别。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

华夏基金管理有限公司成立于 1998 年 4 月 9 日，是经中国证监会批准成立的首批全国性基金管理公司之一。公司总部设在北京，在北京、上海、深圳、成都、南京、杭州、广州、青岛、武汉及沈阳设有分公司，在香港、深圳、上海、北京设有子公司。公司是首批全国社保基金管理人、首批企业年金基金管理人、境内首批 QDII 基金管理人、境内首只 ETF 基金管理人、境内首只沪港通 ETF 基金管理人、首批内地与香港基金互认基金管理人、首批基本养老保险基金投资管理人、首家加入联合国责任投资原则组织的公募基金公司、首批公募 FOF 基金管理人、首批公募养老目标基金管理人、首批个人养老金基金管理人、境内首批中日互通 ETF 基金管理人、首批商品期货 ETF 基金管理人、首批纳入互联互通 ETF 基金管理人、首批北交所主题基金管理人以及特定客户资产管理人、保险资金投资管理人、公募 REITs 管理人、首批浮动管理费基金管理人、首批公募 REITs 指数基金管理人，境内首家承诺“碳中和”具体目标和路径的公募基金公司，香港子公司是首批 RQFII 基金管理人。华夏基金是业务领域最广泛的基金管理公司之一。

华夏基金是境内 ETF 基金资产管理规模最大的基金管理公司之一，在 ETF 基金管理方面积累了丰富的经验，形成了覆盖宽基指数、港股（QDII）指数、港股（港股通）指数、行业主题指数、策略指数、跨境指数、固收指数、商品指数等较为完整的产品线。

华夏基金以深入的投资研究为基础，尽力捕捉市场机会，为投资人谋求良好的回报。根据银河证券基金研究中心《中国基金业绩评价报告》，截至 2026 年 6 月 30 日，华夏基金旗下多只产品近 1 年同类排名靠前（基金排名不作为产品未来表现的保证）：

主动权益产品：在混合型 FOF(权益资产 30%-60%)(A 类)中，华夏聚源优选三个月持有混合（FOF）(A 类)排名第 1/25；在低碳环保行业股票型基金(A 类)中，华夏节能环保股票(A 类)排名第 1/10；在 TMT 与信息技术行业偏股型基金(A 类)中，华夏数字产业混合(A 类)排名第 2/64；在低碳环保偏股型基金(A 类)中，华夏低碳经济一年持有混合(A 类)排名第 3/32；在债券型 FOF(A 类)中，华夏聚顺优选六个月持有债券（FOF）(A 类)排名第 3/24；在养老目标日期 FOF(2045)(A 类)中，华夏养老 2045 三年持有混合（FOF）(A 类)排名第 3/18；在养老目标日期 FOF(2050)(A 类)中，华夏养老 2050 五年持有混合（FOF）(A 类)排名第 3/15；在 QDII 混合基金(A 类)中，华夏移动互联混合（QDII）排名第 3/56、华夏新时代混合（QDII）排名第 5/56、华夏全球科技先锋混合（QDII）排名第 7/56；在偏股型基金(股票上限 80%)(A 类)中，华夏成长混合排名第 13/149；在医药医疗健康行业偏股型基金(A 类)中，华夏乐享健康混合(A 类)排名第 15/89；在偏股型基金(股票上限 95%)(A 类)中，华夏线上经济主题精选混合排名第 25/220；在标准股票型基金(A 类)中，华夏创新前沿股票(A 类)排名第 43/354、华夏领先股票排名第 49/354、华夏经济转型股票排名第 57/354、华夏潜龙精选股票排名第 66/354；在灵活配置型基金(基准股票比例 30%-60%)(A 类)中，华夏磐晟混合（LOF）排名第 35/397、华夏新锦程混合(A 类)排名第 62/397、华夏稳增混合排名第 79/397；在灵活配置型基金(基准股票比例 60%-100%)(A 类)中，华夏高端制造混合(A 类)排名第 36/478；在偏股型基金(股票上下限 60%-95%)(A 类)中，华夏先进制造龙头混合(A 类)排名第 23/1941、华夏科技创新混合(A 类)排名第 78/1941、华夏成长先锋一年持有混合(A 类)排名第 116/1941、华夏核心科技 6 个月定开混合(A 类)排名第 191/1941、华夏产业升级混合(A 类)排名第 212/1941、华夏国企创新混合发起式（A 类）排名第 249/1941、华夏成长机会一年持有混合排名第 268/1941、华夏创业板两年定开混合排名第 276/1941、华夏盛世混合排名第 292/1941、华夏创新驱动混合(A 类)排名第 365/1941、华夏科技前沿 6 个月定开混合(A 类)排名第 372/1941、华夏行业景气混合(A 类)排名第 374/1941。

固收与固收+产品：在可转换债券型基金(A 类)中，华夏可转债增强债券 A 排名第 1/38；在普通债券型基金(可投转债)(A 类)中，华夏双债债券 A 排名第 1/280、华夏聚利债券 A 排名第 4/280、华夏债券 AB 排名第 74/280；在普通偏债型基金(股票上限不高于 30%)(A 类)中，华夏永康添福混合 A

排名第 2/307、华夏兴源稳健一年持有混合 A 排名第 17/307、华夏永顺一年持有混合 A 排名第 31/307；在短期纯债债券型基金(A 类)中，华夏安益短债债券 A 排名第 7/133、华夏 30 天滚动短债债券发起式 A 排名第 8/133；在利率债纯债债券型基金(A 类)中，华夏鼎昭利率债债券 A 排名第 7/98；在普通债券型基金(二级)(A 类)中，华夏鼎沛债券 A 排名第 10/540、华夏鼎清债券 A 排名第 12/540、华夏鼎利债券 A 排名第 47/540；在普通偏债型基金(股票上限高于 30%)(A 类)中，华夏永鑫六个月持有混合 A 排名第 17/245、华夏永泓一年持有混合 A 排名第 28/245；在长期纯债债券型基金(A 类)中，华夏鼎富债券 A 排名第 61/1041、华夏鼎航债券 A 排名第 67/1041、华夏鼎信债券 A 排名第 115/1041、华夏纯债债券 A 排名第 234/1041、华夏鼎茂债券 A 排名第 268/1041；在标准偏债型基金(股票上下限 10%-30%)(A 类)中，华夏稳进增益一年持有混合 A 排名第 11/71。

在客户服务方面，2026 年上半年，华夏基金继续以客户需求为导向，努力提高客户使用的便利性和服务体验：（1）华夏基金管家客户端优化基金详情展示，增强信息可读性，从客户投资需求出发，进一步提升使用体验；（2）与国贸期货、新华信通等代销机构合作，拓展更加丰富的客户理财渠道；（3）开展“未来，我们继续一起走过”、“选择难度大？给你支个招”、“当前科技股的三国博弈”等活动，为客户提供了多样化的投资者教育和关怀服务。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 （助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
赵宗庭	本基金的基金经理、投委会成员	2017-04-17	-	18 年	硕士。曾任华夏基金管理有限公司研究发展部产品经理、数量投资部研究员，嘉实基金管理有限公司指数投资部基金经理助理，嘉实国际资产管理有限公司基金经理。2016 年 11 月加入华夏基金管理有限公司。历任华夏中证四川国企

					改革交易型 开放式指数 证券投资基金 基金基金经理 （2020 年 12 月 8 日至 2022 年 1 月 13 日 期间）、华夏中 证浙江国资 创新发展交 易型开放式 指数证券投 资基金基金 经理（2020 年 12 月 8 日 至 2022 年 1 月 13 日期间）、 华夏中证浙 江国资创新 发展交易型 开放式指数 证券投资基金 基金联接基金 基金经理 （2020 年 12 月 8 日至 2022 年 1 月 13 日 期间）、华夏中 证四川国企 改革交易型 开放式指数 证券投资基金 发起式联 接基金基金 经理（2020 年 12 月 8 日 至 2022 年 1 月 13 日期间）、 上证主要消 费交易型开 放式指数发 起式证券投 资基金基金 经理(2020 年 2 月 12 日至
--	--	--	--	--	---

