# 华夏中证科创创业 50 交易型开放式指数 证券投资基金 2025 年第 3 季度报告 2025 年 9 月 30 日

基金管理人: 华夏基金管理有限公司

基金托管人:中国银行股份有限公司

报告送出日期:二〇二五年十月二十八日

# §1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2025 年 10 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2025年7月1日起至9月30日止。

# §2 基金产品概况

基金简称	华夏中证科创创业 50ETF
场内简称	科创创业 50ETF
基金主代码	159783
交易代码	159783
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2021年6月24日
报告期末基金份额总 额	5,683,259,442.00 份
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	中证科创创业 50 指数收益率
风险收益特征	本基金为股票基金,其预期风险和预期收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金资产投资于科创板与创业板,会面临科创板与创业板机制下因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险,包括但不限于科创板与创业板上市公司股票价格波动较大的风险、流动性风险、退市风险等。
基金管理人	华夏基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司

# §3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期
土安州 分14 小	(2025年7月1日-2025年9月30日)
1.本期已实现收益	767,938,970.44
2.本期利润	2,439,588,273.30
3.加权平均基金份额	0.2525
本期利润	0.3535
4.期末基金资产净值	5,296,725,821.09
5.期末基金份额净值	0.9320

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。

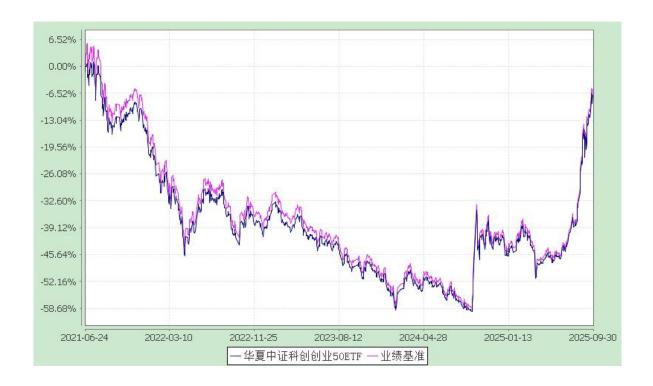
#### 3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长 率①	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	65.01%	2.21%	65.32%	2.22%	-0.31%	-0.01%
过去六个月	68.69%	2.01%	67.75%	2.02%	0.94%	-0.01%
过去一年	68.57%	2.36%	67.54%	2.37%	1.03%	-0.01%
过去三年	59.51%	1.86%	56.72%	1.86%	2.79%	0.00%
自基金合同 生效起至今	-6.80%	1.81%	-5.43%	1.83%	-1.37%	-0.02%

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

华夏中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金 累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图 (2021 年 6 月 24 日至 2025 年 9 月 30 日)



# §4 管理人报告

#### 4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
姓石		任职日期	离任日期	近分州业牛阪	VI 9月
徐猛	本基金 金 投 委 员	2021-06-24	-	22 年	硕士。曾任对 证券,原 会 是 是 是 是 是 是 是 是 是 是 是 是 是 是 是 是 是 是

