

**华夏中证 500 交易型开放式指数
证券投资基金
2025 年中期报告
2025 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：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二五年八月三十日

§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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 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 2025 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.....	4
§4 管理人报告.....	5
§5 托管人报告.....	11
§6 中期报告财务会计报告（未经审计）.....	12
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	13
6.3 净资产变动表.....	14
6.4 报表附注.....	15
§7 投资组合报告.....	39
7.1 期末基金资产组合情况.....	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	40
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	53
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	54
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.....	55
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.....	55
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.....	55
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.....	55
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	55
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	55
7.13 投资组合报告附注.....	56
§8 基金份额持有人信息.....	56
§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	华夏中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	华夏中证 500ETF
场内简称	中证 500（扩位证券简称：中证 500ETF 华夏）
基金主代码	512500
交易代码	512500
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2015 年 5 月 5 日
基金管理人	华夏基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	4,017,608,794 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2015 年 5 月 29 日

2.2 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、国债期货投资策略等。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为“中证 500 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	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李彬	王小飞
	联系电话	400-818-6666	021-6063 7103
	电子邮箱	service@ChinaAMC.com	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		400-818-6666	021-60637228
传真		010-63136700	021-60635778
注册地址		北京市顺义区安庆大街甲3号院	北京市西城区金融大街25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	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码		100101	100033
法定代表人		张佑君	张金良

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
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

2.5 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
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§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（2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	514,134,800.03
本期利润	642,008,890.20
加权平均基金份额本期利润	0.1570
本期加权平均净值利润率	4.97%
本期基金份额净值增长率	4.32%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2025年6月30日)
期末可供分配利润	-5,202,033,918.50
期末可供分配基金份额利润	-1.2948
期末基金资产净值	13,152,688,314.82
期末基金份额净值	3.2738
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-28.34%

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。

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

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	4.94%	0.78%	4.31%	0.79%	0.63%	-0.01%

月						
过去三个 月	1.95%	1.50%	0.98%	1.50%	0.97%	0.00%
过去六个 月	4.32%	1.35%	3.31%	1.36%	1.01%	-0.01%
过去一年	21.44%	1.72%	19.68%	1.72%	1.76%	0.00%
过去三年	-4.21%	1.35%	-8.35%	1.35%	4.14%	0.00%
自基金合 同生效起 至今	-28.34%	1.58%	-30.49%	1.61%	2.15%	-0.03%

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

华夏中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
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
(2015 年 5 月 5 日至 2025 年 6 月 30 日)



§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

华夏基金是境内 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 2025 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:在北交所主题偏股型基金(A 类)中华夏北交所创新中小企业精选两年定开混合发起式排名第 2/11;在灵活配置型基金(基准股票比例 30%-60%)(A 类)中华夏新锦绣混合 A 排名第 3/420、华夏稳增混合排名第 8/420;在混合型 FOF(权益资产 0-30%)(A 类)中华夏聚惠 FOF(A)排名第 8/75;在偏股型基金(股票上下限 60%-95%)(A 类)中华夏智造升级混合 A 排名第 14/1819、华夏成长精选 6 个月定开混合 A 排名第 24/1819、华夏磐润两年定开混合 A 排名第 28/1819、华夏招鑫鸿瑞混合 A 排名第 30/1819、华夏磐益一年定开混合排名第 108/1819、华夏远见成长一年持有混合 A 排名第 111/1819、华夏行业景气混合排名第 137/1819、华夏核心科技 6 个月定开混合 A 排名第 162/1819、华夏先锋科技一年定开混合 A 类排名第 173/1819、华夏价值精选混合排名第 180/1819;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 排名第 6/220、华夏磐锐一年定开混合 A 排名第 9/220;在汽车主题行业偏股型基金(A 类)中华夏汽车产业混合 A 排名第 3/16;在消费行业偏股型基金(A 类)中华夏消费臻选混合发起式 A 排名第 6/82;在养老目标风险 FOF(权益资产 0-30%)(A 类)中华夏稳健养老一年持有混合(FOF)A 排名第 7/81;在养老目标日期 FOF(2035)(A 类)中华夏福泽养