					2022 年 8 月 22 日期间)、华夏中证大数据产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理 (2021 年 2 月 9 日至 2022 年 8 月 22 日期间)、华夏中证新能源交易型开放式指数证券投资基金基金经理 (2021 年 3 月 9 日至 2022 年 8 月 22 日期间)、华夏中证新材料主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理 (2021 年 8 月 4 日至 2023 年 3 月 27 日期间)、华夏中证石化产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理 (2021 年 12 月 2 日至 2023 年 3 月 27 日期间)、华夏国证消费电子主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理 (2021 年 8 月 12 日至 2023 年 6
--	--	--	--	--	---

					月 29 日期间)、 华夏中证机 器人交易型 开放式指数 证券投资基金 基金基金经理 (2021 年 12 月 17 日至 2023 年 6 月 29 日期间)、 华夏中证细 分有色金属 产业主题交 易型开放式 指数证券投 资基金基金 经理 (2021 年 6 月 9 日至 2023 年 12 月 28 日期间)、 华夏中证细 分有色金属 产业主题交 易型开放式 指数证券投 资基金发起 式联接基金 基金经理 (2022 年 10 月 18 日至 2023 年 12 月 28 日期间)、 华夏中证云 计算与大数 据主题交易 型开放式指 数证券投资 基金基金经理 (2021 年 8 月 24 日至 2025 年 6 月 3 日期间)、华夏 沪深 300ESG 基准交易型 开放式指数
--	--	--	--	--	---

					证券投资基金基金经理 (2022 年 2 月 24 日至 2025 年 6 月 3 日期间)、华夏中证云计算与大数据主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理 (2023 年 11 月 14 日至 2025 年 6 月 3 日期间)、华夏沪深 300ESG 基准交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理 (2024 年 4 月 9 日至 2025 年 6 月 3 日期间)等。
--	--	--	--	--	--

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

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《华夏基金管理有限公司公平交易制度》的规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，本基金管理人旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 45 次，均为指数量化投资组合因投资策略需要发生的反向交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金跟踪的标的指数为沪深 300 指数，业绩基准为沪深 300 指数收益率 $\times 95\% + 1\%$ （指年收益率，评价时应按期间折算）。沪深 300 指数由沪深 A 股中规模大、流动性好、最具代表性的 300 只股票组成，于 2005 年 4 月 8 日正式发布，以综合反映沪深 A 股市场整体表现。沪深 300 指数是内地首只股指期货的标的指数。本基金的投资策略主要通过交易所买卖或申购赎回的方式投资于目标 ETF（华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金）的份额从而实现基金投资目标。基金也可以通过买入标的指数成份股来跟踪标的指数。

2026 年上半年，全球经济在地缘冲突扰动和 AI 基建加速两条主线影响下呈现 K 型分化。油价先扬后抑、上半年中枢较去年四季度整体上移，叠加地缘风险溢价，推高全球通胀压力并影响传统经济复苏；AI Agent 驱动下 AI 产业链投资构建增长核心动能。主要经济体受供给冲击和需求韧性差异表现分化，货币政策由前期宽松转向“按兵不动+紧缩预期”并明显分化。国内方面，十五五开局之年延续高质量发展趋势，上半年保持一定增长韧性，物价呈结构性复苏，输入型通胀特征显现；货币政策保持适度宽松，但 M2、社融增速边际回落；总体供强需弱矛盾突出、经济向好基础仍需巩固。

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

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2026 年 6 月 30 日，华夏沪深 300ETF 联接 A 份额净值为 1.8807 元，本报告期份额净值增长率为 8.07%，同期业绩比较基准增长率 7.73%，本报告期跟踪偏离度为+0.34%；华夏沪深 300ETF 联接 C 份额净值为 1.8328 元，本报告期份额净值增长率为 7.91%，同期业绩比较基准增长率 7.73%，本报告期跟踪偏离度为+0.18%；华夏沪深 300ETF 联接 Y 份额净值为 1.8807 元，本报告期份额净值增长率为 8.07%，同期业绩比较基准增长率 7.73%，本报告期跟踪偏离度为+0.34%。与业绩比较基准产生偏离的主要原因为日常运作费用、指数结构调整、申购赎回、成份股分红等产生的差异。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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

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

本基金将会根据基金合同要求，在紧密跟踪标的指数的基础上，做好相关投资工作。

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

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及基金合同约定，本基金管理人为准确、及时进行基金估值和份额净值计价，制定了基金估值和份额净值计价的业务管理制度，建立了估值委员会，使用可靠的估值业务系统，设有完善的风险监测、控制和报告机制。本基金托管人审阅本基金管理人采用的估值原则及技术，并复核、审查基金资产净值和基金份额申购、赎回价格。会计师事务所在估值调整导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上时对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性发表专业意见。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对华夏基金管理有限公司编制和披露的本基金 2026 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§6 中期报告财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	274,135,954.17	398,326,382.73
结算备付金		58,970,851.83	45,711,959.10
存出保证金		14,411,203.59	31,340,921.72
交易性金融资产	6.4.7.2	14,531,545,248.69	13,354,795,523.55
其中：股票投资		207,231,964.04	230,927,042.88

基金投资		13,820,196,846.29	12,617,988,206.70
债券投资		504,116,438.36	505,880,273.97
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		21,703,444.48	15,422,679.04
应收股利		-	-
应收申购款		13,589,981.04	708,179,806.51
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		14,914,356,683.80	14,553,777,272.65
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		41,650,060.31	752,924,797.78
应付管理人报酬		129,293.30	146,841.69
应付托管费		43,097.76	48,947.24
应付销售服务费		522,715.80	611,046.10
应付投资顾问费		-	-
应交税费		1,803,929.33	885,202.88
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	802,233.30	821,832.82
负债合计		44,951,329.80	755,438,668.51

净资产：			
实收基金	6.4.7.7	7,936,274,365.43	7,950,676,660.08
未分配利润	6.4.7.8	6,933,130,988.57	5,847,661,944.06
净资产合计		14,869,405,354.00	13,798,338,604.14
负债和净资产总计		14,914,356,683.80	14,553,777,272.65

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，华夏沪深 300ETF 联接 A 基金份额净值 1.8807 元，华夏沪深 300ETF 联接 C 基金份额净值 1.8328 元，华夏沪深 300ETF 联接 Y 基金份额净值 1.8807 元；华夏沪深 300ETF 联接基金份额总额 7,936,274,365.43 份（其中 A 类 6,699,124,678.14 份，C 类 1,181,216,909.70 份，Y 类 55,932,777.59 份）。

6.2 利润表

会计主体：华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		1,178,372,827.55	175,126,782.79
1.利息收入		1,069,215.71	714,805.90
其中：存款利息收入	6.4.7.9	1,069,215.71	714,805.90
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）		363,303,093.08	257,518,244.17
其中：股票投资收益	6.4.7.1 0	24,304,258.00	7,915,793.90
基金投资收益	6.4.7.1 1	316,055,797.42	51,393,626.45
债券投资收益	6.4.7.1 2	3,248,135.41	2,959,974.00
资产支持证券投资收益	6.4.7.1 3	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.1 4	-	-

衍生工具收益	6.4.7.1 5	17,894,262.12	2,581,434.85
股利收益	6.4.7.1 6	1,800,640.13	192,667,414.97
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.1 7	812,340,760.91	-83,900,187.81
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.1 8	1,659,757.85	793,920.53
减：二、营业总支出		5,449,564.21	4,138,049.56
1.管理人报酬		801,463.07	667,617.33
2.托管费		267,154.39	222,539.07
3.销售服务费		3,049,493.97	2,935,576.95
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		4,304.47	-
其中：卖出回购金融资产支出		4,304.47	-
6.信用减值损失	6.4.7.2 0	-	-
7.税金及附加		1,208,247.54	194,701.10
8.其他费用	6.4.7.2 1	118,900.77	117,615.11
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,172,923,263.34	170,988,733.23
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,172,923,263.34	170,988,733.23
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		1,172,923,263.34	170,988,733.23

6.3 净资产变动表

会计主体：华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
----	---------------------------------------

