

**华夏沪深 300 交易型开放式指数  
证券投资基金联接基金  
2023 年中期报告  
2023 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

报告送出日期：二〇二三年八月三十日

## §1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 8 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	1
§2 基金简介.....	3
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	4
3.1 主要会计数据和财务指标.....	4
3.2 基金净值表现.....	5
§4 管理人报告.....	7
§5 托管人报告.....	14
§6 中期报告财务会计报告（未经审计）.....	14
6.1 资产负债表.....	15
6.2 利润表.....	16
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	17
6.4 报表附注.....	18
§7 投资组合报告.....	44
7.1 期末基金资产组合情况.....	44
7.3 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	45
7.4 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.....	45
7.5 报告期内股票投资组合的重大变动.....	54
7.6 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	55
7.7 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.....	56
7.8 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.....	56
7.9 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.....	56
7.10 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.....	56
7.11 本基金投资股指期货的投资政策.....	56
7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	56
7.13 投资组合报告附注.....	56
§8 基金份额持有人信息.....	57
§9 开放式基金份额变动.....	58
§10 重大事件揭示.....	58
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	61
§12 备查文件目录.....	61

## §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	7,323,413,714.16 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
下属分级基金的交易代码	000051	005658
报告期末下属分级基金的份额总额	6,647,143,961.39 份	676,269,752.77 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×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

	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		北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座8层	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码		100033	100140
法定代表人		杨明辉	陈四清

### 2.5 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》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.ChinaAMC.com
基金中期报告备置地点	基金管理人和/或基金托管人的住所/办公地址

### 2.6 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	北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 8 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（2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日）	
	华夏沪深 300ETF 联接 A	华夏沪深 300ETF 联接 C
本期已实现收益	174,292,820.96	26,857,979.72
本期利润	14,012,541.79	-16,807,114.17

加权平均基金份额本期利润	0.0021	-0.0213
本期加权平均净值利润率	0.15%	-1.53%
本期基金份额净值增长率	0.24%	0.09%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)	
	华夏沪深 300ETF 联接 A	华夏沪深 300ETF 联接 C
期末可供分配利润	2,451,541,287.89	233,948,081.44
期末可供分配基金份额利润	0.3688	0.3459
期末基金资产净值	9,098,685,249.28	910,217,834.21
期末基金份额净值	1.3688	1.3459
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)	
	华夏沪深 300ETF 联接 A	华夏沪深 300ETF 联接 C
基金份额累计净值增长率	36.88%	-2.05%

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。

### 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
过去一个月	2.00%	0.82%	1.18%	0.83%	0.82%	-0.01%
过去三个月	-3.86%	0.79%	-4.64%	0.79%	0.78%	0.00%
过去六个月	0.24%	0.80%	-0.22%	0.80%	0.46%	0.00%
过去一年	-11.91%	0.94%	-12.61%	0.94%	0.70%	0.00%
过去三年	-2.39%	1.14%	-4.34%	1.14%	1.95%	0.00%
自基金合同生效起至今	36.88%	1.34%	26.45%	1.36%	10.43%	-0.02%

##### 华夏沪深 300ETF 联接 C

阶段	份额净值增	份额净值增	业绩比较基	业绩比较基	①-③	②-④
----	-------	-------	-------	-------	-----	-----

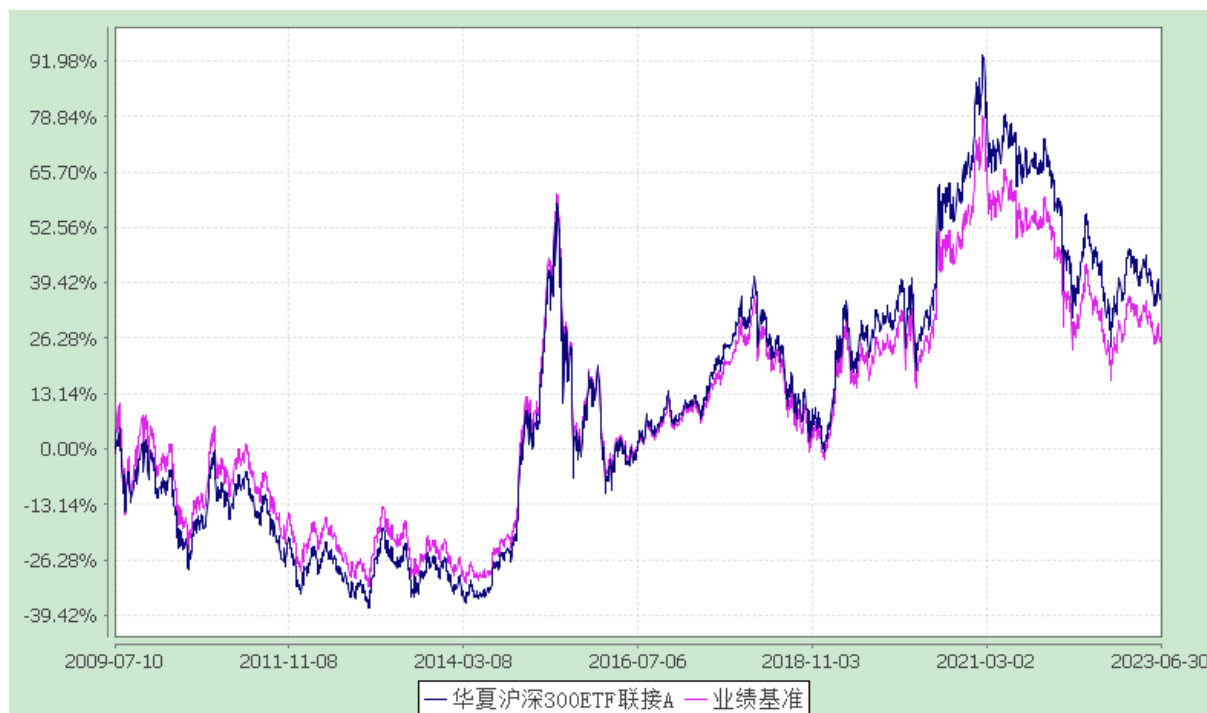
	长率①	长率标准差 ②	准收益率③	准收益率标 准差④		
过去一个月	1.98%	0.82%	1.18%	0.83%	0.80%	-0.01%
过去三个月	-3.93%	0.79%	-4.64%	0.79%	0.71%	0.00%
过去六个月	0.09%	0.80%	-0.22%	0.80%	0.31%	0.00%
过去一年	-12.18%	0.94%	-12.61%	0.94%	0.43%	0.00%
过去三年	-3.26%	1.14%	-4.34%	1.14%	1.08%	0.00%
自新增份额类 别以来至今	-2.05%	1.21%	-4.13%	1.21%	2.08%	0.00%

注：本基金自 2018 年 2 月 2 日增加 C 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 2023 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。

## §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、沈阳设有分公司，在香港、深圳、上海设有子公司。公司是首批全国社保基金管理人、首批企业年金基金管理人、境内首批 QDII 基金管理人、境内首只 ETF 基金管理人、境内首只沪港通 ETF 基金管理人、首批内地与香港基金互认基金管理人、首批基本养老保险基金投资管理人资格、首家加入联合国责任投资原则组织的公募基金公司、首批公募 FOF 基金管理人、首批公募养老目标基金管理人、首批个人养老金基金管理人、境内首批中日互通 ETF 基金管理人、首批商品期货 ETF 基金管理人、首批公募 MOM 基金管理人、首批纳入互联互通 ETF 基金管理人、首批北交所主题基金管理人以及特定客户资产管理人、保险资金投资管理人、公募 REITs 管理人，国内首家承诺“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，形成了覆盖大盘蓝筹、宽基指数、中小创指数、主题指数、行业指数、SmartBeta 策略、海外市场指数、信用债指数、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 2023 年 6 月 30 日，华夏基金旗下多只产品近 1 年同类排名领先（基金排名不作为产品未来表现的保证），其中：