通恒生式费量型开放设置。 是有数证基金经理(2015年3月12日至 2021年2月11日期间。年生交易显正,在一个工程,可以可以可以可以可以可以可以可以可以可以可以可以可以可以可以可以可以可以可以			 	
券投發理 (2015年3月12日至 2021年2月1日期间通 (2015年3月12日至 2021年2月1日期间通 (2015年3月12日至 2021年2月1日期通 (2015年3月12日至 2021年2日 1日期地 放式基金经理 (2015年3月12日 2021年2日期 (2017年2日期 (2017年2月8日)、			通恒生交易型	
金经理 (2015 年3月12日至 2021年2月1 日期通通生交易型证券经基金经 金经期开发接基金经基金经期间,上证金融对式证券及资基 金经3月12日至 2021年2月1 日明邮放式证基金是 2013年2月1 日期邮放式证基金是 (2013年2月1 日月9日期间交指数金基(2017年7月8月19日期间,交指数金基里(2017年12月8日月19日期间,大交易数金基理(2017年12月8日月19日期间,大战务数金是理(2018年7月13日19日期间,公司第一次,大战争数定发起基金是理(2018年7月13日19日期间,交易数定发起基金是经理(2018年7月13日19日期间,交易数定发起或人联接起之基集是是14日至2021年7月1日日期间,14日期间,14日期间,14日至2021年7月1日日日期间,14日至2021年7月1日日日日日日日日日日日日日日日日日日日日日日日日日日日日日日日日日日日			开放式指数证	
年3月12日至 2021年2月1日期间,外理生交易型证据开发基金级经理(2013年3月12日至 2021年2月1日期间,产产指数发送基金经经理(2013年2月1日期间,产产指外投资基金级经理(2013年4月月日日期间,产产指外投资基位。 1月19日期间,产生到少量,不是是一个企业,不是一个企业,不是一个一个一个企业,不是一个企业,不是一个企业,不是一个企业,不是一个企业,不是一个企业,不是一个企业,不是一个企业,不是一个企业,不是一个企业,不是一个企业,不是一个企业,不是一个企业,不是一个企业,不是一个企业,不是一个企业,不是一个一个企业,不是一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个			券投资基金基	
2021年2月1 日期间)、华夏 沙港理好人。 基金经月21年2月1 日期间、产了。 2021年2月1 日期间、产了。 2021年2月1 日期地放式。基金经理(2015年3月19年19日期地放式。基金经理(2013年2021年7月19日期间,交易数证基金年2013年2021年7月19日期间,放交指金经理(2017年12月8日月19日期间),从交通工产。 10年19日期间,从交通工产。 10年19日期间,大量工产。 10年19日间,大量工产。 10年19日间,工产。 10			金经理(2015	
日期通近大孩基金上空交易型开放投基金原理(2015年3月12日至2021年2月1日期地产产指数 医水子 数数 安			年 3 月 12 日至	
沪港亚东 经建位 2015年2015年2015年2015年2015年2015年2016年3月12日至2021年2月1日期			2021年2月1	
易型开放式指数证券基金经理(2015年3月12日至2021年2月1日明邮户产量的增加。 1日			日期间)、华夏	
数证券投资基金经理(2015年3月12日至2021年2月1日期础地产交易型开放式证金基金经理(2017年2月1日期础地产交易型开放式证券投资基金基金经理(2013年7月19日则间)、分易型证券投资基金基金生理(2017年2日期间)、战略型开放式指数重压金经理(2017年1月19日期间)、战略型开放式指数证券。投资基金基金经理(2018年7月13日至2021年7月19日期间)、水交易型开放式指数证券。投资基金基金经理公18年7月19日期间)、增量数据数据数据数据数据数据数据数据数据数据数据数据数据数据数据数据数据数据数据			沪港通恒生交	
金联接基金基金经理(2015年3月12日至2021年2月1日期间)、上证金融地产式指数设置。在3月12日期间)、上证金融地产式指数设置。在4月8日至2021年7月19日期间)、华夏型开放式指数金基金经理(2017年12月8日至2021年7月19日期间)、战略新兴成指数多数基基金经理(2018年7月13日至2021年7月19日期间)、华夏创业板交易型开发设置。在7月19日期间)、华夏创业板交易型开发设置。在7月19日期间)、华夏创业板交易型开发设置。在7月19日期间)、华夏创业板交易型开发设置。在7月19日期间)、华夏创业板交易型开发设置。在7月19日期间)、华夏创业板交易型开发设置。在7月19日期间)、华夏创业板交易型开发设置。在14日至2021年8月14日至2021			易型开放式指	
金经理(2015年3月12日至2021年2月1日期间)、上证金融地产交易型开放式指数投资基金经理(2017年2月19日期间)、多型开放式指数证券金经理(2017年7月19日期间)、多易型开放式指数证券投资基金基金经理(2017年12月8日至2021年7月19日期间)、战略新兴成指发多证基金经理(2018年7月19日期间)、华夏田期间)、华夏田期间)、华夏田期间)、华夏田期间)、华夏田期间)、华夏田期间)、华夏田期间)、华夏田期间)、华夏田期间)、华夏田期间)、华夏田期间)、华夏田市区2021年7月19日期间)、华夏田市区2021年7月19日期间)、华夏田市区2021年7月19日期间)、华夏田市区2021年7月19日期间)、华夏田市区2021年7月19日期间)、华夏田市区2021年7月19日期间)、华夏田市区2021年7月19日期间)、华夏田市区2021年7月19日期间)、华夏田市区2021年7月19日期间)、华夏田市区2021年7月19日期间)、华夏田市区2021年7月19日期间)、华夏田市区2021年7月19日期间)、华夏田市区2021年7月19日和1日下区2021年7日第1日下区2021年7日第1日下区2021年7日第1日下区2021年7日第1日下区2021年7日			数证券投资基	
年3月12日至2021年2月1日期间)、上证金融地产交易型开放式指数发起式证金经理(2013年4月8日至2021年7月19日期间)、华夏创业板交易型开放式指数证金经理(2017年12月8日至2021年7月19日期间)、战略型开放式指数证券投资基金基金经理(2018年7月19日期间)、战略型开放式指数证券投资基金基金经理(2018年7月19日期间)、华夏创业板交易业产为月13日至2021年7月19日期间)、华夏型并投资基金基金经理(2018年8月14日至2021年8月14日至2021年8月14日至2021			金联接基金基	
2021年2月1日期间)、上证金融地产交易型开放式证券投资基金基金经理(2013年4月8日至2021年7月19回业板交为型正券投资基金基金经理(2017年12月8日至2021年7月19日期间)、战略型开放式指数证券投资基金基金经理(2018年7月13日至2021年7月19日则则)、华夏型开放式指数证券投资基金基金经理(2018年7月19日则业板交为工作发现工作发现工作发现工作发现工作发现工作发现工作发现工作发现工作发现工作发现			金经理(2015	
日期间)、上证金融地产交易型开放式指数发起或基金经理(2013年4月8日至2021年7月19日期间)、华夏田期间)、华夏亚养发变进条金经理(2017年12月8日至2021年7月19日期间)、战略型开放式指数证券投资基金基金经理(2018年7月13日至2021年7月19日期间)、华易型开放式指数证券投资基金发起式指数证券投资基金发起式,以影型开放式指数证券投资基金发起式,以影型开放式指数证券投资基金发起式,以影型开放式指数证券投资基金发起式,以影型条数式,以影型条数式,以影型条数式,以影型系数,以通过。			年 3 月 12 日至	