	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	7,950,676,660.08	5,847,661,944.06	13,798,338,604.14
二、本期期初净资产	7,950,676,660.08	5,847,661,944.06	13,798,338,604.14
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-14,402,294.65	1,085,469,044.51	1,071,066,749.86
（一）、综合收益总额	-	1,172,923,263.34	1,172,923,263.34
（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）	-14,402,294.65	-87,454,218.83	-101,856,513.48
其中：1.基金申购款	2,287,023,562.08	1,684,503,613.85	3,971,527,175.93
2.基金赎回款	-2,301,425,856.73	-1,771,957,832.68	-4,073,383,689.41
（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	7,936,274,365.43	6,933,130,988.57	14,869,405,354.00
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	8,701,595,604.34	3,886,515,561.47	12,588,111,165.81
二、本期期初净资产	8,701,595,604.34	3,886,515,561.47	12,588,111,165.81
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-242,814,231.99	51,657,226.03	-191,157,005.96
（一）、综合收益总额	-	170,988,733.23	170,988,733.23
（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）	-242,814,231.99	-119,331,507.20	-362,145,739.19
其中：1.基金申购款	1,638,632,239.80	673,102,093.07	2,311,734,332.87
2.基金赎回款	-1,881,446,471.79	-792,433,600.27	-2,673,880,072.06
（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	8,458,781,372.35	3,938,172,787.50	12,396,954,159.85

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：邹迎光，主管会计工作负责人：朱威，会计机构负责人：朱威

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（原名华夏沪深 300 指数证券投资基金，以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2009]531 号《关于核准华夏沪深 300 指数证券投资基金募集的批复》核准，由华夏基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金运作管理办法》、《华夏沪深 300 指数证券投资基金基金合同》及其他有关法律法规负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限为不定期。本基金自 2009 年 7 月 6 日至 2009 年 7 月 8 日期间共募集 24,771,692,420.44 元（不含认购资金利息），业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字（2009）第 718 号予以验证。经向中国证监会备案，《华夏沪深 300 指数证券投资基金基金合同》于 2009 年 7 月 10 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 24,771,957,170.09 份基金份额，其中认购资金利息折合 264,749.65 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。根据基金管理人 2018 年 1 月 31 日刊登的《华夏基金管理有限公司关于修订华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同的公告》及《关于华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金增加 C 类基金份额类别的公告》，本基金自 2018 年 2 月 2 日起增加 C 类基金份额类别。根据基金管理人刊登的相关公告，本基金自 2024 年 12 月 13 日增加 Y 类基金份额类别。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和本基金基金合同的有关规定，本基金主要投资于目标 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（含中小板、创业板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。本基金还可根据法律法规的规定参与转融通证券出借业务。法律法规或监管机构允许基金投资其他品种的（包括但不限于股指期货等金融衍生品），基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金投资范围中的股票包含存托凭证。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布和修订的《企业会计准则——基本准则》、各项具体会计准则（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《公开募集证券投资基金信息披露内容与格式准则第 2 号——定期报告的内容与格式》、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协

会”)发布的《公开募集证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号——年度报告和中期报告》编制,同时在信息披露方面也参考了中国证监会、中国基金业协会发布的基金行业实务操作的其他有关规定。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

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

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

根据财税[2005]103 号《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81 号《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]125 号《财政部、国家税务总局、证监会关于内地与香港基金互认有关税收政策的通知》、财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2023]39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财政部税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、中华人民共和国主席令第四十一号《中华人民共和国增值税法》、中华人民共和国国务院令 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》及财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

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

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

(3) 存款利息收入不征收增值税。

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

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

(6) 对基金取得的债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

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

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

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

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	274,135,954.17
等于：本金	274,107,324.11
加：应计利息	28,630.06
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	274,135,954.17

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	173,292,218.68	-	207,231,964.04	33,939,745.36
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	500,350,350.00	504,116,438.36	149,650.00
	合计	500,350,350.00	504,116,438.36	149,650.00
资产支持证券	-	-	-	-
基金	10,729,899,445.13	-	13,820,196,846.29	3,090,297,401.16
其他	-	-	-	-

合计	11,403,542,013.81	3,616,438.36	14,531,545,248.69	3,124,386,796.52
----	-------------------	--------------	-------------------	------------------

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	111,709,140.00	-	-	-
其中：股指期货	111,709,140.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	111,709,140.00	-	-	-

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IF2609	沪深 300 期货 IF2609 合约	78	113,485,320.00	1,776,180.00
合计	-	-	-	1,776,180.00
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	1,776,180.00
净额	-	-	-	-

注：衍生金融资产项下的利率/权益/其他衍生工具为国债/股指/商品期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指/商品/国债期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指/商品/国债期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 0。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 其他资产

无。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	43,025.03
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	587,509.02
其中：交易所市场	585,039.05
银行间市场	2,469.97
应付利息	-
预提费用	171,699.25
合计	802,233.30

6.4.7.7 实收基金

华夏沪深 300ETF 联接 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	7,012,041,892.82	7,012,041,892.82
本期申购	943,754,880.62	943,754,880.62
本期赎回（以“-”号填列）	-1,256,672,095.30	-1,256,672,095.30
本期末	6,699,124,678.14	6,699,124,678.14

华夏沪深 300ETF 联接 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	899,410,939.84	899,410,939.84

本期申购	1,314,121,174.93	1,314,121,174.93
本期赎回（以“-”号填列）	-1,032,315,205.07	-1,032,315,205.07
本期末	1,181,216,909.70	1,181,216,909.70

华夏沪深 300ETF 联接 Y

金额单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	39,223,827.42	39,223,827.42
本期申购	29,147,506.53	29,147,506.53
本期赎回（以“-”号填列）	-12,438,556.36	-12,438,556.36
本期末	55,932,777.59	55,932,777.59

注：申购含红利再投（如有）、转换入份额（如有），赎回含转换出份额（如有）。

6.4.7.8 未分配利润

华夏沪深 300ETF 联接 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	7,714,165,414.64	-2,523,647,466.49	5,190,517,948.15
本期期初	7,714,165,414.64	-2,523,647,466.49	5,190,517,948.15
本期利润	310,809,211.03	657,919,710.22	968,728,921.25
本期基金份额交易产生的变动数	-351,144,764.78	92,088,618.94	-259,056,145.84
其中：基金申购款	1,057,426,691.74	-320,388,824.75	737,037,866.99
基金赎回款	-1,408,571,456.52	412,477,443.69	-996,094,012.83
本期已分配利润	-	-	-
本期末	7,673,829,860.89	-1,773,639,137.33	5,900,190,723.56

华夏沪深 300ETF 联接 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,016,163,877.15	-388,054,546.48	628,109,330.67
本期期初	1,016,163,877.15	-388,054,546.48	628,109,330.67
本期利润	47,442,296.32	149,091,143.51	196,533,439.83

本期基金份额交易产生的变动数	320,160,341.17	-161,125,167.29	159,035,173.88
其中：基金申购款	1,504,150,484.21	-579,219,137.24	924,931,346.97
基金赎回款	-1,183,990,143.04	418,093,969.95	-765,896,173.09
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,383,766,514.64	-400,088,570.26	983,677,944.38

华夏沪深 300ETF 联接 Y

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	43,151,395.05	-14,116,729.81	29,034,665.24
本期期初	43,151,395.05	-14,116,729.81	29,034,665.24
本期利润	2,330,995.08	5,329,907.18	7,660,902.26
本期基金份额交易产生的变动数	18,588,515.36	-6,021,762.23	12,566,753.13
其中：基金申购款	32,567,412.74	-10,033,012.85	22,534,399.89
基金赎回款	-13,978,897.38	4,011,250.62	-9,967,646.76
本期已分配利润	-	-	-
本期末	64,070,905.49	-14,808,584.86	49,262,320.63

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	620,066.85
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	384,289.12
其他	64,859.74
合计	1,069,215.71

6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	176,210,894.72

减：卖出股票成本总额	151,770,305.92
减：交易费用	136,330.80
买卖股票差价收入	24,304,258.00

6.4.7.11 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出/赎回基金成交总额	1,678,873,219.86
减：卖出/赎回基金成本总额	1,353,194,806.81
减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额	9,485,779.02
减：交易费用	136,836.61
基金投资收益	316,055,797.42

6.4.7.12 债券投资收益

6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	3,435,885.41
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-187,750.00
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	3,248,135.41

6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	507,700,000.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	500,185,450.00
减：应计利息总额	7,700,000.00
减：交易费用	2,300.00
买卖债券差价收入	-187,750.00