老目标 2035 三年持有混合发起式（FOF）A 排名第 4/24。

固收与固收+产品：在普通偏债型基金(股票上限不高于 30%)(A 类)中华夏磐泰混合（LOF）排名第 2/324、华夏永顺一年持有混合 A 排名第 12/324、华夏永康添福混合 A 排名第 29/324；在信用债指数债券型基金(A 类)中华夏亚债中国指数 A 排名第 2/19；在定开纯债债券型基金(A 类)中华夏鼎庆一年定开债券发起式排名第 3/662；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 5/257、华夏聚利债券 A 排名第 7/257；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 8/127；在长期纯债债券型基金(A 类)中华夏鼎茂债券 A 排名第 43/936；在中短期纯债债券型基金(A 类)中华夏中短债债券 A 排名第 22/165；在 QDII 债券型基金(A 类)中华夏收益债券（QDII）A（人民币）排名第 6/24；在普通偏债型基金(股票上限高于 30%)(A 类)中华夏永泓一年持有混合 A 排名第 13/259、华夏永鑫六个月持有混合 A 排名第 30/259。

在《中国证券报》第二十届中国基金业金牛奖评选中，华夏基金荣获“金牛奖 20 周年特别贡献公司”，连续 8 年荣获“被动投资金牛基金公司”，产品层面华夏创新前沿股票基金荣获“五年期开放式股票型持续优胜金牛基金”，华夏中证 5G 通信主题 ETF 荣获“开放式指数型金牛基金”。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上，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》主办的第二十届“金基金”奖评选活动上，华夏基金将三大金基金奖项收入囊中：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，华夏创新前沿股票基金荣获“金基金·股票型基金五年期奖”，华夏行业景气混合基金荣获“金基金·偏股混合型基金五年期奖”。

在客户服务方面，2025 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）华夏基金直销渠道继续优化页面显示及相关功能，新增双因子验证和交易时间预估功能，给客户更方便直观的使用体验；（2）华夏基金管家客户端新增恒生指数行情，动态追踪港股风向，行情了解更全面，从客户投资需求出发，进一步提升操作体验；（3）与高华证券、广州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“如何加入 DeepSeek 的朋友圈？”、“一些 ETF 小妙招送给大家”、“哪吒 2、DeepSeek 火出圈，如何抓住投资机遇？”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		
荣膺	本基金的	2016-10-20	-	15 年	硕士。2010 年 7 月加入华夏基

	基金经 理、投委 会成员			金管理有限公司。历任研究发展部高级产品经理，数量投资部研究员、投资经理、基金经理助理，华夏中证央企结构调整交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（2018 年 11 月 14 日至 2021 年 10 月 21 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（2016 年 10 月 20 日至 2018 年 9 月 16 日期间）、MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（2016 年 10 月 20 日至 2018 年 9 月 16 日期间）、上证主要消费交易型开放式指数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（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所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，严筱娴女士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 74 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中证 500 指数，中证 500 指数成份股是在扣除沪深 300 指数样本股及最近一年日均总市值排名前 300 名的股票后，选取成交金额及日均总市值排名在前 500 名的股票，中证 500 指数综合反映中国 A 股市场中一批中小市值公司的股票价格表现。本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。

上半年，宏观经济表现良好，GDP 同比增长 5.3%，PMI 冲高回落，物价水平低位运行。关税战扰动经济预期，尤其是造成金融资产价格大幅波动。利率结束去年以来的单边下行趋势，转为宽幅震荡格局。权益资产也曾在关税战初期出现单日大跌，但随后进入到稳健上升的慢牛趋势，且上升趋势愈发稳定。风格方面，哑铃策略为主，红利类的银行和小微盘表现强势。行业热点呈现阶段性轮动特征，人工智能、黄金、创新药、新消费等均有表现。

