# 华夏上证科创板 100 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:交通银行股份有限公司

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。

基金托管人交通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。

# ጷ 基金产品概况

基金简称	华夏上证科创板 100ETF
场内简称	科创 100C (扩位简称: 科创 100ETF 华夏)
基金主代码	588800
交易代码	588800
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2023年11月8日
报告期末基金份额总 额	2,067,377,000.00 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	上证科创板 100 指数收益率。
风险收益特征	本基金属于股票基金,其预期风险与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,会面临科创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	交通银行股份有限公司

# §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

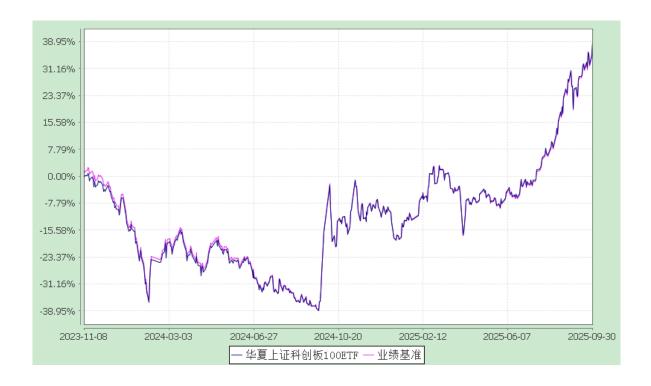
)	报告期
主要财务指标	(2025年7月1日-2025年9月30日)
1.本期已实现收益	753,578,787.57
2.本期利润	1,029,571,733.05
3.加权平均基金份额	0.2007
本期利润	0.3887
4.期末基金资产净值	2,870,267,595.97
5.期末基金份额净值	1.3884

- 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	40.58%	1.73%	40.60%	1.74%	-0.02%	-0.01%
过去六个月	44.58%	1.96%	44.22%	1.98%	0.36%	-0.02%
过去一年	65.46%	2.38%	64.46%	2.39%	1.00%	-0.01%
自基金合同 生效起至今	38.84%	2.36%	38.30%	2.37%	0.54%	-0.01%

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

华夏上证科创板 100 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 (2023 年 11 月 8 日至 2025 年 9 月 30 日)



# 84 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	3H HH	
姓石	<b>駅</b> 分	任职日期	离任日期	<b>业分外业牛</b> 胶	说明	
荣膺	本基金 金金 经 委员	2024-01-23	内(II I //I)	15 年	硕士。2010年7月加入华夏基金門和入华夏基金門在研究发展部分,数量投资部分,数量投资部理、基金型型,华夏州市、基金型型,华夏州市、基金型,华国州市、共和市、共和市、共和市、共和市、共和市、共和市、共和市、共和市、共和市、共和	