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(2013年4月8日至2021年7月19日期间)、华夏创业板交易型开放式指数证券投资基金基金经理(2017年12月8日至2021年7月19日期间)、战略对开放式指数型进券投资基型企业2018年7月13日至2021年7月19日期间)、华夏创业板交易型开放式指数证券投资基金发理(2018年8月14日至2021年8月14日至2021			2021年2月1	
型开放式指数发起式证券投资基金基金经理(2013年4月8日至2021年7月19日期间)、华夏创业板交易型开放式指数证券投资基金基金经理(2017年12月8日至2021年7月19日期间)、战略型证券投资基金基金经理(2018年7月13日至2021年2021年2018年8月14日至2021			日期间)、上证	
发起式证券投资基金基金经理(2013年4月8日至2021年7月19日期间)、华夏创业板交易型开放式指数证券投资基金基金经理(2017年12月8日至2021年7月19日期间)、战略型开放式指数型进券投资基金基金经理(2018年7月13日至2021年7月19日期间)、华夏创业板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(2018年8月14日至2021			金融地产交易	
資基金基金经理(2013年4月8日至2021年7月19日期间)、华夏创业板交易型开放式指数证券投资基金基金经理(2017年12月8日至2021年7月19日期间)、战略到型开放式指数型进券投资基金基金经理(2018年7月13日至2021年7月19日期间)、华夏创业板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(2018年8月14日至2021			型开放式指数	
理(2013年4 月8日至2021 年7月19日期 间)、华夏创业 板交易型开放 式指数证券投资基金经 理(2017年12 月8日至2021 年7月19日期 间)、战略新兴 成指交易型开放 式指数证券 投资基金基金 经理(2018年7 月13日至2021 年7月19日期 间)、华夏创业 板交易型开放 式指数证券投资基金发起式 联接基金基金 经理(2018年8 月14日至2021			发起式证券投	
月8日至2021 年7月19日期间)、华夏创业 板交易型开放 式指数基金经理(2017年12 月8日至2021 年7月19日期间)、战略新兴 成指交易型开放式指数证券 投资基金基金 经理(2018年7 月13日至2021 年7月19日期间)、华夏创业 板交易型开放 式指数证券投资基金发起式 联接基金基金 经理(2018年8 月14日至2021			资基金基金经	
年7月19日期 间)、华夏创业 板交易型开放 式指数证券投资基金基金经理(2017年12 月8日至2021年7月19日期 间)、战略新兴 成指发易型开 放式指数证券 投资基金基金 经理(2018年7 月13日至2021年7月19日期 间)、华夏创业 板交易型开放 式指数证券投资基金发起式 联接基金基金 经理(2018年8 月14日至2021			理(2013年4	
间)、华夏创业板交易型开放式指数证券投资基金经理(2017年12月8日至2021年7月19日期间)、战略新兴成指交易型开放式指数证券投资基金基金经理(2018年7月13日至2021年7月19日期间)、华夏创业板交易型开放式指数证券投资基金发起式、群接基金基金经理(2018年8月14日至2021			月8日至2021	
板交易型开放 式指数证券投 资基金基金经 理(2017年12 月8日至2021年7月19日期间)、战略新兴 成指交易型开 放式指数证券 投资基金基金 经理(2018年7 月13日至2021年7月19日期间)、华夏创业 板交易型开放 式指数证券投 资基金发起式 联接基金基金 经理(2018年8 月14日至2021			年7月19日期	
式指数证券投资基金基金经理(2017年12月8日至2021年7月19日期间)、战略新兴成指交易型开放式指数证券投资基金基金经理(2018年7月13日至2021年7月19日期间)、华夏创业板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(2018年8月14日至2021			间)、华夏创业	
资基金基金经理(2017年12月8日至2021年7月19日期间)、战略新兴成指交易型开放式指数证券投资基金基金经理(2018年7月13日至2021年7月19日期间)、华夏创业板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(2018年8月14日至2021			板交易型开放	
理(2017年12 月8日至2021年7月19日期间)、战略新兴成指交易型开放式指数证券投资基金基金经理(2018年7月13日至2021年7月19日期间)、华夏创业板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(2018年8月14日至2021			式指数证券投	
月8日至2021 年7月19日期间)、战略新兴成指交易型开放式指数证券投资基金基金经理(2018年7月13日至2021年7月19日期间)、华夏创业板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(2018年8月14日至2021				
年7月19日期间)、战略新兴成指交易型开放式指数证券投资基金基金经理(2018年7月13日至2021年7月19日期间)、华夏创业板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(2018年8月14日至2021				
间)、战略新兴成指交易型开放式指数证券投资基金基金经理(2018年7月13日至2021年7月19日期间)、华夏创业板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(2018年8月14日至2021				
成指交易型开放式指数证券投资基金基金经理(2018年7月13日至2021年7月19日期间)、华夏创业板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(2018年8月14日至2021				
放式指数证券投资基金基金经理(2018年7月13日至2021年7月19日期间)、华夏创业板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(2018年8月14日至2021			*	
投资基金基金 经理(2018年7 月13日至2021 年7月19日期 间)、华夏创业 板交易型开放 式指数证券投 资基金发起式 联接基金基金 经理(2018年8 月14日至2021				
经理(2018年7月13日至2021年7月13日至2021年7月19日期间)、华夏创业板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(2018年8月14日至2021				
月13日至2021 年7月19日期 间)、华夏创业 板交易型开放 式指数证券投 资基金发起式 联接基金基金 经理(2018年8 月14日至2021				
年7月19日期 间)、华夏创业 板交易型开放 式指数证券投 资基金发起式 联接基金基金 经理(2018年8 月14日至2021				
间)、华夏创业 板交易型开放 式指数证券投 资基金发起式 联接基金基金 经理(2018 年 8 月 14 日至 2021				
板交易型开放 式指数证券投 资基金发起式 联接基金基金 经理(2018 年 8 月 14 日至 2021				
式指数证券投资基金发起式 联接基金基金 经理(2018 年 8 月 14 日至 2021			<i>'</i>	
资基金发起式 联接基金基金 经理(2018年8 月14日至2021				
联接基金基金 经理(2018 年 8 月 14 日至 2021				
经理(2018年8 月14日至2021				
月 14 日至 2021				
年7月19日期				
			年7月19日期	