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、广发证券股份有限公司、国金证券股份有限公司、国泰海通证券股份有限公司、华安证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、浙商证券股份有限公司、中国国际金融股份有限公司、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、光大证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司等。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2025 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 3.2738 元，本报告期份额净值增长率为 4.32%，同期业绩比较基准增长率 3.31%。本基金本报告期跟踪偏离度为+1.01%，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，我们在本轮关税战表现强势，与八年前的贸易战相比，国家整体实力的进步有目共睹，无疑会提振投资者中长期信心。美元弱势，以及美联储降息预期带来美股大概率非熊市，有利于非美国权益资产表现。A 股 H 股估值水平适中，关键看盈利何时向上改善。关注反内卷政策何时会解决供需矛盾，从而带动价格体系回升，以及国内人工智能应用能否再次出现现象级爆款。

资金面的角度，股市持续呈现稳定上升趋势，会在某一时点令居民普遍意识到权益资产的赚钱效应；美元贬值人民币升值，北上资金存在大规模回流 A 股 H 股的可能性。

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。会计师事务所对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遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在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，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

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

本托管人复核审查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。

§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：华夏中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	214,525,671.05	47,910,882.67
结算备付金		84,467,286.56	103,009,927.41
存出保证金		38,727,102.66	19,141,476.80
交易性金融资产	6.4.7.2	12,816,311,817.24	13,485,646,077.06
其中：股票投资		12,816,068,801.26	13,485,646,077.06
基金投资		-	-
债券投资		243,015.98	-
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		157,303,031.12	40,352,906.05
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		13,311,334,908.63	13,696,061,269.99
负债和净资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 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		116,943,895.87	44,773,818.96

应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		1,511,278.25	1,828,496.98
应付托管费		503,759.42	609,498.99
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		0.50	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	39,687,659.77	6,869,530.70
负债合计		158,646,593.81	54,081,345.63
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	18,354,722,233.32	19,860,522,515.61
未分配利润	6.4.7.8	-5,202,033,918.50	-6,218,542,591.25
净资产合计		13,152,688,314.82	13,641,979,924.36
负债和净资产总计		13,311,334,908.63	13,696,061,269.99

注：报告截止日 2025 年 6 月 30 日，基金份额净值 3.2738 元，基金份额总额 4,017,608,794.00 份。

6.2 利润表

会计主体：华夏中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
一、营业总收入		655,858,453.56	-602,165,709.05
1.利息收入		654,313.39	2,479,351.61
其中：存款利息收入	6.4.7.9	654,313.39	594,511.58
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		-	1,884,840.03
2.投资收益（损失以“-”填列）		523,363,808.50	-23,864,005.07
其中：股票投资收益	6.4.7.10	404,431,148.21	-193,449,839.39
基金投资收益	6.4.7.11	-	-
债券投资收益	6.4.7.12	821,674.63	126,063.27
资产支持证券投资收益	6.4.7.13	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-694,340.44	537,939.03
股利收益	6.4.7.16	118,805,326.10	168,921,832.02
3.公允价值变动收益（损失以“-”	6.4.7.17	127,874,090.17	-580,505,025.76

号填列)			
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	3,966,241.50	-276,029.83
减：二、营业总支出		13,849,563.36	35,250,489.93
1.管理人报酬		9,613,299.23	27,878,633.05
2.托管费		3,204,433.06	5,575,726.64
3.销售服务费		-	-
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.信用减值损失	6.4.7.20	-	-
7.税金及附加		21,975.73	19,770.19
8.其他费用	6.4.7.21	1,009,855.34	1,776,360.05
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		642,008,890.20	-637,416,198.98
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		642,008,890.20	-637,416,198.98
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		642,008,890.20	-637,416,198.98