6.4.7.13 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.14 贵金属投资收益

无。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
股指期货投资收益	17,894,262.12

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,800,640.13
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,800,640.13

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
1.交易性金融资产	814,902,100.91
——股票投资	1,241,125.63
——债券投资	235,100.00
——资产支持证券投资	-
——基金投资	813,425,875.28
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-2,561,340.00
——权证投资	-

——期货投资	-2,561,340.00
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值 税	-
合计	812,340,760.91

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
基金赎回费收入	1,659,757.85
合计	1,659,757.85

6.4.7.19 持有基金产生的费用

无。

6.4.7.20 信用减值损失

无。

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
审计费用	37,191.88
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	13,201.52
银行间账户维护费	9,000.00
合计	118,900.77

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

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

本基金本报告期不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华夏基金管理有限公司	基金管理人
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	基金托管人
华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金（“目标 ETF”）	本基金是该基金的联接基金
中信证券股份有限公司（“中信证券”）	基金管理人的股东
上海华夏财富投资管理有限公司（“华夏财富”）	基金管理人的子公司
中信证券华南股份有限公司（“中信证券（华南）”）	基金管理人第一大股东的子公司
中信证券（山东）有限责任公司（“中信证券（山东）”）	基金管理人第一大股东的子公司
中信期货有限公司（“中信期货”）	基金管理人第一大股东的子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日		上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
中信证券	736,299.45	0.24%	-	-

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 债券交易

无。

6.4.10.1.4 债券回购交易

无。

6.4.10.1.5 基金交易

无。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日			
	当期 佣金	占当期佣金总 量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
中信证券	92.03	0.32%	92.03	0.02%
关联方名称	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			
	当期 佣金	占当期佣金总 量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
中信证券	-	-	-	-

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

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	801,463.07	667,617.33
其中：应支付销售机构的客户维护费	2,701,454.89	2,612,275.66
应支付基金管理人的净管理费	-1,899,991.82	-1,944,658.33

注：①支付基金管理人的基金管理人报酬按前一日基金资产净值扣除基金资产中目标 ETF 份额所对应资产净值后剩余部分(剩余部分若为负数则取 0)的 0.15%年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

②基金管理人报酬计算公式为：日基金管理人报酬=(前一日的基金资产净值-前一日基金资产中目标 ETF 份额所对应资产净值)×年费率/当年天数。若前一日的基金资产净值扣除基金资产中目标 ETF 份额所对应资产净值后剩余部分为负数，则按 0 计算。

③客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用按照代销机构所代销基金的份额保有量作为基数进行计算，从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30 日	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	267,154.39	222,539.07

注：①支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值扣除基金资产中目标 ETF 份额所对应资产净值后剩余部分(剩余部分若为负数则取 0)的 0.05%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

②基金托管费计算公式为：日基金托管费＝（前一日的基金资产净值－前一日基金资产中目标 ETF 份额所对应资产净值）×年费率/当年天数。若前一日的基金资产净值扣除基金资产中目标 ETF 份额所对应资产净值后剩余部分为负数，则按 0 计算。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期2026年1月1日至2026年6月30日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	华夏沪深 300ETF 联接 A	华夏沪深 300ETF 联接 C	华夏沪深 300ETF 联接 Y	合计
华夏基金管理有限公司	-	1,323,538.10	-	1,323,538.10
中国工商银行	-	173,728.11	-	173,728.11
中信证券	-	43,860.28	-	43,860.28
华夏财富	-	21,854.40	-	21,854.40
中信证券（山东）	-	9,382.11	-	9,382.11
中信证券（华南）	-	6,802.31	-	6,802.31
中信期货	-	284.22	-	284.22
合计	-	1,579,449.53	-	1,579,449.53
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			

	华夏沪深 300ETF 联接 A	华夏沪深 300ETF 联接 C	华夏沪深 300ETF 联接 Y	合计
华夏基金管理有限公司	-	683,025.11	-	683,025.11
中国工商银行	-	164,691.53	-	164,691.53
中信证券	-	60,887.20	-	60,887.20
华夏财富	-	23,682.35	-	23,682.35
中信证券（山东）	-	12,232.27	-	12,232.27
中信证券（华南）	-	6,308.92	-	6,308.92
中信期货	-	734.81	-	734.81
合计	-	951,562.19	-	951,562.19

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	上年度可比期间
	2026年1月1日至2026年6月30日	2025年1月1日至2025年6月30日

	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行活期存款	274,135,954.17	620,066.85	167,764,275.18	469,010.09

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

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位： 股/张）	总金额
中信证券	688820	盛合晶微	新股发行	23,902	470,391.36
中信证券	688808	联讯仪器	新股发行	1,624	132,973.12
中信证券	688785	恒运昌	新股发行	1,155	106,467.90
中信证券	688797	臻宝科技	新股发行	2,070	92,239.20
中信证券	688811	有研复材	新股发行	8,337	53,440.17
中信证券	001248	华润新能源	新股发行	500	5,055.00
上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位： 股/张）	总金额
中信证券	688775	影石创新	新股发行	5,725	270,620.75
中信证券	688583	思看科技	新股发行	1,742	58,287.32
中信证券	688755	汉邦科技	新股发行	2,023	46,063.71
中信证券	603257	中国瑞林	新股发行	780	16,005.60
中信证券	603124	江南新材	新股发行	879	9,264.66

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

于 2026 年 6 月 30 日，本基金持有的中信证券股票估值总额为 2,636,695.75 元，占基金资产净值的比例为 0.02%（2025 年 12 月 31 日，本基金持有的中信证券股票估值总额为 3,180,350.25 元，占基金资产净值的比例为 0.02%）。

于 2026 年 6 月 30 日，本基金持有的中国工商银行股票估值总额为 2,256,037.00 元，占基金资产净值的比例为 0.02%（2025 年 12 月 31 日，本基金持有的中国工商银行股票估值总额为 3,005,470.00 元，占基金资产净值的比例为 0.02%）。

截至 2026 年 6 月 30 日止，本基金持有 2,642,282,970 份目标 ETF 基金份额（2025 年 12 月 31 日：2,616,591,296 份），占其总份额的比例为 35.28%（2025 年 12 月 31 日：5.52%）。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配事项。

6.4.12 期末（2026 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688795	摩尔线程	2025-11-26	9 个月	新发流通受限	114.28	676.94	10,828	1,237,423.84	7,329,906.32	-
688802	沐曦股份	2025-12-09	9 个月	新发流通受限	104.66	768.89	3,994	418,012.04	3,070,946.66	-
688783	西安奕材	2025-10-20	9 个月	新发流通受限	8.62	57.42	44,370	382,469.40	2,547,725.40	-
688765	禾元生物	2025-10-16	9 个月	新发流通受限	29.06	48.56	16,470	478,618.20	799,783.20	-
688759	必贝特	2025-10-21	9 个月	新发流通受限	17.78	30.65	12,552	223,174.56	384,718.80	-
688820	盛合晶微	2026-04-13	6 个月	新发流通受限	19.68	141.49	2,391	47,054.88	338,302.59	-
688790	昂瑞微	2025-12-09	9 个月	新发流通受限	83.06	126.45	2,319	192,616.14	293,237.55	-
688781	视涯科技	2026-03-18	9 个月	新发流通受限	22.68	42.16	6,335	143,677.80	267,083.60	-
688808	联讯仪器	2026-04-16	6 个月	新发流通受限	81.88	1,584.33	163	13,346.44	258,245.79	-
001399	惠科股份	2026-06-16	6 个月	新发流通受限	10.12	27.73	6,488	65,658.56	179,912.24	-