主动权益产品：在养老目标风险 FOF(权益资产 0-30%)(A 类)中，华夏保守养老一年持有混合 (FOF) (A 类)排名第 1/59；在对冲策略绝对收益目标基金(A 类)中，华夏安泰对冲策略 3 个月定开混合排名第 1/22；在汽车主题行业偏股型基金(A 类)中，华夏新能源车龙头混合发起式(A 类)排名第 1/11；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 2/10；在消费行业偏股型基金(A 类)中，华夏网购精选混合(A 类)排名第 2/66、华夏新兴消费混合(A 类)排名第 9/66；在 QDII 混合基金(A 类)中，华夏全球科技先锋混合 (QDII) 排名第 3/43；在偏债型基金(A 类)中，华夏磐泰混合 (LOF) (A 类)排名前 2%(13/619)、华夏睿磐泰盛混合排名前 3%(19/619)、华夏永利一年持有混合(A 类)排名前 10%(61/619)；在灵活配置型基金(基准股票比例 30%-60%)(A 类)中，华夏稳增混合排名前 3%(14/440)、华夏新锦绣混合(A 类)排名前 4%(18/440)；在标准股票型基金(A 类)中，华夏智胜先锋股票 (LOF) (A 类)排名前 4%(13/317)、华夏智胜价值成长股票(A 类)排名前 6%(20/317)；在偏股型基金(股票上限 95%)(A 类)中，华夏磐利一年定开混合(A 类)排名前 5%(11/214)、华夏磐锐一年定开混合(A 类)排名前 10%(21/214)；在偏股型基金(股票上下限 60%-95%)(A 类)中，华夏核心制造混合(A 类)排名前 9%(126/1403)、华夏价值精选混合排名前 9%(133/1403)。

固收与固收+产品：在 QDII 债券型基金(A 类)中，华夏大中华信用债券 (QDII) (A 类)排名第 1/24、华夏收益债券 (QDII) (A 类)排名第 3/24；在短期纯债债券型基金(A 类)中，华夏 30 天滚动短债债券发起式(A 类)排名第 8/108；在长期纯债债券型基金(A 类)中，华夏鼎隆债券(A 类)排名前 6%(71/1228)、华夏鼎航债券(A 类)排名前 6%(76/1228)、华夏鼎英债券(A 类)排名前 7%(87/1228)；在普通债券型基金(可投转债)(A 类)中，华夏鼎禄三个月定开债券(A 类)排名前 9%(32/376)；在普通债券型基金(二级)(A 类)中，华夏恒融债券排名前 8%(30/368)。

指数与量化产品：在增强规模指数股票型基金(A 类)中，华夏中证 500 指数增强(A 类)排名第 1/132、华夏中证 500 指数智选增强(A 类)排名第 2/132；在主题指数股票 ETF 联接基金(A 类)中，华夏中证动漫游戏 ETF 发起式联接(A 类)排名第 1/110；在信用债指数债券型基金(A 类)中，华夏亚债中国指数(A 类)排名第 2/16；在 QDII 跨境股票 ETF 基金中，华夏纳斯达克 100ETF (QDII) 排名第 2/33、华夏野村日经 225ETF 排名第 7/33；在 QDII 跨境股票 ETF 联接基金(A 类)中，华夏恒生 ETF 联接(A 类)排名第 3/10；在主题指数股票 ETF 基金中，华夏中证动漫游戏 ETF 排名第 1/313、华夏中证云计

算与大数据主题 ETF 排名第 6/313、华夏中证大数据产业 ETF 排名前 5%(15/313)、华夏中证文化传媒 ETF 排名前 6%(18/313)、华夏中证金融科技主题 ETF 排名前 10%(30/313)；在规模指数股票 ETF 基金中，华夏沪港通恒生 ETF 排名第 4/136；在规模指数股票 ETF 联接基金(A 类)中，华夏沪港通恒生 ETF 联接(A 类)排名第 4/102；在行业指数股票 ETF 联接基金(A 类)中，华夏中证银行 ETF 联接(A 类)排名第 6/30。

在《中国证券报》第十九届中国基金业金牛奖评选中，华夏基金荣获“被动投资金牛基金公司”，成为业内连续 7 年获此殊荣的基金公司。在证券时报主办的第十八届中国基金业明星基金奖评选活动中，华夏基金凭借卓越的投资实力以及优秀的中长期业绩回报，将两大奖项收入囊中：公司层面，华夏基金荣获“三年期海外投资明星基金公司”；产品层面，华夏沪深 300ETF 荣获“三年持续回报指数型明星基金奖”。在《上海证券报》主办的第十九届“金基金”奖评选活动中，华夏基金将三大基金奖项收入囊中：公司层面，华夏基金荣获“金基金 被动投资基金管理公司奖”；产品层面，华夏能源革新股票荣获“金基金 投资回报基金奖”，华夏沪深 300ETF 荣获“金基金 指数基金三年期奖”。

在客户服务方面，2023 年上半年，华夏基金继续以客户需求为导向，努力提高客户使用的便利性和服务体验：（1）华夏基金直销渠道优化页面显示，升级搜索及查询功能，给客户更方便直观的使用体验；（2）华夏基金管家客户端优化“忘记密码”功能及定投模块，从客户投资需求出发，进一步提升操作体验；（3）与华润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“帮你问了 ChatGPT”、“华夏基金户口本”、“指数攻防值来啦！”、“亲子财商 36 计”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		
赵宗庭	本基金的 基金经理	2017-04-17	-	15 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）、华夏中证四川国企改革交易型开

					<p>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)等。</p>
张弘弢	本基金的基金经理、投委会成员	2009-07-10	-	23 年	<p>硕士。2000年4月加入华夏基金管理有限公司。历任研究发展部总经理、数量投资部副总经理、上证能源交易型开放式指数发起式证券投资基金基金经理(2013年3月28日至2016年3月28日期间)、恒生交易型开放式指数证券投资基金基金经理(2012年8月9日至2017年11月10日期间)、恒生交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理(2012年8月21日至2017年11月10日期间)、华夏沪港通恒生交易型开放式指数证券投资基金基金经理(2014年12月23日至2017年11月10日期间)、华夏沪港通恒生交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理(2015年1月13日至2017年11月</p>

				<p>10 日期间)、MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金基金经理 (2015 年 2 月 12 日至 2017 年 11 月 10 日期间)、MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理 (2015 年 2 月 12 日至 2017 年 11 月 10 日期间)、华夏睿磐泰利六个月定期开放混合型证券投资基金基金经理 (2017 年 12 月 27 日至 2019 年 2 月 26 日期间)、华夏睿磐泰盛六个月定期开放混合型证券投资基金基金经理(2017 年 3 月 15 日至 2021 年 1 月 5 日期间)、华夏睿磐泰兴混合型证券投资基金基金经理 (2017 年 7 月 14 日至 2021 年 5 月 26 日期间)、华夏睿磐泰茂混合型证券投资基金基金经理 (2017 年 12 月 6 日至 2021 年 5 月 26 日期间)、华夏睿磐泰荣混合型证券投资基金基金经理 (2017 年 12 月 27 日至 2021 年 5 月 26 日期间)、华夏睿磐泰利混合型证券投资基金基金经理 (2019 年 2 月 27 日至 2021 年 5 月 26 日期间)、华夏睿磐泰盛混合型证券投资基金基金经理 (2021 年 1 月 6 日至 2021 年 5 月 26 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 (2013 年 3 月 28 日至 2021 年 5 月 27 日期间)、华夏鼎融债券型证券投资基金基金经理 (2016 年 12 月 29 日至 2022 年 3 月 7 日期间)等。</p>
--	--	--	--	--

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《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值(元)	任职时间
张弘弢	公募基金	8	171,081,909,176.94	2009-07-10
	私募资产管理计划	1	11,225,400.54	2021-11-18
	其他组合	-	-	-
	合计	9	171,093,134,577.48	

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，本基金管理人旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 90 次，均为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。

#### 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。

上半年，全球主要经济体增长放缓，美欧通胀见顶回落，但仍处高位，主要经济体货币政策紧缩外溢效应突出，硅谷银行倒闭、瑞士信贷被收购等事件引发国际金融市场大幅震荡；西方继续对

俄实施大规模制裁，地缘政治冲突升级并进一步影响全球经济秩序的风险犹存。国内方面，一季度经济开局良好，二季度延续恢复态势，在复杂严峻的外部环境下，上半年我国经济增速明显快于世界主要发达经济体，彰显出我国经济发展的强大韧性；经济增长由去年的以投资和出口拉动为主，转为今年的以消费和投资拉动为主，消费潜力逐步释放，为推动经济恢复向好发挥了重要作用，上半年最终消费支出增长对经济增长的贡献率达到 77.2%。

市场方面，A 股市场在全球主要市场中表现相对落后，在缺乏增量资金入场的背景下，A 股市场呈现存量博弈的特征，指数及行业表现较为分化，从宽基指数表现来看，科创 50、中证 1000、中证 500 等中小盘指数表现较强，沪深 300、上证 50、创业板指等大盘指数表现较弱；传媒、通信及计算机为代表的 TMT 板块在 ChatGPT、数字经济等主题驱动下强势领涨，而与居民消费和投资强相关的商贸零售、美容护理、地产等板块跌幅居前。市场风格方面，价值风格优于成长风格，沪深 300、中证 500、中证 1000 的价值指数表现均优于对应的成长指数。