中国 A 股交易型开投投理(2016年) 6年的 6年的 6年的 6年的 6年的 6年的 6年的 7年的 7年的 7年的 7年的 7年的 7年的 7年的 7年的 7年的 7			
证券投理上2016年10月20日至2018年9月16日期间),MSCI中国A股交易型产货基金。每项方数量型产货基金。每项方数量量,10月20日至2018年9月16日期间,遗产转数发发基金。每项产量,2018年9月16日期间,遗产的数量型产量,2018年9月16日期间,遗产的数量型产量,2018年9月16日期间,企业是15年1月6日里至2010年3月18日期间),企业是15年2020年3月18日期间),企业是15年2020年5月18日期间),企业是15年2020年5月18日至2020年5月18日至2020年5月18日至2020年5月18日至2020年5月17日至1日间),企业是15年2020年10月21日间),全国是15年2020年5月17日至1日间),全国是15年2020年5月17日至1日间),全国是15年2020年5月17日至1日间),全国是15年2020年5月17日至1日间),全国是15年2020年5月17日至1日间),全国是15年2020年5月17日至1日间),全国是15年2020年5月17日至1日间),全国是15年2020年5月17日至1日间),全国是15年2020年5月17日至1日间),全国是15年2020年5月17日,10月21日间),全国是15年2020年5月17日,10月21			中国 A 股交易
基金经理(2016年10月20日至2018年9月16日期間)、MSCI中国A股交易型开放式资基金。 经理(2016日至2018年9月16日期期间)、上证主要对式证券基金经理(2016年10月20日至2018年9月16日日期期前,大正主要对批式证券经经理(2015年11月6日月2020年3月18日期间,体及发起金经理(2015年11月18日期间,以及武证基金经理(2018年3月18日期间,以为数证券金经理(2018年9月17日至2021年10月21日期间)、华及股国环放发基金经理(2018年9月17日至2021年10月21日期间)、华及股国际通交易数证联接。 基金经理			型开放式指数
年10月20日至2018年9月16日期间、MSCI中国 A 股交易型开放式资基金联接重全经理(2016年10月20日日10月20日期间),数交指数处基金经理(2016年10月20日期间),当时,20日间,10月20日期间,10年2020年3月6日月18日日期间,10年2020年3月6日至2020年3月7日至10日期间间,4年80日期间间,4年80日期间间,4年80日期间间,4年80日期间间,4年80日期间间,4年80日期间间,4年80日期间,4年80日期间,4年80日期间,4年80日期间,4年80日期间,4年80日期间,4年80日期间,4年80日期间,4年80日期间,4日月21日,4日月21日,4日日,4日日,4日月21日,4日月21日,4日月21日,4日日,4日月21			证券投资基金
2018年9月16 日期间)、MSCI 中国			基金经理(2016
日期同)、MSCI中国 A 股交易型开放式指数证券投资基基金经经 2016 年 10 月 20 日 至 2018 年 9 月 16 日明期消放式证券投资基金经理(2015 年 11 月 6 日 日期间消放式证券投资基金基金经理(2015 年 11 月 6 日 日 1 月 1 日 日期间的体放起基金经理(2018 年 3 月 6 日 月 18 日期间的体放起基本会经理(2018 年 3 月 6 日 月 18 日期间的,华夏 MSCI中国 A 股型开放式指金基本 9 月 17 日 2 日 1 日 1 日 1 日 1 日 1 日 1 日 1 日 1 日 1			年10月20日至
中国 A 股交易型开放设基金。经理(2016年10月20日至2018年9月16日明期,为交易型型起武金基等处理。2018年9月16日明期,为或证基金经理(2015年11月6日至2020年3月18日期间),位成起基生企经理(2018年3月6日至2020年3月18日明前,外夏 MSCI中国 A 股 四			2018年9月16
型开放改基金 联接基金 经理(2016年 10月20日至 2018年9月16日期间,为上证主要形成式证券投资基金包理(2015年11月6日至 2020年3月18日期间),华夏智胜人庭起金是理(2018年3月18日期间),华夏智胜、企业基金经理(2018年3月18日期间),华夏MSCI中国全别进入企业,是有11日期间,4年夏州区,2018年9月17日至2021年10月21日期间,4年夏州区,4年夏日,4年夏日,4年夏日,1年夏日,4年夏日,4年夏日,4年夏日,4年夏日,4年夏日,1年夏日,1年夏日,4年夏日,4年夏日,4年夏日			日期间)、MSCI
证券投资基金 联接基金 经理(2016 年 10 月 20 日至 2018 年 9 月 16 日期 門)、			中国 A 股交易
联接基金基金经理(2016年10月20日至2018年9月16日期间)、上证主要消放式游费数型开放式证券投资基金基金经理(2015年11月6日至2020年3月18日期间)、华夏智职型发资基金基金经理(2018年3月6日至2020年3月18日期间)、华夏MSCI中国A股型所放式指数型形势投资基金基金经理(2018年9月17日至2021年10月21日期间)、华夏MSCI中国A股型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理统算量。			型开放式指数
经理 (2016 年 10 月 20 日至 2018 年 9 月 16 日期间)、上证主要消费交易型开放式证券投资基金经理(2015 年 11 月 6 日至 2020 年 3 月 18 日期间)、华夏 M宏记 证券投资基金基金经理(2018 年 3 月 6 日至 2020 年 3 月 6 日至 2020 年 3 月 8 日期间)、华夏 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金经理(2018 年 9 月 17 日至 2021 年 10 月 21 日期间)、华夏 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金经理(2018 年 9 月 17 日至 2021 年 10 月 21 日期间)、华夏 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理			证券投资基金
10 月 20 日至 2018 年 9 月 16 日期间)、上证主要消费交易型开放式指数发起或证基金经理(2015 年 11 月 6 日至 2020年 3 月 18 日期间)、华夏股武证券投资基金基金经理(2018 年 3 月 18 日期间)、华夏 MSCI中国 A 股国际通交易型开放式指数基基金经理(2018 年 9 月 17 日至 2021年 10 月 21 日期间)、华夏 MSCI中国 A 股国际通交易型评分或指数证券投资基金经理(2018 年 9 月 17 日至 2021年 10 月 21 日期间)、华夏 MSCI中国 A 股国际通交易型评分或指数证券投资基金联接基金基金经理			联接基金基金
2018 年 9 月 16 日期间)、上证主要消费交易型开放式证券投资基金基金经理(2015 年 11 月 6 日至 2020 年 3 月 18 日割 间)、华夏 股股票型处资基金基金经理(2018 年 3 月 6 日至 2020 年 3 月 18 日期间)、华夏 MSCI中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金经理(2018 年 9 月 17 日至 2021 年 10 月 21 日期间)、华夏 MSCI中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金经理(2018 年 9 月 17 日至 2021 年 10 月 21 日期间)、华夏 MSCI中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理			经理(2016 年
日期间)、上证主要消费交易型开放式指数发起或基金经理(2015年11月6日至2020年3月18日期间)、华夏程票型投资基金基金经理(2018年3月6日至2020年3月18日期间)、华夏MSCI中国A股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金经理(2018年9月17日至2021年10月21日期间)、华夏MSCI中国A股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金经理(2018年9月17日至2021年10月21日期间)、华夏MSCI中国A股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理			10 月 20 日至
主要消费交易型开放式指数发起或基金经理(2015年11月6日至2020年3月18日期间)、华夏胜价值成长证券投资基金基金经理(2018年3月6日至2020年3月18日期间)、华夏MSCI中国A股国际通交易型开放式指数证券企经理(2018年9月17日至2021年10月21日期间)、华夏MSCI中国A股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理(2018年9月17日至2021年10月21日期间)、华夏MSCI中国A股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理			2018年9月16