688818	电科 蓝天	2026-0 2-03	6 个月	新发 流通 受限	9.47	70.14	1,717	16,259. 99	120,43 0.38	-
688797	臻宝 科技	2026-0 6-16	6 个月	新发 流通 受限	44.56	468.67	207	9,223.9 2	97,014. 69	-
688712	北芯 生命	2026-0 1-28	6 个月	新发 流通 受限	17.52	35.92	1,500	26,280. 00	53,880. 00	-
688785	恒运 昌	2026-0 1-20	6 个月	新发 流通 受限	92.18	463.15	116	10,692. 88	53,725. 40	-
688813	泰金 新能	2026-0 3-24	6 个月	新发 流通 受限	26.28	172.09	234	6,149.5 2	40,269. 06	-
688635	长进 光子	2026-0 5-20	6 个月	新发 流通 受限	40.98	308.19	128	5,245.4 4	39,448. 32	-
603459	红板 科技	2026-0 3-31	6 个月	新发 流通 受限	17.70	84.32	330	5,841.0 0	27,825. 60	-
688811	有研 复材	2026-0 4-01	6 个月	新发 流通 受限	6.41	24.13	834	5,345.9 4	20,124. 42	-
601112	振石 股份	2026-0 1-21	6 个月	新发 流通 受限	11.18	17.59	775	8,664.5 0	13,632. 25	-
688816	易思 维	2026-0 2-04	6 个月	新发 流通 受限	55.95	57.10	177	9,903.1 5	10,106. 70	-
603407	长裕 集团	2026-0 4-29	6 个月	新发 流通 受限	13.86	73.46	137	1,898.8 2	10,064. 02	-
920136	永励 精密	2026-0 6-25	1 个月 内 (含)	新发 流通 受限	19.28	19.28	300	5,784.0 0	5,784.0 0	-
001248	华润 新能 源	2026-0 6-25	1 个月 内 (含)	新发 流通 受限	10.11	10.11	500	5,055.0 0	5,055.0 0	-
603435	嘉德 利	2026-0 5-15	6 个月	新发 流通 受限	15.76	46.71	104	1,639.0 4	4,857.8 4	-
603352	至信 股份	2026-0 1-08	6 个月	新发 流通 受限	21.88	25.52	112	2,450.5 6	2,858.2 4	-

920193	吉和昌	2026-06-18	1 个月内 (含)	新发 流通 受限	8.52	8.52	300	2,556.0 0	2,556.0 0	-
603293	埃泰克	2026-04-09	6 个月	新发 流通 受限	33.49	33.93	72	2,411.2 8	2,442.9 6	-
920189	康美特	2026-06-30	1 个月内 (含)	新发 流通 受限	8.14	8.14	200	1,628.0 0	1,628.0 0	-
603284	林平发展	2026-02-03	6 个月	新发 流通 受限	37.88	34.87	46	1,742.4 8	1,604.0 2	-

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

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

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

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

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末 估值 单价	复牌 日期	复牌 开盘 单价	数量 (股)	期末 成本总额	期末 估值总额	备注
688072	拓荆科技	2026-06-29	重大事项	879.53	2026-07-13	890.99	1,000	671,772.15	879,530.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

6.4.13.3 流动性风险

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

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

在资产端，本基金主要通过交易所买卖或申购赎回的方式投资于流动性较好的目标 ETF 基金，基金管理人持续监测目标 ETF 基金的市场交易量、申赎情况及标的指数成份股流动性等影响资产流动性的因素，并定期开展压力测试，详细评估在不同的压力情景下资产变现情况的变化。

在负债端，基金管理人持续监测本基金投资者历史申赎、投资者类型和结构变化等数据，审慎评估不同市场环境可能带来的投资者潜在赎回需求，当市场环境或投资者结构发生变化时，及时调

整组合资产结构，预留充足现金头寸，保持基金资产可变现规模和期限与负债赎回规模和期限的匹配。

如遭遇极端市场情形或投资者非预期巨额赎回情形，基金管理人将采用本基金合同约定的赎回申请处理方式及其他各类流动性风险管理工具，控制极端情况下的潜在流动性风险。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指由于市场变化或波动所引起的资产损失的可能性，本基金管理人通过监测组合敏感性指标来衡量市场风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率变动引起组合中资产特别是债券投资的市场价格变动，从而影响基金投资收益的风险。

本基金主要通过投资于目标 ETF 基金份额、标的指数成份股、备选成份股来跟踪标的指数。因此，利率风险不是本基金的主要风险。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险为除市场利率和外汇汇率以外的市场因素（单个证券发行主体自身经营情况或证券市场整体波动）发生变动时导致基金资产发生损失的风险。

本基金主要投资于目标 ETF 基金份额、标的指数成份股、备选成份股。本基金的其他价格风险与目标 ETF 基金相似。本基金管理人通常用敏感性指标来衡量市场价格风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	207,231,964.04	1.39	230,927,042.88	1.67
交易性金融资产—基金投资	13,820,196,846.29	92.94	12,617,988,206.70	91.45
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-

其他	-	-	-	-
合计	14,027,428,810.33	94.34	12,848,915,249.58	93.12

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

②由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位：人民币元)	
		本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
	-5%	-778,449,482.59	-686,677,999.04
	+5%	778,449,482.59	686,677,999.04

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

- 第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；
- 第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；
- 第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026 年 6 月 30 日
第一层次	14,010,566,111.28
第二层次	505,010,991.36
第三层次	15,968,146.05
合计	14,531,545,248.69

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券等投资，若出现交易不活跃（包括重大事项停牌、境内证券涨跌停等导致的交易不活跃）和非公开发行等导致流通受限的情况，本基金根据估值调整中采用的对公允价

值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值所属层次。本基金政策以导致各层次之间转换的事项发生日作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

截至 2026 年 6 月 30 日止，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，其账面价值与公允价值差异很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元			
序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	207,231,964.04	1.39
	其中：股票	207,231,964.04	1.39
2	基金投资	13,820,196,846.29	92.66
3	固定收益投资	504,116,438.36	3.38
	其中：债券	504,116,438.36	3.38
	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	333,106,806.00	2.23
8	其他各项资产	49,704,629.11	0.33
9	合计	14,914,356,683.80	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
----	------	---------	------------------

A	农、林、牧、渔业	213,239.00	0.00
B	采矿业	8,313,540.02	0.06
C	制造业	129,169,333.51	0.87
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,162,597.20	0.03
E	建筑业	2,942,137.42	0.02
F	批发和零售业	117,976.00	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	5,340,045.32	0.04
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,497,734.02	0.08
J	金融业	41,294,097.42	0.28
K	房地产业	594,284.02	0.00
L	租赁和商务服务业	716,269.00	0.00
M	科学研究和技术服务业	1,764,929.25	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	31,478.86	0.00
R	文化、体育和娱乐业	74,303.00	0.00
S	综合	-	-
	合计	207,231,964.04	1.39

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

7.3.1 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	300308	中际旭创	5,840	7,416,800.00	0.05
2	688795	摩尔线程	10,828	7,329,906.32	0.05
3	688012	中微公司	14,382	6,737,967.00	0.05
4	600519	贵州茅台	4,828	5,723,545.72	0.04
5	603986	兆易创新	6,913	5,634,095.00	0.04
6	601318	中国平安	100,496	4,797,679.04	0.03

7	300502	新易盛	7,416	4,501,512.00	0.03
8	300750	宁德时代	10,620	4,173,766.20	0.03
9	600036	招商银行	116,300	4,128,650.00	0.03
10	688981	中芯国际	25,266	4,012,746.12	0.03
11	688041	海光信息	9,764	3,615,609.20	0.02
12	688008	澜起科技	11,226	3,478,937.40	0.02
13	601899	紫金矿业	134,500	3,381,330.00	0.02
14	688256	寒武纪	2,062	3,290,024.10	0.02
15	601138	工业富联	43,600	3,145,740.00	0.02
16	688802	沐曦股份	3,994	3,070,946.66	0.02
17	600030	中信证券	91,775	2,636,695.75	0.02
18	600183	生益科技	14,800	2,566,320.00	0.02
19	688783	西安奕材	44,370	2,547,725.40	0.02
20	002371	北方华创	2,825	2,498,882.00	0.02
21	601166	兴业银行	149,400	2,474,064.00	0.02
22	601398	工商银行	319,100	2,256,037.00	0.02
23	002475	立讯精密	27,400	1,928,960.00	0.01
24	600900	长江电力	72,250	1,912,457.50	0.01
25	603019	中科曙光	16,563	1,776,050.49	0.01
26	603259	药明康德	14,175	1,764,929.25	0.01
27	601288	农业银行	289,400	1,756,658.00	0.01
28	000725	京东方 A	195,500	1,696,940.00	0.01
29	601328	交通银行	248,500	1,597,855.00	0.01
30	002384	东山精密	5,900	1,547,865.00	0.01
31	600276	恒瑞医药	28,510	1,483,660.40	0.01
32	600919	江苏银行	134,050	1,445,059.00	0.01
33	600150	中国船舶	42,462	1,434,790.98	0.01
34	600176	中国巨石	19,200	1,399,296.00	0.01
35	601211	国泰海通	73,788	1,342,941.60	0.01
36	600584	长电科技	12,900	1,335,795.00	0.01