6.3 净资产变动表

会计主体：华夏中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 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	19,860,522,515.61	-6,218,542,591.25	13,641,979,924.36
二、本期期初净资产	19,860,522,515.61	-6,218,542,591.25	13,641,979,924.36
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-1,505,800,282.29	1,016,508,672.75	-489,291,609.54
（一）、综合收益总额	-	642,008,890.20	642,008,890.20
（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）	-1,505,800,282.29	374,499,782.55	-1,131,300,499.74
其中：1.基金申购款	6,604,323,073.56	-2,052,131,509.14	4,552,191,564.42
2.基金赎回款	-8,110,123,355.85	2,426,631,291.69	-5,683,492,064.16
（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	18,354,722,233.32	-5,202,033,918.50	13,152,688,314.82
项目	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	10,007,033,305.70	-3,588,744,009.56	6,418,289,296.14
二、本期期初净资产	10,007,033,305.70	-3,588,744,009.56	6,418,289,296.14
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	10,778,167,539.77	-4,931,378,807.89	5,846,788,731.88
（一）、综合收益总额	-	-637,416,198.98	-637,416,198.98
（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）	10,778,167,539.77	-4,293,962,608.91	6,484,204,930.86
其中：1.基金申购款	21,746,387,543.48	-8,420,097,856.52	13,326,289,686.96
2.基金赎回款	-10,968,220,003.71	4,126,135,247.61	-6,842,084,756.10
（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	20,785,200,845.47	-8,520,122,817.45	12,265,078,028.02

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：张佑君，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

华夏中证 500 交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）已获中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2015]113 号《关于准予华夏中证 500 交易型开放式指数证券投资基金及联接基金注册的批复》，由华夏基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《华夏中证 500 交易型开放式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。本基金为交易型开放式，存续期限为不定期。本基金自 2015 年 4 月 8 日至 2015 年 4 月 28 日期间共募集 2,134,343,230 元（不含认购资金利息），业经德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）德师报（验）字（15）第 0537 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华夏中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2015 年 5 月 5 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 2,134,473,505 份基金份额，其中认购资金利息折合 130,275 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，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《华夏中证 500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》，基金管理人华夏基金管理有限公司确定 2015 年 5 月 22 日为基金份额折算日，折算后的基金份额净值与 2015 年 5 月 22 日中证

500 指数收盘值的两千万分之一基本一致。折算前基金份额总额为 2,134,473,505 份，本次基金份额折算比例为 0.21889230，折算后基金份额总额为 467,208,794 份。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华夏中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股、替代性股票。为更好地实现投资目标，基金还可投资于非成份股、债券（含中小企业私募债券）、股指期货、国债期货、权证、货币市场工具、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》、财税[2023]39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

（1）以发行基金方式募集资金不属于增值税征收范围，不征收增值税。

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

（3）基金买卖股票、债券的差价收入免征增值税，暂不征收企业所得税。

（4）存款利息收入不征收增值税。

（5）国债、地方政府债利息收入，金融同业往来利息收入免征增值税。

（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费附加。

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 2025 年 6 月 30 日
活期存款	214,525,671.05
等于：本金	214,504,614.32
加：应计利息	21,056.73
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	214,525,671.05

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2025 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		12,106,344,352.47	-	12,816,068,801.26	709,724,448.79
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	243,000.00	15.98	243,015.98	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	243,000.00	15.98	243,015.98	-

资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	12,106,587,352.47	15.98	12,816,311,817.24	709,724,448.79

注：①股票投资的估值增值和股票投资的公允价值均包含可退替代款的估值增值。

②股票投资的成本、公允价值及公允价值变动均包含中国存托凭证的成本、公允价值及公允价值变动。

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 2025 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	297,768,440.00	-	-	-
其中：股指期货	297,768,440.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	297,768,440.00	-	-	-

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
IC2507	中证 500 期货 IC2507 合约	255	299,237,400.00	12,623,360.00
IC2508	中证 500 期货 IC2508 合约	10	11,650,800.00	496,400.00
合计	-	-	-	13,119,760.00
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	13,119,760.00
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 2025 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	1,898,529.70
其中：交易所市场	1,898,529.70
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	96,699.25
应付指数使用费	2,033,984.21
应退替代款	35,068,015.61
可退替代款	590,431.00
合计	39,687,659.77

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	4,347,208,794.00	19,860,522,515.61
本期申购	1,445,600,000.00	6,604,323,073.56
本期赎回（以“-”号填列）	-1,775,200,000.00	-8,110,123,355.85
本期末	4,017,608,794.00	18,354,722,233.32