型开放式指数 发起或基金经理(2015年11 月6日至2020年3月18日期间)、华夏胜价值成长股票型发起式证券 投资基金基金 经理(2018年3 月6日至2020年3月18日期间)、华夏MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数延券金经理(2018年9月17日至2021年10月21日期间)、华夏MSCI中国 A 股国际通交易型开放式指数证券安全理(2018年9月17日至2021年10月21日期间)、华夏MSCI中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理			日期间)、上证
发起式证券投资基金基金经理(2015年11月6日至2020年3月18日期间)、华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金基金经理(2018年3月6日至2020年3月18日期间)、华夏MSCI中国A股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金经理(2018年9月17日至2021年10月21日期间)、华夏MSCI中国A股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理			主要消费交易
资基金基金经理(2015年11月6日至2020年3月18日期间)、华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金基金经理(2018年3月6日至2020年3月18日期间)、华夏MSCI中国A股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金经理(2018年9月17日至2021年10月21日期间)、华夏MSCI中国A股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理			型开放式指数
理 (2015 年 11 月 6 日至 2020 年 3 月 18 日期间)、华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金基金经理(2018 年 3 月 6 日至 2020 年 3 月 18 日期间)、华夏 MSCI中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金经理(2018 年 9 月 17 日至 2021 年 10 月 21 日期间)、华夏 MSCI中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理			发起式证券投
月6日至2020年3月18日期间)、华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金基金经理(2018年3月6日至2020年3月18日期间)、华夏MSCI中国A股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金经理(2018年9月17日至2021年10月21日期间)、华夏MSCI中国A股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理			资基金基金经
年3月18日期间)、华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金基金经理(2018年3月6日至2020年3月18日期间)、华夏MSCI中国A股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金经理(2018年9月17日至2021年10月21日期间)、华夏MSCI中国A股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理			理(2015年11
间)、华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金基金经理(2018年3月6日至2020年3月18日期间)、华夏MSCI中国A股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金经理(2018年9月17日至2021年10月21日期间)、华夏MSCI中国A股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理			月 6 日至 2020
价值成长股票型发起式证券投资基金基金经理(2018年3月6日至2020年3月18日期间)、华夏MSCI中国A股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金经理(2018年9月17日至2021年10月21日期间)、华夏MSCI中国A股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理			年 3 月 18 日期
型发起式证券 投资基金基金 经理(2018年3 月6日至2020年3月18日期间)、华夏MSCI中国A股国际 通交易型开放 式指数证券投 资基金基金经 理(2018年9 月17日至2021年10月21日期间)、华夏MSCI中国A股国际 通交易型开放 式指数证券投 资基金联接基 金基金经理			间)、华夏智胜
投资基金基金 经理(2018年3 月6日至2020年3月18日期间)、华夏 MSCI中国 A 股国际 通交易型开放 式指数证券投资基金基金经 理(2018年9月17日至2021年10月21日期间)、华夏 MSCI中国 A 股国际 通交易型开放 式指数证券投资基金联接基 金基金经 理			
经理(2018年3 月6日至2020年3月18日期间)、华夏MSCI中国A股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金经理(2018年9月17日至2021年10月21日期间)、华夏MSCI中国A股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理			型发起式证券
月6日至2020年3月18日期间)、华夏MSCI中国A股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金经理(2018年9月17日至2021年10月21日期间)、华夏MSCI中国A股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理			投资基金基金
年3月18日期间)、华夏MSCI中国A股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金经理(2018年9月17日至2021年10月21日期间)、华夏MSCI中国A股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理			经理(2018年3
间)、华夏 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金经理(2018年9月17日至2021年10月21日期间)、华夏 MSCI中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理			
中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金经理(2018年9月17日至2021年10月21日期间)、华夏 MSCI中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金 基 金 经 理			
通交易型开放 式指数证券投 资基金基金经 理(2018年9 月17日至2021 年10月21日期 间)、华夏 MSCI 中国 A 股国际 通交易型开放 式指数证券投 资基金联接基 金基金经理			· ·
式指数证券投资基金基金经理(2018年9月17日至2021年10月21日期间)、华夏 MSCI中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金 基 金 经 理			
资基金基金经理(2018年9月17日至2021年10月21日期间)、华夏 MSCI中国A股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理			
理(2018年9月17日至2021年10月21日期间)、华夏 MSCI中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理			
月17日至2021 年10月21日期 间)、华夏 MSCI 中国 A 股国际 通交易型开放 式指数证券投 资基金联接基 金 基 金 经 理			
年10月21日期 间)、华夏 MSCI 中国 A 股国际 通交易型开放 式指数证券投 资基金联接基 金 基 金 经 理			
间)、华夏 MSCI 中国 A 股国际 通交易型开放 式指数证券投 资基金联接基 金 基 金 经 理			
中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金 基 金 经 理			
通交易型开放 式指数证券投资基金联接基金 基金 经理			*
式指数证券投 资基金联接基 金 基 金 经 理			
资基金联接基   金基金经理			
金基金经理			
(2018 年 9 月			
			(2018年9月