37	300408	三环集团	7,300	1,218,370.00	0.01
38	600930	华电新能	254,555	1,214,227.35	0.01
39	300394	天孚通信	3,960	1,198,612.80	0.01
40	601816	京沪高铁	258,000	1,168,740.00	0.01
41	605117	德业股份	10,571	1,122,428.78	0.01
42	002463	沪电股份	7,200	1,100,160.00	0.01
43	600089	特变电工	47,790	1,075,275.00	0.01
44	688111	金山办公	4,961	1,056,941.05	0.01
45	603993	洛阳钼业	60,000	1,053,000.00	0.01
46	300059	东方财富	51,320	1,045,901.60	0.01
47	601688	华泰证券	50,354	1,038,299.48	0.01
48	600000	浦发银行	116,274	1,001,119.14	0.01
49	600309	万华化学	14,400	985,104.00	0.01
50	600887	伊利股份	41,000	982,360.00	0.01
51	300476	胜宏科技	2,800	970,004.00	0.01
52	600031	三一重工	55,244	954,616.32	0.01
53	300274	阳光电源	5,980	950,939.60	0.01
54	601601	中国太保	33,100	944,012.00	0.01
55	600111	北方稀土	19,400	932,170.00	0.01
56	601988	中国银行	160,700	919,204.00	0.01
57	688072	拓荆科技	1,000	879,530.00	0.01
58	600406	国电南瑞	38,420	877,897.00	0.01
59	601728	中国电信	164,111	851,736.09	0.01
60	603501	豪威集团	8,915	845,587.75	0.01
61	000988	华工科技	4,551	840,160.11	0.01
62	601668	中国建筑	191,400	830,676.00	0.01
63	002916	深南电路	1,800	824,220.00	0.01
64	601088	中国神华	21,000	819,840.00	0.01
65	601229	上海银行	93,082	807,951.76	0.01
66	688765	禾元生物	16,470	799,783.20	0.01

67	600941	中国移动	9,200	792,396.00	0.01
68	301308	江波龙	1,100	774,180.00	0.01
69	601919	中远海控	57,630	764,173.80	0.01
70	600522	中天科技	12,400	752,432.00	0.01
71	601012	隆基绿能	56,844	745,793.28	0.01
72	600016	民生银行	226,360	728,879.20	0.00
73	600999	招商证券	33,700	711,070.00	0.00
74	688521	芯原股份	1,900	705,166.00	0.00
75	600050	中国联通	174,400	697,600.00	0.00
76	601939	建设银行	72,100	694,323.00	0.00
77	601169	北京银行	138,256	677,454.40	0.00
78	002415	海康威视	19,700	673,740.00	0.00
79	688126	沪硅产业	16,771	668,995.19	0.00
80	600460	士兰微	11,800	644,988.00	0.00
81	000100	TCL 科技	109,900	639,618.00	0.00
82	000063	中兴通讯	17,200	622,468.00	0.00
83	688036	传音控股	10,451	616,086.45	0.00
84	688396	华润微	6,303	614,857.65	0.00
85	000338	潍柴动力	21,700	591,325.00	0.00
86	601857	中国石油	68,100	591,108.00	0.00
87	300433	蓝思科技	10,700	574,162.00	0.00
88	601766	中国中车	110,300	573,560.00	0.00
89	600926	杭州银行	39,400	569,330.00	0.00
90	601628	中国人寿	16,100	569,135.00	0.00
91	601100	恒立液压	5,049	543,070.44	0.00
92	601009	南京银行	54,492	538,925.88	0.00
93	601600	中国铝业	64,000	526,080.00	0.00
94	300124	汇川技术	7,900	524,007.00	0.00
95	601872	招商轮船	29,700	521,829.00	0.00
96	603799	华友钴业	10,700	516,382.00	0.00

97	601658	邮储银行	101,900	502,367.00	0.00
98	002028	思源电气	2,900	501,700.00	0.00
99	601225	陕西煤业	24,600	500,610.00	0.00
100	601818	光大银行	172,400	498,236.00	0.00
101	688082	盛美上海	1,150	496,800.00	0.00
102	600893	航发动力	12,900	494,586.00	0.00
103	600660	福耀玻璃	9,800	494,312.00	0.00
104	601985	中国核电	53,200	480,396.00	0.00
105	300033	同花顺	1,980	477,180.00	0.00
106	600690	海尔智家	23,356	476,695.96	0.00
107	002938	鹏鼎控股	4,300	453,134.00	0.00
108	688271	联影医疗	4,419	447,335.37	0.00
109	601006	大秦铁路	96,800	446,248.00	0.00
110	600958	东方证券	47,216	445,719.04	0.00
111	600760	中航沈飞	10,668	438,454.80	0.00
112	601336	新华保险	7,200	429,552.00	0.00
113	600028	中国石化	95,600	426,376.00	0.00
114	002230	科大讯飞	10,400	424,736.00	0.00
115	600489	中金黄金	23,200	418,760.00	0.00
116	300661	圣邦股份	2,871	411,931.08	0.00
117	300442	润泽科技	4,900	407,043.00	0.00
118	002142	宁波银行	13,700	406,753.00	0.00
119	600010	宝钢股份	180,470	402,448.10	0.00
120	000001	平安银行	39,900	400,995.00	0.00
121	601390	中国中铁	94,641	394,652.97	0.00
122	601066	中信建投	13,500	392,445.00	0.00
123	000977	浪潮信息	5,600	392,000.00	0.00
124	600019	宝钢股份	71,900	390,417.00	0.00
125	688759	必贝特	12,552	384,718.80	0.00
126	601377	兴业证券	63,337	382,555.48	0.00

127	002602	世纪华通	26,900	379,290.00	0.00
128	300014	亿纬锂能	5,800	377,174.00	0.00
129	603288	海天味业	11,350	376,366.00	0.00
130	600547	山东黄金	16,208	374,242.72	0.00
131	600989	宝丰能源	18,400	374,072.00	0.00
132	002049	紫光国微	4,200	372,750.00	0.00
133	601838	成都银行	21,000	371,700.00	0.00
134	600015	华夏银行	58,155	371,610.45	0.00
135	600160	巨化股份	6,900	365,769.00	0.00
136	603296	华勤技术	4,900	363,923.00	0.00
137	600362	江西铜业	8,300	359,390.00	0.00
138	601669	中国电建	75,700	355,790.00	0.00
139	601916	浙商银行	134,000	352,420.00	0.00
140	000938	紫光股份	12,200	352,092.00	0.00
141	600875	东方电气	12,000	345,240.00	0.00
142	688820	盛合晶微	2,391	338,302.59	0.00
143	601995	中金公司	9,300	336,195.00	0.00
144	600570	恒生电子	15,674	332,132.06	0.00
145	600585	海螺水泥	19,544	331,270.80	0.00
146	601868	中国能建	123,600	330,012.00	0.00
147	600938	中国海油	11,800	320,370.00	0.00
148	000333	美的集团	4,200	317,226.00	0.00
149	600905	三峡能源	85,185	316,036.35	0.00
150	601360	三六零	36,000	312,840.00	0.00
151	600438	通威股份	25,400	307,594.00	0.00
152	002352	顺丰控股	9,700	303,222.00	0.00
153	600346	恒力石化	17,100	302,841.00	0.00
154	002241	歌尔股份	13,300	299,649.00	0.00
155	002709	天赐材料	5,800	298,294.00	0.00
156	600009	上海机场	12,905	298,105.50	0.00