6.4.7.8 未分配利润

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	15,732,764.06	-6,234,275,355.31	-6,218,542,591.25
本期期初	15,732,764.06	-6,234,275,355.31	-6,218,542,591.25
本期利润	514,134,800.03	127,874,090.17	642,008,890.20
本期基金份额交易产生的变动数	-7,720,301.48	382,220,084.03	374,499,782.55
其中：基金申购款	87,478,629.71	-2,139,610,138.85	-2,052,131,509.14
基金赎回款	-95,198,931.19	2,521,830,222.88	2,426,631,291.69

本期已分配利润	-	-	-
本期末	522,147,262.61	-5,724,181,181.11	-5,202,033,918.50

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	124,968.32
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	525,545.81
其他	3,799.26
合计	654,313.39

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	291,948,763.18
股票投资收益——赎回差价收入	112,482,385.03
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	404,431,148.21

6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	4,634,049,164.26
减：卖出股票成本总额	4,338,391,259.81
减：交易费用	3,709,141.27
买卖股票差价收入	291,948,763.18

6.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	5,683,492,064.16
减：现金支付赎回款总额	2,883,162,016.16
减：赎回股票成本总额	2,687,847,662.97
减：交易费用	-

赎回差价收入	112,482,385.03
--------	----------------

6.4.7.11 基金投资收益

无。

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 2025年1月1日至2025年6月30日
债券投资收益——利息收入	513.50
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	821,161.13
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	821,674.63

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 2025年1月1日至2025年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	6,082,417.50
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	5,260,500.00
减：应计利息总额	513.15
减：交易费用	243.22
买卖债券差价收入	821,161.13

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 2025年1月1日至2025年6月30日
股指期货投资收益	-694,340.44

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
股票投资产生的股利收益	118,805,326.10
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	118,805,326.10

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
1.交易性金融资产	110,376,770.17
——股票投资	110,376,770.17
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	17,497,320.00
——权证投资	-
——期货投资	17,497,320.00
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	127,874,090.17

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	3,965,881.04
其他	360.46
合计	3,966,241.50

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 2025年1月1日至2025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	269.87
指数使用费	908,312.04
存托服务费	4,574.18
合计	1,009,855.34

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

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
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人
中信证券股份有限公司（“中信证券”）	基金管理人的股东
华夏中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(“华夏中证 500ETF 联接”)	该基金是本基金的联接基金
中信中证资本管理有限公司（“中信中证资本”）	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 2025年1月1日至2025年6月30日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024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	-	-	10,622,775,643.72	69.13%

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 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	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2024年1月1日至2024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	1,101,600.69	34.28%	456,935.66	19.93%

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 2025年1月1日至2025年6月 30日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月30 日
当期发生的基金应支付的管理费	9,613,299.23	27,878,633.05
其中：应支付销售机构的客户维护费	49,615.08	129,753.62
应支付基金管理人的净管理费	9,563,684.15	27,748,879.43

注：①支付基金管理人的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

②基金管理人报酬计算公式为：日基金管理人报酬＝前一日基金资产净值×年费率/当年天数。

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 2025年1月1日至2025年6月 30日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月30 日
当期发生的基金应支付的托管费	3,204,433.06	5,575,726.64

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 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＝前一日基金资产净值×年费率/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

无。

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

单位：人民币元

本期 2025年1月1日至2025年6月30日

关联方名称	交易金额	费率区间 (%)	加权平均费率 (%)	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
中信证券	-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月30日						
关联方名称	交易金额	费率区间 (%)	加权平均费率 (%)	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
中信证券	757,934,088.56	0.41~5.60	1.22	331,401.72	7,864,593.00	1,190.23

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自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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2025 年 6 月 30 日		上年度末 2024 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
中信中证资本	-	-	299,500.00	0.01%
华夏中证 500ETF 联接	553,998,423.00	13.79%	606,362,823.00	13.95%
中信证券	1,345,461.00	0.03%	11,264,897.00	0.26%