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 2023 年 6 月 30 日，华夏沪深 300ETF 联接 A 份额净值为 1.3688 元，本报告期份额净值增长率为 0.24%，同期业绩比较基准增长率-0.22%，本报告期跟踪偏离度为+0.46%；华夏沪深 300ETF 联接 C 份额净值为 1.3459 元，本报告期份额净值增长率为 0.09%，同期业绩比较基准增长率-0.22%，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成份股分红、日常运作费用、指数结构调整、申购赎回等产生的差异。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，全球主要经济体增速预计将继续放缓，通胀水平亦将继续回落，但中枢仍会在相对中高位。中美经济与货币周期错位继续演进，中国经济短周期即将触底，预计稳增长政策延续发力，货币政策稳健宽松，信贷政策保持积极，助力经济企稳和市场主体信心恢复。

市场方面，由于热点主题启动受政策和事件催化，且行情延续需要业绩支撑，尽管下半年 AI 与中特估等上半年热点主题可能仍会反复表现，但应该不再会一枝独秀，下半年 A 股市场或将回归景气主线，主题投资或将收敛于绩优主线。

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

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

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

## §5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明

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合规守信、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 2023 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：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	133,463,384.33	72,596,196.15
结算备付金		27,651,685.42	18,396,882.78
存出保证金		9,040,190.94	5,764,135.43
交易性金融资产	6.4.7.2	9,846,382,222.62	8,914,795,633.37
其中：股票投资		143,264,241.79	9,806,637.23
基金投资		9,298,891,679.46	8,497,970,804.35
债券投资		404,226,301.37	407,018,191.79
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		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		5,921,180.13	4,713,097.70
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	5,708,752.00
资产总计		10,022,458,663.44	9,021,974,697.43
<b>负债和净资产</b>			
<b>负债：</b>			
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		6,704,812.60	8,735,578.73
应付赎回款		5,453,263.74	7,973,224.30
应付管理人报酬		291,499.90	314,633.05
应付托管费		58,299.96	62,926.62
应付销售服务费		225,866.47	72,410.90
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	301,764.95
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-



其他负债	6.4.7.6	821,837.28	863,306.03
负债合计		13,555,579.95	18,323,844.58
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	7,323,413,714.16	6,596,972,873.57
未分配利润	6.4.7.8	2,685,489,369.33	2,406,677,979.28
净资产合计		10,008,903,083.49	9,003,650,852.85
负债和净资产总计		10,022,458,663.44	9,021,974,697.43

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，华夏沪深 300ETF 联接 A 基金份额净值 1.3688 元，华夏沪深 300ETF 联接 C 基金份额净值 1.3459 元；华夏沪深 300ETF 联接基金份额总额 7,323,413,714.16 份（其中 A 类 6,647,143,961.39 份，C 类 676,269,752.77 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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		1,510,427.51	-945,311,781.80
1.利息收入		631,151.30	500,791.29
其中：存款利息收入	6.4.7.9	631,151.30	500,791.29
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		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		204,419,963.89	235,654,168.92
其中：股票投资收益	6.4.7.10	2,894,610.66	-8,033,057.78
基金投资收益	6.4.7.11	36,125,723.15	79,586,532.52
债券投资收益	6.4.7.12	3,666,554.74	4,207,399.45
资产支持证券投资收益	6.4.7.13	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	200,592.51	-13,714,550.00
股利收益	6.4.7.15	161,532,482.83	173,607,844.73
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-203,945,373.06	-1,182,004,326.16
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	404,685.38	537,584.15
<b>减：二、营业总支出</b>		4,304,999.89	3,834,200.54
1.管理人报酬		1,895,165.21	2,119,480.08

2.托管费		379,032.98	423,896.01
3.销售服务费		1,672,962.10	904,584.41
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		95,079.85	48,990.36
其中：卖出回购金融资产支出		95,079.85	48,990.36
6.信用减值损失	6.4.7.18	-	-
7.税金及附加		157,033.40	237,469.75
8.其他费用	6.4.7.19	105,726.35	99,779.93
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-2,794,572.38</b>	<b>-949,145,982.34</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-2,794,572.38</b>	<b>-949,145,982.34</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		<b>-</b>	<b>-</b>
<b>六、综合收益总额</b>		<b>-2,794,572.38</b>	<b>-949,145,982.34</b>

## 6.3 净资产（基金净值）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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合 收益(若有)	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	6,596,972,873.57	-	2,406,677,979.28	9,003,650,852.85
二、本期期初净资产（基金净值）	6,596,972,873.57	-	2,406,677,979.28	9,003,650,852.85
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	726,440,840.59	-	278,811,390.05	1,005,252,230.64
（一）、综合收益总额	-	-	-2,794,572.38	-2,794,572.38
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	726,440,840.59	-	281,605,962.43	1,008,046,803.02
其中：1.基金申购款	2,235,904,422.56	-	901,701,409.43	3,137,605,831.99
2.基金赎回	-1,509,463,581.97	-	-620,095,447.00	-2,129,559,028.97

款				
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	7,323,413,714.16	-	2,685,489,369.33	10,008,903,083.49
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合 收益(若有)	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	6,901,823,269.06	-	4,752,616,759.78	11,654,440,028.84
二、本期期初净资产(基金净值)	6,901,823,269.06	-	4,752,616,759.78	11,654,440,028.84
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-100,733,422.43	-	-989,412,523.83	-1,090,145,946.26
(一)、综合收益总额	-	-	-949,145,982.34	-949,145,982.34
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-100,733,422.43	-	-40,266,541.49	-140,999,963.92
其中：1.基金申购款	1,087,503,668.80	-	521,409,438.50	1,608,913,107.30
2.基金赎回款	-1,188,237,091.23	-	-561,675,979.99	-1,749,913,071.22
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	6,801,089,846.63	-	3,763,204,235.95	10,564,294,082.58

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：杨明辉，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《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、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会发布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》和中国证监会、中国基金业协会允许的如财务报表附注 6.4.4 所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

#### 6.4.4 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[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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 以发行基金方式募集资金不属于增值税征收范围，不征收增值税。

(2) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳

增值税。

(3) 基金买卖股票、债券的差价收入免征增值税，暂不征收企业所得税。

(4) 存款利息收入不征收增值税。

(5) 国债、地方政府债利息收入，金融同业往来利息收入免征增值税。

(6) 对基金取得的债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

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

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

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

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

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

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	133,463,384.33
等于：本金	133,444,529.52
加：应计利息	18,854.81

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	133,463,384.33

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	149,898,505.31	-	143,264,241.79	-6,634,263.52	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	-	-	-	
	银行间市场	398,315,650.00	4,466,301.37	404,226,301.37	1,444,350.00
	合计	398,315,650.00	4,466,301.37	404,226,301.37	1,444,350.00
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	9,438,102,986.36	-	9,298,891,679.46	-139,211,306.90	
其他	-	-	-	-	
合计	9,986,317,141.67	4,466,301.37	9,846,382,222.62	-144,401,220.42	

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 2023 年 6 月 30 日			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	68,585,580.00	-	-	-
其中：股指期货	68,585,580.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	68,585,580.00	-	-	-

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
IF2309	沪深 300 期货 IF2309 合约	60	69,102,000.00	516,420.00
合计	-	-	-	516,420.00
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	516,420.00
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 2023 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	3,823.99
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	728,753.14
其中：交易所市场	728,753.14
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	89,260.15
合计	821,837.28

#### 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 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	6,371,979,758.34	6,371,979,758.34
本期申购	704,885,161.32	704,885,161.32
本期赎回（以“-”号填列）	-429,720,958.27	-429,720,958.27
本期末	6,647,143,961.39	6,647,143,961.39

华夏沪深 300ETF 联接 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	224,993,115.23	224,993,115.23
本期申购	1,531,019,261.24	1,531,019,261.24
本期赎回（以“-”号填列）	-1,079,742,623.70	-1,079,742,623.70
本期末	676,269,752.77	676,269,752.77

#### 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	6,320,330,206.96	-3,991,207,984.05	2,329,122,222.91
本期利润	174,292,820.96	-160,280,279.17	14,012,541.79
本期基金份额交易产生的变动数	274,985,823.91	-166,579,300.72	108,406,523.19
其中：基金申购款	711,509,559.36	-422,870,330.06	288,639,229.30
基金赎回款	-436,523,735.45	256,291,029.34	-180,232,706.11
本期已分配利润	-	-	-
本期末	6,769,608,851.83	-4,318,067,563.94	2,451,541,287.89