157	601698	中国卫通	9,800	296,450.00	0.00
158	000792	盐湖股份	9,800	295,862.00	0.00
159	688790	昂瑞微	2,319	293,237.55	0.00
160	600809	山西汾酒	2,680	293,111.60	0.00
161	002600	领益智造	16,700	289,578.00	0.00
162	601901	方正证券	39,501	284,407.20	0.00
163	600115	中国东航	74,500	283,845.00	0.00
164	000776	广发证券	12,100	283,140.00	0.00
165	600426	华鲁恒升	11,400	272,688.00	0.00
166	600048	保利发展	58,254	269,716.02	0.00
167	600233	圆通速递	17,000	267,750.00	0.00
168	688781	视涯科技	6,335	267,083.60	0.00
169	601998	中信银行	38,500	266,805.00	0.00
170	000425	徐工机械	32,900	266,161.00	0.00
171	002027	分众传媒	54,300	262,812.00	0.00
172	600029	南方航空	50,100	259,518.00	0.00
173	688808	联讯仪器	163	258,245.79	0.00
174	600104	上汽集团	26,338	257,058.88	0.00
175	601877	正泰电器	10,062	252,254.34	0.00
176	601689	拓普集团	4,470	252,197.40	0.00
177	601881	中国银河	19,900	250,143.00	0.00
178	601186	中国铁建	41,800	248,710.00	0.00
179	600795	国电电力	52,700	246,109.00	0.00
180	600482	中国动力	7,500	246,000.00	0.00
181	601788	光大证券	16,700	240,981.00	0.00
182	601117	中国化学	32,700	240,345.00	0.00
183	002179	中航光电	5,190	239,778.00	0.00
184	601825	沪农商行	31,000	232,190.00	0.00
185	601888	中国中免	4,300	230,953.00	0.00
186	601111	中国国航	38,000	229,900.00	0.00

187	600436	片仔癀	2,100	229,488.00	0.00
188	605499	东鹏饮料	1,854	228,839.22	0.00
189	600066	宇通客车	8,400	225,204.00	0.00
190	600219	南山铝业	56,300	224,637.00	0.00
191	600415	小商品城	21,900	222,504.00	0.00
192	600372	中航机载	19,999	216,989.15	0.00
193	002460	赣锋锂业	3,300	215,820.00	0.00
194	600026	中远海能	11,900	213,486.00	0.00
195	601878	浙商证券	22,200	210,900.00	0.00
196	002202	金风科技	8,800	210,320.00	0.00
197	600886	国投电力	15,500	206,305.00	0.00
198	600039	四川路桥	26,240	205,196.80	0.00
199	600196	复星医药	9,094	204,342.18	0.00
200	600011	华能国际	26,800	203,412.00	0.00
201	601319	中国人保	30,000	202,800.00	0.00
202	601021	春秋航空	4,400	200,552.00	0.00
203	688183	生益电子	1,500	198,600.00	0.00
204	000858	五粮液	2,600	192,400.00	0.00
205	002594	比亚迪	2,400	191,280.00	0.00
206	002837	英维克	2,400	190,944.00	0.00
207	002466	天齐锂业	3,100	190,092.00	0.00
208	300418	昆仑万维	4,700	189,692.00	0.00
209	600588	用友网络	20,532	188,483.76	0.00
210	603893	瑞芯微	1,000	188,360.00	0.00
211	600549	厦门钨业	2,200	187,440.00	0.00
212	601077	渝农商行	30,600	186,966.00	0.00
213	600845	宝信软件	10,892	181,133.96	0.00
214	001399	惠科股份	6,488	179,912.24	0.00
215	600188	兖矿能源	10,090	179,299.30	0.00
216	601800	中国交建	31,115	177,666.65	0.00

217	002236	大华股份	10,500	173,145.00	0.00
218	600674	川投能源	12,200	172,874.00	0.00
219	000657	中钨高新	1,800	172,296.00	0.00
220	688223	晶科能源	35,854	170,306.50	0.00
221	301269	华大九天	1,400	167,188.00	0.00
222	002625	光启技术	5,500	166,760.00	0.00
223	002558	巨人网络	6,000	165,360.00	0.00
224	300316	晶盛机电	2,700	163,080.00	0.00
225	000166	申万宏源	37,000	162,800.00	0.00
226	000408	藏格矿业	2,300	159,436.00	0.00
227	601618	中国中冶	65,200	159,088.00	0.00
228	300803	指南针	1,700	155,839.00	0.00
229	688047	龙芯中科	1,000	154,670.00	0.00
230	600918	中泰证券	28,100	149,492.00	0.00
231	600118	中国卫星	1,800	147,690.00	0.00
232	600741	华域汽车	9,500	147,440.00	0.00
233	600515	海南机场	53,800	147,412.00	0.00
234	600061	国投资本	22,208	145,462.40	0.00
235	601898	中煤能源	11,800	143,724.00	0.00
236	300450	先导智能	3,500	142,520.00	0.00
237	601727	上海电气	20,200	141,400.00	0.00
238	601127	赛力斯	2,300	140,875.00	0.00
239	000157	中联重科	20,200	140,794.00	0.00
240	603260	合盛硅业	2,900	139,954.00	0.00
241	000630	铜陵有色	21,900	139,284.00	0.00
242	601059	信达证券	8,600	139,234.00	0.00
243	000651	格力电器	3,700	138,750.00	0.00
244	601633	长城汽车	8,800	132,792.00	0.00
245	002714	牧原股份	3,700	129,463.00	0.00
246	600018	上港集团	27,400	129,328.00	0.00

247	000807	云铝股份	5,800	128,412.00	0.00
248	002074	国轩高科	4,500	123,795.00	0.00
249	301236	软通动力	2,900	123,105.00	0.00
250	600085	同仁堂	5,300	122,483.00	0.00
251	002736	国信证券	12,200	121,878.00	0.00
252	688818	电科蓝天	1,717	120,430.38	0.00
253	600023	浙能电力	22,300	117,298.00	0.00
254	000768	中航西飞	5,700	116,736.00	0.00
255	300628	亿联网络	3,360	113,635.20	0.00
256	002648	卫星化学	4,800	112,752.00	0.00
257	600221	海航控股	82,100	110,835.00	0.00
258	688303	大全能源	6,354	110,750.22	0.00
259	688472	阿特斯	10,004	108,243.28	0.00
260	300866	安克创新	1,000	104,500.00	0.00
261	600025	华能水电	11,700	104,013.00	0.00
262	688009	中国通号	21,576	102,701.76	0.00
263	601058	赛轮轮胎	8,900	102,617.00	0.00
264	603369	今世缘	4,300	101,953.00	0.00
265	600600	青岛啤酒	1,900	99,237.00	0.00
266	688797	臻宝科技	207	97,014.69	0.00
267	601607	上海医药	6,200	95,480.00	0.00
268	001979	招商蛇口	14,800	95,164.00	0.00
269	002493	荣盛石化	8,700	93,525.00	0.00
270	601456	国联民生	10,400	91,936.00	0.00
271	000301	东方盛虹	7,700	88,165.00	0.00
272	300498	温氏股份	6,800	83,776.00	0.00
273	600803	新奥股份	5,300	83,740.00	0.00
274	000002	万科 A	27,700	81,992.00	0.00
275	002050	三花智控	1,800	78,894.00	0.00
276	000975	山金国际	4,600	78,200.00	0.00

277	000568	泸州老窖	1,000	77,520.00	0.00
278	600027	华电国际	17,000	75,650.00	0.00
279	001965	招商公路	8,200	75,112.00	0.00
280	300251	光线传媒	6,700	74,303.00	0.00
281	601238	广汽集团	14,100	71,628.00	0.00
282	002532	天山铝业	6,600	70,818.00	0.00
283	000617	中油资本	10,400	68,536.00	0.00
284	300760	迈瑞医疗	500	67,915.00	0.00
285	603392	万泰生物	2,296	61,923.12	0.00
286	688506	百利天恒	200	58,806.00	0.00
287	300413	芒果超媒	4,000	58,520.00	0.00
288	302132	中航成飞	1,000	58,320.00	0.00
289	688712	北芯生命	1,500	53,880.00	0.00
290	688785	恒运昌	116	53,725.40	0.00
291	002304	洋河股份	1,400	53,410.00	0.00
292	601136	首创证券	3,700	51,615.00	0.00
293	002311	海大集团	1,100	49,071.00	0.00
294	301165	锐捷网络	600	48,270.00	0.00
295	002920	德赛西威	500	40,750.00	0.00
296	688813	泰金新能	234	40,269.06	0.00
297	688635	长进光子	128	39,448.32	0.00
298	601018	宁波港	12,500	39,375.00	0.00
299	002422	科伦药业	1,000	38,520.00	0.00
300	000538	云南白药	800	37,896.00	0.00
301	000708	中信特钢	3,000	37,860.00	0.00
302	002001	新和成	1,300	36,946.00	0.00
303	000895	双汇发展	1,500	33,600.00	0.00
304	000596	古井贡酒	400	31,920.00	0.00
305	300015	爱尔眼科	3,811	31,478.86	0.00
306	300832	新产业	700	29,400.00	0.00