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的相关费用符合基金招募说明书、交易所、登记结算机构的有关规定。

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 2025年1月1日至2025年6月30日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024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
中国建设银行活期存款	214,525,671.05	124,968.32	57,869,041.45	92,113.24

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国建设银行保管，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 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	301662	宏工科技	新股发行	1,429	38,011.40
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
上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	-	-	-	-	-

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

本基金本报告期通过中信期货买卖期货成交额为 9,303,960.00 元（上年度可比期间：0.00 元），支付给中信期货的佣金为 227.94 元（上年度可比期间：0.00 元）。

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（2025 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
688469	芯联集成	2025-01-09	6 个月	大宗转让流	4.10	4.74	2,000,100	8,200,410.00	9,480,474.00	-

				通受限						
689009	九号公司	2025-01-16	6 个月	大宗转让流通受限	45.65	58.30	120,100	5,482,565.00	7,001,830.00	-
301236	软通动力	2025-01-21	6 个月	大宗转让流通受限	50.81	53.82	100,100	5,086,081.00	5,387,382.00	-
002156	通富微电	2025-01-17	6 个月	大宗转让流通受限	25.62	25.34	200,100	5,126,562.00	5,070,534.00	-
002156	通富微电	2025-01-21	6 个月	大宗转让流通受限	26.00	25.31	200,100	5,202,600.00	5,064,531.00	-
688234	天岳先进	2025-01-16	6 个月	大宗转让流通受限	50.59	57.89	80,100	4,052,259.00	4,636,989.00	-
68877	影石	2025-06-04	6 个月	新	47.2	124.1	573	27,085.71	71,143.68	-

5	创新			发 流 通 受 限	7	6				
603049	中策橡胶	2025-05-27	6 个月	新发 流 通 受 限	46.50	42.85	724	33,666.00	31,023.40	-
688545	兴福电子	2025-01-15	6 个月	新发 流 通 受 限	11.68	26.95	994	11,609.92	26,788.30	-
301458	钧崴电子	2025-01-02	6 个月	新发 流 通 受 限	10.40	34.11	701	7,290.40	23,911.11	-
301275	汉朔科技	2025-03-04	6 个月	新发 流 通 受 限	27.50	56.19	397	10,917.50	22,307.43	-
688583	思看科技	2025-01-08	6 个月	新发 流 通 受 限	33.46	79.68	227	5,855.50	18,087.36	含 证 券 送 配
301678	新恒汇	2025-06-13	6 个月	新发 流 通 受 限	12.80	44.54	382	4,889.60	17,014.28	-
301602	超研股份	2025-01-15	6 个月	新发 流	6.70	24.80	658	4,408.60	16,318.40	-

				通 受 限						
30150 1	恒鑫 生活	2025-03-11	6 个月	新发 流通 受限	39.9 2	45.22	350	9,620.72	15,827.00	含 证 券 送 配
60320 2	天有 为	2025-04-16	6 个月	新发 流通 受限	93.5 0	90.66	166	15,521.00	15,049.56	-
30147 9	弘景 光电	2025-03-06	6 个月	新发 流通 受限	41.9 0	77.87	182	5,447.00	14,172.34	含 证 券 送 配
30153 5	浙江 华远	2025-03-18	6 个月	新发 流通 受限	4.92	18.99	734	3,611.28	13,938.66	-
68875 7	胜科 纳米	2025-03-18	6 个月	新发 流通 受限	9.08	25.94	536	4,866.88	13,903.84	-
00138 8	信通 电子	2025-06-24	1 个月 内 (含)	新发 流通 受限	16.4 2	16.42	843	13,842.06	13,842.06	-
60307 2	天和 磁材	2024-12-24	6 个月	新发 流通 受	12.3 0	54.45	226	2,779.80	12,305.70	-