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	233,152,954.00	-155,597,197.63	77,555,756.37
本期利润	26,857,979.72	-43,665,093.89	-16,807,114.17
本期基金份额交易产生的变动数	457,052,011.31	-283,852,572.07	173,199,439.24
其中：基金申购款	1,600,481,694.86	-987,419,514.73	613,062,180.13
基金赎回款	-1,143,429,683.55	703,566,942.66	-439,862,740.89
本期已分配利润	-	-	-
本期末	717,062,945.03	-483,114,863.59	233,948,081.44

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	370,041.29
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	256,181.28
其他	4,928.73
合计	631,151.30

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	131,502,670.17
减：卖出股票成本总额	128,269,967.02
减：交易费用	338,092.49
买卖股票差价收入	2,894,610.66

6.4.7.10.2 股票投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.10.3 股票投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.10.4 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.11 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
卖出/赎回基金成交总额	1,180,784,481.30
减：卖出/赎回基金成本总额	1,143,374,078.28
减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额	1,151,642.40
减：交易费用	133,037.47
基金投资收益	36,125,723.15

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 2023年1月1日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	3,172,197.48
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	494,357.26
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	3,666,554.74

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 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	417,847,493.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	409,553,200.00
减：应计利息总额	7,798,008.76
减：交易费用	1,926.98
买卖债券差价收入	494,357.26

6.4.7.13 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
股指期货投资收益	200,592.51

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,540,618.91

其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	159,991,863.92
合计	161,532,482.83

## 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
1.交易性金融资产	-205,313,185.06
——股票投资	-5,117,489.23
——债券投资	919,100.00
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-201,114,795.83
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	1,367,812.00
——权证投资	-
——期货投资	1,367,812.00
4.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	-203,945,373.06

## 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
基金赎回费收入	404,685.38
合计	404,685.38

## 6.4.7.18 信用减值损失

无。

## 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
审计费用	29,752.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	7,466.20
银行间账户维护费	9,000.00
合计	105,726.35

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

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

根据华夏基金管理有限公司于 2023 年 1 月 6 日发布的公告，华夏基金管理有限公司股权结构变更为中信证券（出资比例 62.2%）、MACKENZIE FINANCIAL CORPORATION（出资比例 27.8%）、天津海鹏科技咨询有限公司（出资比例 10%）。

##### 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
中信期货有限公司（“中信期货”）	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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

##### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 股票交易

无。

##### 6.4.10.1.2 债券交易

无。

##### 6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

##### 6.4.10.1.4 应支付关联方的佣金

无。

##### 6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月 30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,895,165.21	2,119,480.08
其中：支付销售机构的客户维护费	6,530,136.28	5,420,199.36

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 0.50%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) ×0.50%/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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月 30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30 日
当期发生的基金应支付的托管费	379,032.98	423,896.01

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 0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

②基金托管费计算公式为：日基金托管费=（前一日的基金资产净值-前一日基金资产中目标 ETF 份额所对应资产净值） ×0.10%/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	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
销售	当期发生的基金应支付的销售服务费

服务费的各关联方名称	华夏沪深 300ETF 联接 A	华夏沪深 300ETF 联接 C	合计
华夏基金管理有限公司	-	177,091.07	177,091.07
中信证券	-	51,967.12	51,967.12
中信证券（山东）	-	7,543.35	7,543.35
华夏财富	-	4,578.44	4,578.44
中信证券（华南）	-	3,266.95	3,266.95
中信期货	-	130.78	130.78
中国工商银行	-	14.13	14.13
合计	-	244,591.84	244,591.84
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日 当期发生的基金应支付的销售服务费		
服务费的各关联方名称	华夏沪深 300ETF 联接 A	华夏沪深 300ETF 联接 C	合计
华夏基金管理	-	605,692.53	605,692.53

有限公司			
中信 证券	-	25,833.49	25,833.49
中信 证券 (山 东)	-	4,274.54	4,274.54
华夏 财富	-	3,523.81	3,523.81
中信 证券 (华 南)	-	1,797.53	1,797.53
中信 期货	-	106.29	106.29
合计	-	641,228.19	641,228.19

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 × 0.30% / 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 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022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	133,463,384.33	370,041.29	284,079,017.79	403,449.74

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 2023年1月1日至2023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	688343	云天励飞	新股发行	24,961	1,096,287.12
中信证券	688146	中船特气	新股发行	10,101	365,151.15
中信证券	001286	陕西能源	新股发行	37,667	361,603.20
中信证券	688581	安杰思	新股发行	1,629	204,928.20
中信证券	688539	高华科技	新股发行	5,334	203,865.48
中信证券	688522	纳睿雷达	新股发行	4,299	200,677.32
中信证券	301439	泓淋电力	新股发行	9,486	189,625.14
中信证券	688523	航天环宇	新股发行	4,717	103,113.62
中信证券	688631	莱斯信息	新股发行	3,357	84,864.96
中信证券	301157	华塑科技	新股发行	1,498	84,637.00
中信证券	601133	柏诚股份	新股发行	6,632	77,329.12
中信证券	603281	江瀚新材	新股发行	863	30,714.17
中信证券	001367	海森药业	新股发行	549	24,419.52
中信证券	603162	海通发展	新股发行	523	19,481.75
上年度可比期间 2022年1月1日至2022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	600938	中国海油	新股发行	120,005	1,296,054.00
中信证券	688223	晶科能源	新股发行	213,000	1,065,000.00
中信证券	688326	经纬恒润	新股发行	6,832	826,672.00
中信证券	301200	大族数控	新股发行	8,566	655,812.96
中信证券	688302	海创药业	新股发行	13,082	561,479.44
中信证券	301109	军信股份	新股发行	12,250	426,422.50
中信证券	301302	华如科技	新股发行	4,651	241,991.53
中信证券	688150	莱特光电	新股发行	5,626	124,053.30
中信证券	688290	景业智能	新股发行	3,040	103,025.60

中信证券	603132	金徽股份	新股发行	1,342	14,493.60
中信证券	603191	望变电气	新股发行	1,149	13,627.14
中信证券	603209	兴通股份	新股发行	595	12,804.40
中信证券	001266	宏英智能	新股发行	247	9,536.67
中信证券	603215	比依股份	新股发行	575	7,187.50
中信证券	603051	鹿山新材	新股发行	272	7,014.88

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

##### 6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

于 2023 年 6 月 30 日，本基金持有的中信证券股票估值总额为人民币 1,454,720.10 元，占基金资产净值的比例为 0.01%（2022 年 12 月 31 日，本基金持有的中信证券股票估值总额为人民币 12,841.95 元，占基金资产净值的比例为 0.00%）。

于 2023 年 6 月 30 日，本基金持有的工商银行股票估值总额为人民币 1,273,926.00 元，占基金资产净值的比例为 0.01%（2022 年 12 月 31 日，本基金持有的工商银行股票估值总额为人民币 14,756.00 元，占基金资产净值的比例为 0.00%）。

截至 2023 年 6 月 30 日止，本基金持有 2,394,030,091 份目标 ETF 基金份额（2022 年 12 月 31 日：2,158,653,391 份），占其总份额的比例为 38.91%（2022 年 12 月 31 日：34.12%）。

#### 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（2023 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688249	晶合集成	2023-04-24	6 个月	新发流通受限	19.86	18.06	7,405	147,063.30	133,734.30	-
688472	阿特斯	2023-06-02	6 个月	新发	11.10	17.04	6,261	69,497.10	106,687.44	-

				流通受限						
688443	智翔金泰	2023-06-13	6 个月	新发流通受限	37.88	29.49	3,033	114,890.04	89,443.17	-
688469	中芯集成	2023-04-28	6 个月	新发流通受限	5.69	5.41	13,800	78,522.00	74,658.00	-
688603	天承科技	2023-06-30	1 个月内(含)	新发流通受限	55.00	55.00	1,251	68,805.00	68,805.00	-
688485	九州一轨	2023-01-11	6 个月	新发流通受限	17.47	15.17	3,580	62,542.60	54,308.60	-
688361	中科飞测	2023-05-12	6 个月	新发流通受限	23.60	64.67	831	19,611.60	53,740.77	-
688531	日联科技	2023-03-24	6 个月	新发流通受限	152.38	135.97	346	52,723.48	47,045.62	-
688146	中船特气	2023-04-13	6 个月	新发流通	36.15	38.13	1,011	36,547.65	38,549.43	-