307	000625	长安汽车	4,100	29,397.00	0.00
308	000999	华润三九	1,249	28,090.01	0.00
309	001391	国货航	6,886	28,026.02	0.00
310	603459	红板科技	330	27,825.60	0.00
311	001280	中国铀业	400	26,680.00	0.00
312	300896	爱美客	300	26,160.00	0.00
313	003816	中国广核	6,400	25,024.00	0.00
314	000963	华东医药	800	22,496.00	0.00
315	688811	有研复材	834	20,124.42	0.00
316	300999	金龙鱼	800	18,608.00	0.00
317	601112	振石股份	775	13,632.25	0.00
318	300122	智飞生物	969	11,327.61	0.00
319	688816	易思维	177	10,106.70	0.00
320	603407	长裕集团	137	10,064.02	0.00
321	920136	永励精密	300	5,784.00	0.00
322	001248	华润新能源	500	5,055.00	0.00
323	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
324	603352	至信股份	112	2,858.24	0.00
325	920193	吉和昌	300	2,556.00	0.00
326	603293	埃泰克	72	2,442.96	0.00
327	920189	康美特	200	1,628.00	0.00
328	603284	林平发展	46	1,604.02	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	300308	中际旭创	9,875,026.00	0.07
2	300750	宁德时代	8,712,391.00	0.06
3	300502	新易盛	5,308,117.00	0.04
4	601088	中国神华	2,862,662.00	0.02

5	601857	中国石油	2,338,298.00	0.02
6	688256	寒武纪	2,160,028.84	0.02
7	000333	美的集团	2,141,573.00	0.02
8	002475	立讯精密	2,108,359.00	0.02
9	300274	阳光电源	1,748,017.00	0.01
10	601225	陕西煤业	1,685,976.00	0.01
11	688041	海光信息	1,663,679.69	0.01
12	601138	工业富联	1,611,137.00	0.01
13	600900	长江电力	1,580,695.00	0.01
14	600938	中国海油	1,580,433.99	0.01
15	300394	天孚通信	1,551,804.00	0.01
16	688008	澜起科技	1,526,849.74	0.01
17	688981	中芯国际	1,514,728.35	0.01
18	600028	中国石化	1,471,381.00	0.01
19	603986	兆易创新	1,451,267.00	0.01
20	002594	比亚迪	1,447,768.00	0.01

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初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	300308	中际旭创	11,228,826.00	0.08
2	300750	宁德时代	10,644,338.00	0.08
3	300502	新易盛	6,448,920.00	0.05
4	601088	中国神华	4,649,400.00	0.03
5	601857	中国石油	3,711,744.00	0.03
6	601899	紫金矿业	2,866,391.00	0.02
7	601225	陕西煤业	2,851,621.00	0.02
8	000333	美的集团	2,620,490.60	0.02
9	600938	中国海油	2,570,107.00	0.02
10	688256	寒武纪	2,424,366.98	0.02

11	600028	中国石化	2,288,674.00	0.02
12	300274	阳光电源	2,144,526.00	0.02
13	002475	立讯精密	2,088,562.00	0.02
14	688820	盛合晶微	1,877,585.72	0.01
15	300394	天孚通信	1,814,297.00	0.01
16	601138	工业富联	1,675,362.00	0.01
17	603986	兆易创新	1,647,774.00	0.01
18	002594	比亚迪	1,639,636.00	0.01
19	688981	中芯国际	1,627,185.71	0.01
20	688041	海光信息	1,613,159.31	0.01

注：“卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 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	126,834,101.45
卖出股票收入（成交）总额	176,210,894.72

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	504,116,438.36	3.39
	其中：政策性金融债	504,116,438.36	3.39
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	504,116,438.36	3.39

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	260401	26 农发 01	5,000,000	504,116,438.36	3.39
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

本基金为指数型联接基金，主要投资于目标 ETF 基金份额、标的指数成份股和备选成份股。本基金根据基金合同规定投资股指期货旨在配合基金日常投资管理需要，更有效地进行流动性管理，以更好地跟踪标的指数，实现投资目标。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末无国债期货投资。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货投资。

7.12 本报告期投资基金情况

7.12.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有基金投资明细

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	华夏沪深 300ETF	股票型	交易型开放式	华夏基金管理有限公司	13,820,196,846.29	92.94

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，中国农业发展银行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。本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

7.13.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同约定的备选股票库。

7.13.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	14,411,203.59
2	应收清算款	21,703,444.48
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	13,589,981.04
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	49,704,629.11

7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	688795	摩尔线程	7,329,906.32	0.05	新发流通受限

7.13.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户	户均持有的	持有人结构
------	------	-------	-------

	数（户）	基金份额	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
华夏沪深 300ETF 联接 A	364,330	18,387.52	2,355,121,394.50	35.16%	4,344,003,283.64	64.84%
华夏沪深 300ETF 联接 C	75,900	15,562.81	560,938,055.80	47.49%	620,278,853.90	52.51%
华夏沪深 300ETF 联接 Y	11,282	4,957.70	-	-	55,932,777.59	100.00%
合计	451,512	17,577.11	2,916,059,450.30	36.74%	5,020,214,915.13	63.26%

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。

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	华夏沪深 300ETF 联接 A	2,195,958.97	0.03%
	华夏沪深 300ETF 联接 C	115,673.08	0.01%
	华夏沪深 300ETF 联接 Y	126,106.13	0.23%
	合计	2,437,738.18	0.03%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	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	华夏沪深 300ETF 联接 A	0
	华夏沪深 300ETF 联接 C	0
	华夏沪深 300ETF 联接 Y	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	华夏沪深 300ETF 联接 A	10~50
	华夏沪深 300ETF 联接 C	0
	华夏沪深 300ETF 联接 Y	0
	合计	10~50

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华夏沪深 300ETF 联接 A	华夏沪深 300ETF 联接 C	华夏沪深 300ETF 联接 Y
基金合同生效日（2009 年 7 月 10 日） 基金份额总额	24,771,957,170.09	-	-
本报告期期初基金份额总额	7,012,041,892.82	899,410,939.84	39,223,827.42
本报告期基金总申购份额	943,754,880.62	1,314,121,174.93	29,147,506.53
减：本报告期基金总赎回份额	1,256,672,095.30	1,032,315,205.07	12,438,556.36
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期期末基金份额总额	6,699,124,678.14	1,181,216,909.70	55,932,777.59

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期未发生影响基金管理人经营或公募基金运营业务的诉讼。

本报告期无涉及基金财产、无基金托管业务需要承担民事或刑事责任的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金所聘用的会计师事务所未发生改变。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人未受到调查或处罚。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人相关从业人员未受到调查或处罚。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内托管人无重大受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内托管人相关从业人员无重大受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国泰海通证券	1	158,952,857.59	52.83%	15,246.90	52.80%	-
国信证券	1	99,809,987.40	33.17%	9,572.24	33.15%	-
光大证券	1	41,360,808.26	13.75%	3,966.90	13.74%	-
中信证券	2	736,299.45	0.24%	92.03	0.32%	-

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

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

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

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

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

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

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

③证券公司专用交易单元选择程序：

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

ii 投资、研究部门根据上述标准进行评估并确定选用的证券公司。

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

④除本表列示外，本基金还选择了广发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本报告期内，本基金租用的券商交易单元未发生变更。

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	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
国泰海通证券	-	-	-	-	-	-	3,420,850,790.98	100.00%
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-

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	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-01-22
2	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-04-03
3	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-04-15
4	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-04-18
5	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-06-18
6	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-06-26

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金本报告期无需要披露的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、中国证监会核准基金募集的文件；
- 2、基金合同；

- 3、托管协议；
- 4、法律意见书；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照。

12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

12.3 查阅方式

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

华夏基金管理有限公司

二〇二六年八月三十一日