		17日至2021年
		10 月 21 日期
		间)、华夏创业
		板低波价值交
		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
		26 日至 2021 年
		10 月 21 日期
		间)、华夏沪港
		通上证 50AH
		优选指数证券
		投资基金
		(LOF)基金经
		理(2016年10
		月27日至2022
		年 8 月 22 日期
		间)、华夏创业
		板动量成长交
		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
		26 日至 2022 年
		8月22日期
		间)、华夏饲料
		豆粕期货交易
		型开放式证券
		投资基金发起
		式联接基金基
		金经理(2020
		年1月13日至
		2022年8月22
		日期间)、华夏
		粤港澳大湾区
		创新 100 交易
		型开放式指数
		证券投资基金
		基金经理(2020
		年2月25日至
		2022年8月22

		日期间)、华夏
		粤港澳大湾区
		创新 100 交易
		型开放式指数
		证券投资基金
		发起式联接基
		金基金经理
		(2020年4月
		29日至2022年
		8月22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。

③荣膺女士目前已返岗,李俊先生不再代为履行其基金经理相关职责。

#### 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上证科创板 100 指数,上证科创板 100 指数从上海证券交易所科创板中选取市值中等且流动性较好的 100 只证券作为样本,反映科创板市场中等市值规模上市公司证券的整体表现。本基金主要采取完全复制法,即按照标的指数成份股及其权重构建基金的股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动对股票投资组合进行相应地调整,以实现基金的投资目标。

3 季度,国内经济运行整体平稳,反内卷带来价格回升拉动企业信心,九三阅兵展示先进武器装备提示需重新评估我国军事科技实力,提振人民币资产的信心。美联储如期降息 25bp,中美贸易谈判呈现持续缓和状态。