				受限						
688484	南芯科技	2023-03-28	6 个月	新发流通受限	39.99	36.71	1,008	40,309.92	37,003.68	-
001286	陕西能源	2023-03-31	6 个月	新发流通受限	9.60	9.41	3,767	36,163.20	35,447.47	-
001287	中电港	2023-03-30	6 个月	新发流通受限	11.88	21.02	1,386	16,465.68	29,133.72	-
688576	西山科技	2023-05-30	6 个月	新发流通受限	135.80	120.41	240	32,592.00	28,898.40	-
301246	宏源药业	2023-03-10	6 个月	新发流通受限	50.00	30.71	931	46,550.00	28,591.01	-
688352	颀中科技	2023-04-11	6 个月	新发流通受限	12.10	12.07	2,361	28,568.10	28,497.27	-
688507	索辰科技	2023-04-10	6 个月	新发流通受限	245.56	122.11	222	36,834.00	27,108.42	含 证 券 送 配

688582	芯动联科	2023-06-21	6 个月	新发流通受限	26.74	40.68	648	17,327.52	26,360.64	-
688552	航天南湖	2023-05-08	6 个月	新发流通受限	21.17	23.50	956	20,238.52	22,466.00	-
688570	天玛智控	2023-05-29	6 个月	新发流通受限	30.26	25.33	884	26,749.84	22,391.72	-
688543	国科军工	2023-06-14	6 个月	新发流通受限	43.67	53.05	410	17,904.70	21,750.50	-
301322	绿通科技	2023-02-27	6 个月	新发流通受限	131.11	53.24	392	34,219.71	20,870.08	含证券送配
688458	美芯晟	2023-05-15	6 个月	新发流通受限	75.00	90.76	221	16,575.00	20,057.96	-
688581	安杰思	2023-05-12	6 个月	新发流通受限	125.80	118.03	163	20,505.40	19,238.89	-
688562	航天软件	2023-05-15	6 个月	新发	12.68	22.31	726	9,205.68	16,197.06	-

				流通受限						
301439	泓淋电力	2023-03-10	6 个月	新发流通受限	19.99	16.90	949	18,970.51	16,038.10	-
688623	双元科技	2023-05-31	6 个月	新发流通受限	125.88	86.79	178	22,406.64	15,448.62	-
301387	光大同创	2023-04-10	6 个月	新发流通受限	58.32	45.36	307	17,904.24	13,925.52	-
688512	慧智微	2023-05-08	6 个月	新发流通受限	20.92	19.16	721	15,083.32	13,814.36	-
688433	华曙高科	2023-04-07	6 个月	新发流通受限	26.66	31.50	418	11,143.88	13,167.00	-
301345	涛涛车业	2023-03-10	6 个月	新发流通受限	73.45	46.64	266	19,537.70	12,406.24	-
688523	航天环宇	2023-05-26	6 个月	新发流通	21.86	23.85	472	10,317.92	11,257.20	-

				受限						
603135	中重科技	2023-03-29	6 个月	新发流通受限	17.80	17.89	628	11,178.40	11,234.92	-
301141	中科磁业	2023-03-27	6 个月	新发流通受限	41.20	42.69	262	10,794.40	11,184.78	-
301429	森泰股份	2023-04-10	6 个月	新发流通受限	28.75	21.02	499	14,346.25	10,488.98	-
601065	江盐集团	2023-03-31	6 个月	新发流通受限	10.36	11.84	875	9,065.00	10,360.00	-
688631	莱斯信息	2023-06-19	6 个月	新发流通受限	25.28	29.87	336	8,494.08	10,036.32	-
688479	友车科技	2023-05-04	6 个月	新发流通受限	33.99	29.49	332	11,284.68	9,790.68	-
301357	北方长龙	2023-04-11	6 个月	新发流通受限	50.00	48.39	190	9,500.00	9,194.10	-

301386	未来 电器	2023-03-21	6 个月	新发 流通 受限	29.99	23.79	378	11,336.22	8,992.62	-
688429	时创 能源	2023-06-20	6 个月	新发 流通 受限	19.20	25.53	346	6,643.20	8,833.38	-
301281	科源 制药	2023-03-28	6 个月	新发 流通 受限	44.18	25.10	338	10,647.38	8,483.80	含 证 券 送 配
688535	华海 诚科	2023-03-28	6 个月	新发 流通 受限	35.00	51.23	161	5,635.00	8,248.03	-
601133	柏诚 股份	2023-03-31	6 个月	新发 流通 受限	11.66	12.26	664	7,742.24	8,140.64	-
301157	华塑 科技	2023-03-01	6 个月	新发 流通 受限	56.50	52.93	150	8,475.00	7,939.50	-
301203	国泰 环保	2023-03-28	6 个月	新发 流通 受限	46.13	34.40	225	10,379.25	7,740.00	-
688603	天承 科技	2023-06-30	6 个月	新发	55.00	55.00	140	7,700.00	7,700.00	-



				流通受限						
603125	常青科技	2023-03-30	6 个月	新发流通受限	25.98	24.53	160	4,156.80	3,924.80	-
001328	登康口腔	2023-03-29	6 个月	新发流通受限	20.68	25.49	145	2,998.60	3,696.05	-
001360	南矿集团	2023-03-31	6 个月	新发流通受限	15.38	14.87	177	2,722.26	2,631.99	-
001367	海森药业	2023-03-30	6 个月	新发流通受限	44.48	39.48	55	2,446.40	2,171.40	-
603172	万丰股份	2023-04-28	6 个月	新发流通受限	14.58	16.13	122	1,778.76	1,967.86	-

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

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

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

④基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基

金参与网下申购获得的设定限售期的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

##### 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 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 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	143,264,241.79	1.43	9,806,637.23	0.11
交易性金融资产—基金投资	9,298,891,679.46	92.91	8,497,970,804.35	94.38
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	9,442,155,921.25	94.34	8,507,777,441.58	94.49

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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	-5%	-455,955,623.97	-419,366,481.39
	+5%	455,955,623.97	419,366,481.39

#### 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 2023 年 6 月 30 日
第一层次	9,440,856,119.21
第二层次	404,302,806.37
第三层次	1,223,297.04
合计	9,846,382,222.62

#### 6.4.14.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券等投资，若出现交易不活跃（包括重大事项停牌、境内证券涨跌停等导致的交易不活跃）和非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。本基金政策以导致各层次之间转换的事项发生日作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

截至 2023 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	143,264,241.79	1.43
	其中：股票	143,264,241.79	1.43
2	基金投资	9,298,891,679.46	92.78
3	固定收益投资	404,226,301.37	4.03
	其中：债券	404,226,301.37	4.03
	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	161,115,069.75	1.61
8	其他各项资产	14,961,371.07	0.15
9	合计	10,022,458,663.44	100.00

### 7.2 期末投资目标基金明细

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	9,298,891,679.46	92.91

### 7.3 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	1,593,115.00	0.02
B	采矿业	5,551,160.84	0.06
C	制造业	81,054,661.61	0.81
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,284,243.92	0.04
E	建筑业	3,386,889.47	0.03
F	批发和零售业	503,619.72	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	4,444,982.10	0.04
H	住宿和餐饮业	143,956.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,188,902.60	0.07
J	金融业	29,175,751.01	0.29
K	房地产业	2,133,997.62	0.02
L	租赁和商务服务业	1,336,844.00	0.01
M	科学研究和技术服务业	1,394,667.25	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	62,048.60	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	817,826.05	0.01
R	文化、体育和娱乐业	191,576.00	0.00
S	综合	-	-
	合计	143,264,241.79	1.43

### 7.4 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	600519	贵州茅台	4,728	7,995,048.00	0.08
2	300750	宁德时代	19,920	4,557,496.80	0.05
3	601318	中国平安	81,696	3,790,694.40	0.04
4	600036	招商银行	93,300	3,056,508.00	0.03
5	000858	五粮液	14,600	2,388,122.00	0.02
6	000333	美的集团	37,100	2,185,932.00	0.02
7	002594	比亚迪	6,800	1,756,236.00	0.02
8	601166	兴业银行	109,600	1,715,240.00	0.02
9	600900	长江电力	73,750	1,626,925.00	0.02
10	600276	恒瑞医药	33,710	1,614,709.00	0.02
11	600030	中信证券	73,545	1,454,720.10	0.01
12	601899	紫金矿业	124,200	1,412,154.00	0.01
13	600887	伊利股份	48,000	1,359,360.00	0.01
14	300059	东方财富	95,620	1,357,804.00	0.01
15	601012	隆基绿能	45,744	1,311,480.48	0.01
16	601398	工商银行	264,300	1,273,926.00	0.01
17	600309	万华化学	14,200	1,247,328.00	0.01
18	000651	格力电器	34,000	1,241,340.00	0.01
19	601328	交通银行	207,200	1,201,760.00	0.01
20	002475	立讯精密	36,200	1,174,690.00	0.01
21	601138	工业富联	46,500	1,171,800.00	0.01
22	000568	泸州老窖	5,500	1,152,635.00	0.01
23	002415	海康威视	34,100	1,129,051.00	0.01
24	300760	迈瑞医疗	3,700	1,109,260.00	0.01
25	000063	中兴通讯	24,000	1,092,960.00	0.01
26	601816	京沪高铁	185,100	973,626.00	0.01
27	603259	药明康德	15,475	964,247.25	0.01
28	002230	科大讯飞	13,900	944,644.00	0.01
29	600028	中国石化	143,400	912,024.00	0.01
30	300274	阳光电源	7,800	909,714.00	0.01
31	601668	中国建筑	158,100	907,494.00	0.01
32	300124	汇川技术	14,000	898,940.00	0.01
33	002714	牧原股份	20,600	868,290.00	0.01
34	601288	农业银行	240,700	849,671.00	0.01
35	002352	顺丰控股	18,500	834,165.00	0.01
36	000001	平安银行	73,200	822,036.00	0.01
37	601888	中国中免	7,400	817,922.00	0.01
38	002129	TCL 中环	24,375	809,250.00	0.01
39	000792	盐湖股份	41,000	785,970.00	0.01
40	601088	中国神华	24,900	765,675.00	0.01
41	002142	宁波银行	29,900	756,470.00	0.01
42	688981	中芯国际	14,758	745,574.16	0.01
43	600031	三一重工	44,744	744,092.72	0.01