		间)、战略新兴
		成指交易型开
		放式指数证券
		投资基金发起
		式联接基金基
		金经理(2019
		年6月5日至
		2021年7月19
		日期间)、华夏
		中小企业 100
		交易型开放式
		指数基金发起
		式联接基金基
		金经理(2018
		年 9 月 10 日至
		2021年9月10
		日期间)、中小
		企业 100 交易
		型开放式指数
		基金基金经理
		(2016年12月
		1日至2025年5
		月 21 日期间)
		等。

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

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

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

#### 4.3 公平交易专项说明

#### 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,本公司严格执行了《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 25 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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金跟踪的标的指数为中证科创创业 50 指数,中证科创创业 50 指数从科创板和创业 板中选取市值较大的 50 只新兴产业上市公司证券作为指数样本,以反映上述市场中代表性 新兴产业上市公司证券的整体表现。本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更 好地跟踪标的指数,实现基金投资目标。

3 季度,国际环境呈现复苏与分化并存的特征;关税政策重塑全球贸易体系的同时,美 联储货币政策转鸽成为关键变量,直接推动国际资本重返新兴市场。国内方面,政策发力更 趋精准,通过加码新基建投资、优化消费补贴政策、深化民营经济扶持等组合拳,持续激发 内生动力,宏观经济在外部扰动下仍保持韧性增长,就业市场总体稳定,产业结构升级步伐 加快。市场方面,市场整体在流动性宽松与政策预期驱动下震荡上行,但 8 月下旬后呈现明 显震荡整固特征。板块方面,结构性行情极致演绎,科技成长与周期资源成为双主线,通信、 电子、计算机、创新药等板块,受益于高科技企业全球竞争力提升与产业政策催化,股价表 现强劲;有色金属、化工板块则依托涨价逻辑与全球需求回暖实现估值修复。