市场方面,人民币兑美元呈现循序小幅升值趋势。由于权益资产走强和票息过低,国内债券大幅回调。A 股则确定性进入牛市状态。人工智能产业趋势景气度持续,其发展态势不仅仅拘泥于影响产业本身,更成为左右国内外权益资产价格变动的宏观因子。市场热点围绕海外算力、国产算力、固态电池、创新药等成长方向。受益于 A 股贝塔和美联储降息,港股呈现稳定上升趋势。中期看,反内卷政策也有利于梳理部分产能过剩行业的供需关系,更有助于行情全面展开。

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、赎回及成份股调整等工作。

为促进本基金的市场流动性提高和平稳运行,经上海证券交易所同意,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财通证券股份有限公司、东方证券股份有限公司、方正证券股份有限公司、国泰海通证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、华安证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、申万宏源证券有限公司、招商证券股份有限公司、中国国际金融股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、长江证券股份有限公司、东海证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、兴业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1.3884元,本报告期份额净值增长率为40.58%, 同期业绩比较基准增长率40.60%。本基金本报告期跟踪偏离度为-0.02%,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	2,840,859,187.16	98.92
	其中: 股票	2,840,859,187.16	98.92
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1	-
	其中:债券	1	-
	资产支持证券	1	-
4	贵金属投资	1	-
5	金融衍生品投资	1	1
6	买入返售金融资产	1	-
	其中: 买断式回购的买入返售金融资产	-	ı
7	银行存款和结算备付金合计	27,093,733.78	0.94
8	其他资产	3,795,249.19	0.13
9	合计	2,871,748,170.13	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	2,295,230,032.52	79.97

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,341,504.85	0.05
Е	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
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	520,623,540.08	18.14
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	23,663,754.30	0.82
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	2,840,858,831.75	98.98

#### 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	序号 股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净
					值比例(%)
1	688347	华虹公司	941,247	107,829,256.32	3.76
2	688235	百济神州	265,759	81,561,437.10	2.84
3	688110	东芯股份	715,183	76,453,062.70	2.66
4	688002	睿创微纳	841,695	74,439,505.80	2.59
5	688220	翱捷科技	578,995	63,978,947.50	2.23
6	688019	安集科技	271,645	62,054,583.80	2.16
7	688361	中科飞测	517,149	60,004,798.47	2.09
8	688498	源杰科技	138,278	59,321,262.00	2.07
9	688037	芯源微	371,921	55,416,229.00	1.93
10	688027	国盾量子	141,830	49,782,330.00	1.73

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

代码	名称	持仓量	合约市值 (元)	公允价值 变动(元)	风险说明
IM2512	中证 1000 股 指期货 IM2512 合约	16	23,706,880.00	649,031.11	买入股指期货 合约的目的是 进行更有效地 流动性管理,实 现投资目标。
IM2511	中证 1000 股 指期货 IM2511 合约	2	2,993,680.00	74,760.00	买入股指期货 合约的目的是 进行更有效地 流动性管理,实 现投资目标。
公允价值变动	723,791.11				
股指期货投资	6,689,081.63				
股指期货投资	本期公允价值变	(元)			-593,848.89

#### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金为指数型基金,主要投资标的为指数成份股和备选成份股。基金留存的现金头寸根据基金合同规定,投资于以标的指数或与标的指数相关性较高的其他指数为基础资产的股指期货,旨在配合基金日常投资管理需要,更有效地进行流动性管理,以更好地跟踪标的指数,实现投资目标。

- 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

序号	名称	金额 (元)
1	存出保证金	3,261,653.64
2	应收证券清算款	533,595.55
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	3,795,249.19

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。

# % 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	3,399,877,000.00		
报告期期间基金总申购份额	3,800,000,000.00		
减:报告期期间基金总赎回份额	5,132,500,000.00		
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	2,067,377,000.00		

## **約** 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。

### **88** 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 者类 别		报告期口	报告期末持有基金 情况				
	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
机构	1	2025-07-01 至 2025-07-09,2025- 08-27 至 2025-09-30	752,782,93 1.00	136,565,30	409,718,93 7.00	479,629,29 4.00	23.20 %
华 夏 创 100E TF 接	1	2025-07-15 至 2025-07-16,2025- 07-18 至 2025-08-18,2025- 08-22 至 2025-08-27,2025- 08-29 至 2025-09-30	595,908,10 0.00	106,200,00	262,940,00 0.00	439,168,10 0.00	21.24

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。

#### 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。

# **89** 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