44	300498	温氏股份	39,500	724,825.00	0.01
45	000002	万科 A	51,300	719,226.00	0.01
46	600048	保利发展	54,154	705,626.62	0.01
47	600016	民生银行	187,160	701,850.00	0.01
48	600438	通威股份	20,400	699,924.00	0.01
49	600406	国电南瑞	30,240	698,544.00	0.01
50	600050	中国联通	143,900	690,720.00	0.01
51	600809	山西汾酒	3,680	681,057.60	0.01
52	600837	海通证券	72,800	671,216.00	0.01
53	600690	海尔智家	28,556	670,494.88	0.01
54	601601	中国太保	25,800	670,284.00	0.01
55	601728	中国电信	117,011	658,771.93	0.01
56	600436	片仔癀	2,300	658,628.00	0.01
57	688111	金山办公	1,392	657,330.24	0.01
58	600919	江苏银行	89,050	654,517.50	0.01
59	300015	爱尔眼科	35,211	653,164.05	0.01
60	600089	特变电工	29,300	653,097.00	0.01
61	603501	韦尔股份	6,615	648,534.60	0.01
62	600000	浦发银行	88,474	640,551.76	0.01
63	601857	中国石油	85,500	638,685.00	0.01
64	002371	北方华创	2,000	635,300.00	0.01
65	600941	中国移动	6,800	634,440.00	0.01
66	601988	中国银行	158,900	621,299.00	0.01
67	601766	中国中车	91,700	596,050.00	0.01
68	002304	洋河股份	4,500	591,075.00	0.01
69	603288	海天味业	12,598	590,216.30	0.01
70	601390	中国中铁	77,441	587,002.78	0.01
71	600905	三峡能源	107,885	579,342.45	0.01
72	300014	亿纬锂能	9,300	562,650.00	0.01
73	600150	中国船舶	16,900	556,179.00	0.01
74	000938	紫光股份	17,300	551,005.00	0.01
75	002466	天齐锂业	7,800	545,298.00	0.01
76	601688	华泰证券	38,854	535,019.58	0.01
77	603986	兆易创新	5,013	532,631.25	0.01
78	601225	陕西煤业	29,200	531,148.00	0.01
79	002027	分众传媒	76,200	518,922.00	0.01
80	002459	晶澳科技	12,440	518,748.00	0.01
81	002460	赣锋锂业	8,500	518,160.00	0.01
82	601169	北京银行	111,556	516,504.28	0.01
83	002410	广联达	15,780	512,692.20	0.01
84	688012	中微公司	3,263	510,496.35	0.01
85	000338	潍柴动力	40,900	509,614.00	0.01
86	600570	恒生电子	11,374	503,754.46	0.01



87	601985	中国核电	71,100	501,255.00	0.01
88	600104	上汽集团	35,238	499,322.46	0.00
89	002050	三花智控	16,200	490,212.00	0.00
90	000625	长安汽车	37,500	484,875.00	0.00
91	601211	国泰君安	34,000	475,660.00	0.00
92	002049	紫光国微	5,100	475,575.00	0.00
93	000725	京东方 A	115,200	471,168.00	0.00
94	600111	北方稀土	19,100	458,018.00	0.00
95	603019	中科曙光	8,963	456,216.70	0.00
96	601919	中远海控	48,030	451,482.00	0.00
97	603799	华友钴业	9,695	445,097.45	0.00
98	601628	中国人寿	12,600	440,496.00	0.00
99	000100	TCL 科技	111,420	438,994.80	0.00
100	002179	中航光电	9,590	434,906.50	0.00
101	600660	福耀玻璃	12,100	433,785.00	0.00
102	601229	上海银行	74,982	431,146.50	0.00
103	601818	光大银行	140,000	429,800.00	0.00
104	600585	海螺水泥	18,044	428,364.56	0.00
105	600009	上海机场	9,405	427,175.10	0.00
106	600893	航发动力	10,000	422,600.00	0.00
107	601989	中国重工	86,000	414,520.00	0.00
108	002271	东方雨虹	15,200	414,352.00	0.00
109	601658	邮储银行	83,700	409,293.00	0.00
110	002555	三七互娱	11,700	408,096.00	0.00
111	300122	智飞生物	9,069	400,849.80	0.00
112	002812	恩捷股份	4,000	385,400.00	0.00
113	600958	东方证券	39,416	382,335.20	0.00
114	600999	招商证券	28,000	379,960.00	0.00
115	600019	宝钢股份	67,100	377,102.00	0.00
116	600760	中航沈飞	8,288	372,960.00	0.00
117	000977	浪潮信息	7,600	368,600.00	0.00
118	601360	三六零	29,300	367,422.00	0.00
119	002709	天赐材料	8,700	358,353.00	0.00
120	688036	传音控股	2,425	356,475.00	0.00
121	300896	爱美客	800	355,960.00	0.00
122	688599	天合光能	8,193	349,103.73	0.00
123	300316	晶盛机电	4,900	347,410.00	0.00
124	688008	澜起科技	5,996	344,290.32	0.00
125	600426	华鲁恒升	11,200	343,056.00	0.00
126	600745	闻泰科技	7,000	342,300.00	0.00
127	601186	中国铁建	34,700	341,795.00	0.00
128	600584	长电科技	10,700	333,519.00	0.00
129	601006	大秦铁路	44,800	332,864.00	0.00

130	601600	中国铝业	59,800	328,302.00	0.00
131	000776	广发证券	22,300	328,033.00	0.00
132	002841	视源股份	4,900	327,516.00	0.00
133	000661	长春高新	2,400	327,120.00	0.00
134	300142	沃森生物	12,100	320,045.00	0.00
135	600547	山东黄金	13,608	319,515.84	0.00
136	601377	兴业证券	52,047	318,527.64	0.00
137	002241	歌尔股份	17,900	317,725.00	0.00
138	601939	建设银行	50,600	316,756.00	0.00
139	000166	申万宏源	68,000	314,160.00	0.00
140	601009	南京银行	38,992	311,936.00	0.00
141	600588	用友网络	15,032	308,156.00	0.00
142	600011	华能国际	33,200	307,432.00	0.00
143	600010	包钢股份	171,170	306,394.30	0.00
144	001979	招商蛇口	23,300	303,599.00	0.00
145	300450	先导智能	8,300	300,211.00	0.00
146	600085	同仁堂	5,200	299,312.00	0.00
147	601669	中国电建	51,900	297,906.00	0.00
148	000596	古井贡酒	1,200	296,856.00	0.00
149	600196	复星医药	9,594	296,454.60	0.00
150	002311	海大集团	6,300	295,092.00	0.00
151	601800	中国交建	26,815	292,551.65	0.00
152	603659	璞泰来	7,635	291,809.70	0.00
153	300782	卓胜微	3,000	289,890.00	0.00
154	000963	华东医药	6,600	286,242.00	0.00
155	600886	国投电力	22,500	284,625.00	0.00
156	603993	洛阳钼业	53,300	284,089.00	0.00
157	000538	云南白药	5,400	283,392.00	0.00
158	000768	中航西飞	10,500	280,875.00	0.00
159	300033	同花顺	1,600	280,448.00	0.00
160	600600	青岛啤酒	2,700	279,801.00	0.00
161	002180	纳思达	8,100	277,425.00	0.00
162	002252	上海莱士	35,600	267,356.00	0.00
163	002493	荣盛石化	22,900	266,556.00	0.00
164	601689	拓普集团	3,300	266,310.00	0.00
165	600926	杭州银行	22,336	262,448.00	0.00
166	601100	恒立液压	4,049	260,472.17	0.00
167	600015	华夏银行	47,955	259,436.55	0.00
168	000733	振华科技	2,700	258,795.00	0.00
169	300347	泰格医药	4,000	258,160.00	0.00
170	600795	国电电力	67,200	257,376.00	0.00
171	600176	中国巨石	18,100	256,296.00	0.00
172	600732	爱旭股份	8,260	253,995.00	0.00