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

为促进本基金的市场流动性和平稳运行,经深圳证券交易所同意,部分证券公司被确认 为本基金的流动性服务商。目前,本基金的流动性服务商包括东方证券股份有限公司、中信 建投证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、中国国际金融股份有限公司、华泰证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、方正证券股份有限公司、财通证券股份有限公司等。 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2025年9月30日,本基金份额净值为0.9320元,本报告期份额净值增长率为65.01%,

同期业绩比较基准增长率 65.32%。本基金本报告期跟踪偏离度为-0.31%,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 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

#### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	5,279,199,934.82	98.90
	其中: 股票	5,279,199,934.82	98.90
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中: 买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	58,372,952.28	1.09
8	其他资产	373,254.64	0.01
9	合计	5,337,946,141.74	100.00

注: 股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值。

- 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
- 5.2.1 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	-	_

В	采矿业	-	-
С	制造业	4,633,010,977.86	87.47
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,341,504.85	0.03
Е	建筑业	-	-
F	批发和零售业	21,698.39	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
Н	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	569,430,274.38	10.75
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	75,461,753.34	1.42
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
О	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	-	-
S	综合	-	-
	合计	5,279,266,208.82	99.67

#### 5.3 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

#### 5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	· 股票代码 股票名称 数	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净	
17. 分	放赤代码		数里(放)	公儿게徂(儿)	值比例(%)
1	300750	宁德时代	1,415,404	568,992,408.00	10.74
2	300502	新易盛	1,214,589	444,260,218.53	8.39
3	300308	中际旭创	1,088,200	439,284,576.00	8.29
4	688981	中芯国际	2,434,049	341,083,286.37	6.44
5	688256	寒武纪	255,858	339,011,850.00	6.40
6	300274	阳光电源	1,776,575	287,769,618.50	5.43
7	688041	海光信息	1,138,136	287,493,153.60	5.43
8	688008	澜起科技	1,401,391	216,935,326.80	4.10
9	300476	胜宏科技	739,126	211,020,473.00	3.98
10	300124	汇川技术	2,309,526	193,584,469.32	3.65

- 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合 本基金本报告期末未持有债券。
- 5.5 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债券投资明细本基金本报告期末未持有债券。
- 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。
- 5.7 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。
- 5.8 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权证投资明细本基金本报告期末未持有权证。
- 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
- 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细本基金本报告期末无股指期货投资。
- 5.9.2 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。
- 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
- 5.10.1 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。
- 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细本基金本报告期末无国债期货投资。
- 5.10.3 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。

- 5.11 投资组合报告附注
- 5.11.1 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。
- 5.11.2 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。
- 5.11.3 其他资产构成

字号 名称 金额(元)
-------------

1	存出保证金	321,521.42
2	应收证券清算款	51,733.22
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	373,254.64

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告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。

5.11.6 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。

# §6 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	7,895,859,442.00
报告期期间基金总申购份额	1,614,600,000.00
减:报告期期间基金总赎回份额	3,827,200,000.00
报告期期间基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	5,683,259,442.00

# §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

### §8 影响投资者决策的其他重要信息

#### 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资		报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金 情况	
者类别	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额 占比
华夏							
科创							
创业	1	2025-08-27至					
50E		2025-08-31,2025	1,103,128,30	373,166,91	215,546,44	1,260,748,77	22.18
TF		-09-02 至	5.00	2.00	6.00	1.00	%
发起		2025-09-30					
式联							
接							

产品特有风险

本基金在报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额20%的情形,在市场流动性不足的情况下,如遇投资者巨额赎回或集中赎回,基金管理人可能无法以合理的价格及时变现基金资产,有可能对基金净值产生一定的影响,甚至可能引发基金的流动性风险。

在特定情况下,若持有基金份额占比较高的投资者大量赎回本基金,可能导致在其赎回后本基金资产规模持续低于正常运作水平,面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。

#### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

#### 1、报告期内披露的主要事项

2025年7月11日发布华夏基金管理有限公司公告。

2025年7月11日发布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。

2025年8月6日发布华夏基金管理有限公司关于设立北京华夏金科信息服务有限公司的公告。

2025年9月25日发布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。

#### 2、其他相关信息

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。

## §9 备查文件目录

- 9.1 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。
- 9.2 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。

9.3 查阅方式

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

华夏基金管理有限公司

二〇二五年十月二十八日