				限						
301662	宏工科技	2025-04-10	6 个月	新发流通受限	26.60	82.50	143	3,803.80	11,797.50	-
301601	惠通科技	2025-01-08	6 个月	新发流通受限	11.80	33.85	342	4,035.60	11,576.70	-
001356	富岭股份	2025-01-16	6 个月	新发流通受限	5.30	14.44	709	3,757.70	10,237.96	-
301658	首航新能	2025-03-26	6 个月	新发流通受限	11.80	22.98	437	5,156.60	10,042.26	-
301665	泰禾股份	2025-04-02	6 个月	新发流通受限	10.27	22.39	393	4,036.11	8,799.27	-
688755	汉邦科技	2025-05-09	6 个月	新发流通受限	22.77	39.33	203	4,622.31	7,983.99	-
301173	毓恬冠佳	2025-02-24	6 个月	新发流通受限	28.33	44.98	173	4,901.09	7,781.54	-
00138	新亚	2025-03-13	6 个月	新	7.40	20.21	366	2,708.40	7,396.86	-

2	电缆			发 流 通 受 限						
603014	威高血净	2025-05-12	6 个月	新发 流 通 受 限	26.50	32.68	205	5,432.50	6,699.40	-
301636	泽润新能	2025-04-30	6 个月	新发 流 通 受 限	33.06	47.46	128	4,231.68	6,074.88	-
301595	太力科技	2025-05-12	6 个月	新发 流 通 受 限	17.05	29.10	196	3,341.80	5,703.60	-
301560	众捷汽车	2025-04-17	6 个月	新发 流 通 受 限	16.50	27.45	190	3,135.00	5,215.50	-
603210	泰鸿万立	2025-04-01	6 个月	新发 流 通 受 限	8.60	15.61	286	2,459.60	4,464.46	-
603271	永杰新材	2025-03-04	6 个月	新发 流 通 受 限	20.60	35.08	126	2,595.60	4,420.08	-
603124	江南新材	2025-03-12	6 个月	新发 流	10.54	46.31	88	927.52	4,075.28	-

				通 受 限						
00139 5	亚联 机械	2025-01-20	6 个月	新发 流 通 受 限	19.0 8	47.25	80	1,526.40	3,780.00	-
60340 9	汇通 控股	2025-02-25	6 个月	新发 流 通 受 限	24.1 8	33.32	100	2,418.00	3,332.00	-
00139 0	古麒 绒材	2025-05-21	6 个月	新发 流 通 受 限	12.0 8	18.12	178	2,150.24	3,225.36	-
60325 7	中国 瑞林	2025-03-28	6 个月	新发 流 通 受 限	20.5 2	37.47	78	1,600.56	2,922.66	-
60340 0	华之 杰	2025-06-12	6 个月	新发 流 通 受 限	19.8 8	43.81	57	1,133.16	2,497.17	-
60338 2	海阳 科技	2025-06-05	6 个月	新发 流 通 受 限	11.5 0	22.39	105	1,207.50	2,350.95	-
00133 5	信凯 科技	2025-04-02	6 个月	新发 流 通 受	12.8 0	28.05	80	1,024.00	2,244.00	-

				限						
603120	肯特催化	2025-04-09	6 个月	新发流通受限	15.00	33.43	65	975.00	2,172.95	-
001388	信通电子	2025-06-24	6 个月	新发流通受限	16.42	16.42	94	1,543.48	1,543.48	-
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
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(张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
123257	安克转债	2025-06-16	1 个月内（含）	新发流通受限	100.00	100.01	2,430	243,000.00	243,015.98	期末估值单价为含息价格

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內。

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，本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股，如需对组合进行调整时，由于投资标的流动性较好，市场冲击成本较小，基金投资组合收益偏离投资目标收益的风险较小。基金管理人持续监测本基金持有资产的市场交易量、交易集中度等涉及资产流动性水平的风险指标，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。

本基金为指数型基金，采用完全复制策略。本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。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。

本基金为指数型基金，采用完全复制策略。本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。

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 2025 年 6 月 30 日		上年度末 2024 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	12,816,068,801.26	97.44	13,485,646,077.06	98.85
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	243,015.98	0.00	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	12,816,311,817.24	97.44	13,485,646,077.06	98.85