173	600674	川投能源	16,800	252,840.00	0.00
174	000157	中联重科	37,400	252,450.00	0.00
175	603369	今世缘	4,700	248,160.00	0.00
176	600115	中国东航	51,600	245,616.00	0.00
177	600029	南方航空	40,600	244,818.00	0.00
178	000425	徐工机械	35,600	241,012.00	0.00
179	601066	中信建投	9,800	237,160.00	0.00
180	688126	沪硅产业	11,298	236,128.20	0.00
181	000301	东方盛虹	19,900	235,218.00	0.00
182	601995	中金公司	6,600	234,432.00	0.00
183	601633	长城汽车	9,300	234,081.00	0.00
184	601788	光大证券	14,700	233,583.00	0.00
185	601336	新华保险	6,300	231,651.00	0.00
186	300496	中科创达	2,400	231,240.00	0.00
187	601868	中国能建	97,800	228,852.00	0.00
188	601117	中国化学	27,600	228,528.00	0.00
189	600346	恒力石化	15,900	227,847.00	0.00
190	601877	正泰电器	8,062	222,914.30	0.00
191	002074	国轩高科	8,000	220,960.00	0.00
192	002202	金风科技	20,800	220,896.00	0.00
193	600741	华域汽车	11,900	219,674.00	0.00
194	601111	中国国航	26,300	216,712.00	0.00
195	002001	新和成	14,000	215,600.00	0.00
196	300454	深信服	1,900	215,175.00	0.00
197	688396	华润微	4,087	214,199.67	0.00
198	601618	中国中冶	53,800	213,586.00	0.00
199	002821	凯莱英	1,800	212,148.00	0.00
200	688223	晶科能源	15,079	212,010.74	0.00
201	603806	福斯特	5,648	210,049.12	0.00
202	600989	宝丰能源	16,600	209,326.00	0.00
203	002236	大华股份	10,500	207,375.00	0.00
204	600188	兖矿能源	6,900	206,448.00	0.00
205	601838	成都银行	16,900	206,349.00	0.00
206	300661	圣邦股份	2,470	202,861.10	0.00
207	601901	方正证券	31,001	202,746.54	0.00
208	601615	明阳智能	12,000	202,560.00	0.00
209	605117	德业股份	1,340	200,397.00	0.00
210	000876	新希望	17,100	199,728.00	0.00
211	688303	大全能源	4,834	195,535.30	0.00
212	600460	士兰微	6,400	193,728.00	0.00
213	600039	四川路桥	19,740	193,649.40	0.00
214	603392	万泰生物	2,896	193,365.92	0.00
215	300413	芒果超媒	5,600	191,576.00	0.00

216	000895	双汇发展	7,800	191,022.00	0.00
217	002648	卫星化学	12,700	189,992.00	0.00
218	002736	国信证券	21,700	189,441.00	0.00
219	600233	圆通速递	13,000	189,280.00	0.00
220	603260	合盛硅业	2,700	189,054.00	0.00
221	601607	上海医药	8,400	188,244.00	0.00
222	000786	北新建材	7,600	186,276.00	0.00
223	002007	华兰生物	8,300	186,003.00	0.00
224	003816	中国广核	59,300	184,423.00	0.00
225	300769	德方纳米	1,660	182,981.80	0.00
226	300751	迈为股份	1,080	182,930.40	0.00
227	300207	欣旺达	11,200	182,784.00	0.00
228	300999	金龙鱼	4,500	179,955.00	0.00
229	002601	龙佰集团	10,800	178,200.00	0.00
230	300433	蓝思科技	14,900	175,224.00	0.00
231	601238	广汽集团	16,700	174,014.00	0.00
232	601021	春秋航空	3,000	172,410.00	0.00
233	300759	康龙化成	4,500	172,260.00	0.00
234	600383	金地集团	23,800	171,598.00	0.00
235	600332	白云山	5,300	168,964.00	0.00
236	600132	重庆啤酒	1,800	165,888.00	0.00
237	600763	通策医疗	1,700	164,662.00	0.00
238	600219	南山铝业	53,000	160,060.00	0.00
239	300223	北京君正	1,800	158,958.00	0.00
240	600875	东方电气	8,400	156,660.00	0.00
241	300763	锦浪科技	1,500	156,150.00	0.00
242	000983	山西焦煤	17,100	155,610.00	0.00
243	002756	永兴材料	2,470	154,646.70	0.00
244	600362	江西铜业	7,800	148,044.00	0.00
245	000723	美锦能源	19,600	147,784.00	0.00
246	601699	潞安环能	9,000	146,880.00	0.00
247	601865	福莱特	3,800	146,338.00	0.00
248	600918	中泰证券	21,000	145,110.00	0.00
249	601878	浙商证券	14,600	144,248.00	0.00
250	600754	锦江酒店	3,400	143,956.00	0.00
251	601872	招商轮船	24,500	141,855.00	0.00
252	601319	中国人保	24,100	140,744.00	0.00
253	600061	国投资本	19,408	138,184.96	0.00
254	601998	中信银行	23,100	138,138.00	0.00
255	000617	中油资本	19,100	138,093.00	0.00
256	000069	华侨城 A	30,900	135,960.00	0.00
256	601799	星宇股份	1,100	135,960.00	0.00
258	000408	藏格矿业	6,000	135,420.00	0.00

259	603833	欧派家居	1,400	134,120.00	0.00
260	300628	亿联网络	3,820	133,967.40	0.00
261	688249	晶合集成	7,405	133,734.30	0.00
262	600803	新奥股份	7,000	132,860.00	0.00
263	603486	科沃斯	1,700	132,209.00	0.00
264	688005	容百科技	2,431	131,322.62	0.00
265	688363	华熙生物	1,453	129,549.48	0.00
266	300601	康泰生物	5,100	129,489.00	0.00
267	603290	斯达半导	600	129,120.00	0.00
268	600884	杉杉股份	8,500	128,690.00	0.00
269	002938	鹏鼎控股	5,200	126,308.00	0.00
270	603899	晨光股份	2,800	124,992.00	0.00
271	600845	宝信软件	2,443	124,128.83	0.00
272	600183	生益科技	8,700	123,540.00	0.00
273	300408	三环集团	4,200	123,270.00	0.00
274	300919	中伟股份	2,000	120,500.00	0.00
275	000708	中信特钢	7,600	120,384.00	0.00
276	601898	中煤能源	13,800	116,472.00	0.00
277	002916	深南电路	1,500	113,055.00	0.00
278	601881	中国银河	9,700	112,617.00	0.00
279	603185	弘元绿能	1,500	111,825.00	0.00
280	600018	上港集团	21,100	110,775.00	0.00
281	002920	德赛西威	700	109,067.00	0.00
282	688561	奇安信	2,066	107,039.46	0.00
283	688472	阿特斯	6,261	106,687.44	0.00
284	000877	天山股份	13,100	106,634.00	0.00
285	002120	韵达股份	10,900	104,204.00	0.00
286	601216	君正集团	25,400	104,140.00	0.00
287	002064	华峰化学	15,000	102,900.00	0.00
288	002414	高德红外	12,870	99,999.90	0.00
289	601155	新城控股	6,800	97,988.00	0.00
290	600025	华能水电	13,600	96,968.00	0.00
291	002600	领益智造	13,200	91,212.00	0.00
292	688443	智翔金泰	3,033	89,443.17	0.00
293	300957	贝泰妮	1,000	88,880.00	0.00
294	600606	绿地控股	31,776	87,384.00	0.00
295	603195	公牛集团	896	86,069.76	0.00
296	688187	时代电气	1,965	82,254.90	0.00
297	688065	凯赛生物	1,319	82,120.94	0.00
298	688603	天承科技	1,391	76,505.00	0.00
299	688469	中芯集成	13,800	74,658.00	0.00
300	601698	中国卫通	3,200	63,616.00	0.00
301	601808	中海油服	4,500	62,460.00	0.00

302	000800	一汽解放	7,000	58,590.00	0.00
303	688485	九州一轨	3,580	54,308.60	0.00
304	688361	中科飞测	831	53,740.77	0.00
305	300979	华利集团	1,100	53,614.00	0.00
306	601236	红塔证券	7,080	52,746.00	0.00
307	605499	东鹏饮料	300	51,870.00	0.00
308	688531	日联科技	346	47,045.62	0.00
309	688146	中船特气	1,011	38,549.43	0.00
310	688484	南芯科技	1,008	37,003.68	0.00
311	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.00
312	001287	中电港	1,386	29,133.72	0.00
313	688576	西山科技	240	28,898.40	0.00
314	301246	宏源药业	931	28,591.01	0.00
315	688352	颀中科技	2,361	28,497.27	0.00
316	688507	索辰科技	222	27,108.42	0.00
317	688582	芯动联科	648	26,360.64	0.00
318	001289	龙源电力	1,100	24,750.00	0.00
319	688552	航天南湖	956	22,466.00	0.00
320	688570	天玛智控	884	22,391.72	0.00
321	688543	国科军工	410	21,750.50	0.00
322	301322	绿通科技	392	20,870.08	0.00
323	688458	美芯晟	221	20,057.96	0.00
324	688581	安杰思	163	19,238.89	0.00
325	688562	航天软件	726	16,197.06	0.00
326	301439	泓淋电力	949	16,038.10	0.00
327	688623	双元科技	178	15,448.62	0.00
328	301387	光大同创	307	13,925.52	0.00
329	688512	慧智微	721	13,814.36	0.00
330	688433	华曙高科	418	13,167.00	0.00
331	301345	涛涛车业	266	12,406.24	0.00
332	688523	航天环宇	472	11,257.20	0.00
333	603135	中重科技	628	11,234.92	0.00
334	301141	中科磁业	262	11,184.78	0.00
335	301429	森泰股份	499	10,488.98	0.00
336	601065	江盐集团	875	10,360.00	0.00
337	688631	莱斯信息	336	10,036.32	0.00
338	688479	友车科技	332	9,790.68	0.00
339	301357	北方长龙	190	9,194.10	0.00
340	301386	未来电器	378	8,992.62	0.00
341	688429	时创能源	346	8,833.38	0.00
342	301281	科源制药	338	8,483.80	0.00
343	688535	华海诚科	161	8,248.03	0.00
344	601133	柏诚股份	664	8,140.64	0.00

345	301157	华塑科技	150	7,939.50	0.00
346	301203	国泰环保	225	7,740.00	0.00
347	603125	常青科技	160	3,924.80	0.00
348	001328	登康口腔	145	3,696.05	0.00
349	001360	南矿集团	177	2,631.99	0.00
350	001367	海森药业	55	2,171.40	0.00
351	603172	万丰股份	122	1,967.86	0.00

## 7.5 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.5.1 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	600519	贵州茅台	16,038,541.00	0.18
2	601318	中国平安	9,180,587.00	0.10
3	600036	招商银行	7,903,126.00	0.09
4	300750	宁德时代	6,145,110.00	0.07
5	000858	五粮液	5,737,906.00	0.06
6	000333	美的集团	5,637,714.00	0.06
7	002594	比亚迪	5,307,265.00	0.06
8	601888	中国中免	4,070,359.00	0.05
9	300059	东方财富	3,749,609.00	0.04
10	600030	中信证券	3,406,063.00	0.04
11	000651	格力电器	3,323,195.00	0.04
12	600887	伊利股份	3,059,528.00	0.03
13	000568	泸州老窖	2,650,197.00	0.03
14	601398	工商银行	2,611,288.00	0.03
15	601012	隆基绿能	2,545,338.00	0.03
16	601166	兴业银行	2,505,136.00	0.03
17	002415	海康威视	2,362,025.00	0.03
18	000001	平安银行	2,318,400.00	0.03
19	600900	长江电力	2,276,313.00	0.03
20	002475	立讯精密	2,220,272.00	0.02

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。

### 7.5.2 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	600519	贵州茅台	8,848,496.93	0.10
2	601318	中国平安	4,953,929.02	0.06
3	600036	招商银行	4,149,381.00	0.05

4	000333	美的集团	3,482,648.00	0.04
5	002594	比亚迪	3,423,863.00	0.04
6	000858	五粮液	3,055,731.00	0.03
7	601888	中国中免	2,706,191.00	0.03
8	688343	云天励飞	2,693,368.86	0.03
9	000651	格力电器	2,146,432.00	0.02
10	300059	东方财富	2,015,307.00	0.02
11	600030	中信证券	1,885,444.25	0.02
12	000725	京东方 A	1,786,695.00	0.02
13	600887	伊利股份	1,523,006.00	0.02
14	601398	工商银行	1,451,828.00	0.02
15	000568	泸州老窖	1,391,492.00	0.02
16	600690	海尔智家	1,386,271.00	0.02
17	688249	晶合集成	1,337,352.92	0.01
18	300750	宁德时代	1,288,634.25	0.01
19	002415	海康威视	1,217,180.00	0.01
20	000001	平安银行	1,198,312.00	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。

### 7.5.3 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	266,845,060.81
卖出股票收入（成交）总额	131,502,670.17

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。

### 7.6 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	404,226,301.37	4.04
	其中：政策性金融债	404,226,301.37	4.04
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	404,226,301.37	4.04



7.7 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	220216	22 国开 16	4,000,000	404,226,301.37	4.04
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

7.8 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。

7.9 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。

7.10 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。

7.11 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。

7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.12.1 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。

7.12.2 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。

7.13 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，兴业银行股份有限公司、招商银行股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责、处罚的情况。本基金为指数型联接基金，主要采取复制策略，招商银行、兴业银行系目标 ETF 标的指数成份股，上述股票的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

7.13.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.13.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	9,040,190.94
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	5,921,180.13
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	14,961,371.07

#### 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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 7.13.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## §8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
342,991	19,379.94	1,889,700,520.18	28.43%	4,757,443,441.21	71.57%
24,283	27,849.51	464,986,979.27	68.76%	211,282,773.50	31.24%
367,274	19,939.92	2,354,687,499.45	32.15%	4,968,726,214.71	67.85%

### 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	1,578,634.31	0.02%
	华夏沪深 300ETF 联接 C	46,206.31	0.01%
	合计	1,624,840.62	0.02%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
----	------	-------------------

本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	华夏沪深 300ETF 联接 A	0
	华夏沪深 300ETF 联接 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	华夏沪深 300ETF 联接 A	0
	华夏沪深 300ETF 联接 C	0
	合计	0

## §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
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	6,371,979,758.34	224,993,115.23
本报告期基金总申购份额	704,885,161.32	1,531,019,261.24
减：本报告期基金总赎回份额	429,720,958.27	1,079,742,623.70
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	6,647,143,961.39	676,269,752.77

注：本基金自 2018 年 2 月 2 日增加 C 类基金份额类别。

## §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、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

##### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人及其高级管理人员在本报告期内无受稽查或处罚等情况。

##### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

#### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

##### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
海通证券	1	231,354,925.66	60.24%	30,375.31	17.60%	-
广发证券	4	152,707,017.94	39.76%	142,216.85	82.40%	-

注：①为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择券商的标准，即：

i 经营行为规范。

ii 公司财务状况良好。

iii 有良好的内控制度，在业内有良好的声誉。

iv 有较强的全方位金融服务能力和水平：能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

v 建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯和服务。

②券商专用交易单元选择程序：

i 本基金管理人根据上述标准进行评估并确定选用的券商。

ii 本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议/证券经纪服务协议。

③除本表列示外，本基金还选择了安信证券、长江证券、光大证券、招商证券、中金公司、中信建投证券、中信证券的交易单元作为本基金交易单元，本报告期无股票交易及应付佣金。

④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
海通证券	49,493.00	100.00%	-	-	-	-	3,325,929,365.80	100.00%
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-

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公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-01-06
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	中国证监会指定报刊及网站	2023-01-19
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	中国证监会指定报刊及网站	2023-02-24
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	中国证监会指定报刊及网站	2023-03-03
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	中国证监会指定报刊及网站	2023-03-11
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	中国证监会指定报刊及网站	2023-03-23
7	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	中国证监会指定报刊及网站	2023-03-30
8	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	中国证监会指定报刊及网站	2023-04-01
9	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	中国证监会指定报刊及网站	2023-04-13
10	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	中国证监会指定报刊及网站	2023-04-15
11	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	中国证监会指定报刊及网站	2023-05-13

12	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	中国证监会指定报刊及网站	2023-05-27
----	------------------------------	--------------	------------

## §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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					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	2023-01-01 至 2023-01-11	1,440,146,526.25	-	-	1,440,146,526.25	19.66%
产品特有风险							
<p>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。</p> <p>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。</p>							

## §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、《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》；
- 3、《华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》；
- 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

二〇二三年八月三十日