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	除中证 500 指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
	-5%	-658,603,652.39	-687,582,920.12
	+5%	658,603,652.39	687,582,920.12

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 2025 年 6 月 30 日
第一层次	12,778,965,090.29
第二层次	258,401.52
第三层次	37,088,325.43
合计	12,816,311,817.24

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 2025 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	12,816,068,801.26	96.28
	其中：股票	12,816,068,801.26	96.28
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	243,015.98	0.00
	其中：债券	243,015.98	0.00
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-

6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	298,992,957.61	2.25
8	其他各项资产	196,030,133.78	1.47
9	合计	13,311,334,908.63	100.00

注：股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值。

7.2 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	31,993,485.84	0.24
B	采矿业	458,359,823.36	3.48
C	制造业	8,112,656,300.91	61.68
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	411,448,551.82	3.13
E	建筑业	112,734,225.10	0.86
F	批发和零售业	281,316,716.02	2.14
G	交通运输、仓储和邮政业	212,524,564.97	1.62
H	住宿和餐饮业	34,445,448.66	0.26
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,193,781,938.22	9.08
J	金融业	1,261,248,941.69	9.59
K	房地产业	158,693,404.30	1.21
L	租赁和商务服务业	110,234,598.82	0.84
M	科学研究和技术服务业	86,735,932.96	0.66
N	水利、环境和公共设施管理业	53,792,628.44	0.41
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	26,313,552.00	0.20
Q	卫生和社会工作	58,989,408.96	0.45
R	文化、体育和娱乐业	180,274,681.10	1.37
S	综合	30,524,598.09	0.23
	合计	12,816,068,801.26	97.44

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	300476	胜宏科技	1,051,400	141,287,132.00	1.07
2	000988	华工科技	1,754,176	82,463,813.76	0.63
3	600988	赤峰黄金	2,899,021	72,127,642.48	0.55
4	300339	润和软件	1,388,500	70,577,455.00	0.54
5	002966	苏州银行	7,795,370	68,443,348.60	0.52

6	600839	四川长虹	6,437,689	62,574,337.08	0.48
7	601162	天风证券	12,379,900	61,032,907.00	0.46
8	601555	东吴证券	6,928,870	60,627,612.50	0.46
9	688521	芯原股份	614,592	59,308,128.00	0.45
10	689009	九号公司	966,998	57,112,784.66	0.43
11	002340	格林美	8,936,000	56,743,600.00	0.43
12	002517	恺英网络	2,897,800	55,956,518.00	0.43
13	002195	岩山科技	9,903,568	55,757,087.84	0.42
14	603893	瑞芯微	366,200	55,611,132.00	0.42
15	002558	巨人网络	2,360,732	55,595,238.60	0.42
16	002156	通富微电	2,122,887	54,270,305.94	0.41
17	002261	拓维信息	1,753,100	54,258,445.00	0.41
18	600487	亨通光电	3,433,708	52,535,732.40	0.40
19	002797	第一创业	7,327,700	51,880,116.00	0.39
20	300251	光线传媒	2,554,600	51,781,742.00	0.39
21	300207	欣旺达	2,571,600	51,586,296.00	0.39
22	688608	恒玄科技	145,031	50,467,887.38	0.38
23	300803	指南针	623,980	50,330,226.80	0.38
24	600157	永泰能源	37,379,800	50,088,932.00	0.38
25	000066	中国长城	3,373,000	49,920,400.00	0.38
26	688213	思特威	485,480	49,625,765.60	0.38
27	688777	中控技术	1,100,591	49,427,541.81	0.38
28	600096	云天化	2,225,300	48,889,841.00	0.37
29	600536	中国软件	1,035,856	48,446,985.12	0.37
30	002273	水晶光电	2,423,351	48,394,319.47	0.37
31	601168	西部矿业	2,906,248	48,330,904.24	0.37
32	688120	华海清科	285,996	48,247,525.20	0.37
33	002465	海格通信	3,459,100	48,219,854.00	0.37
34	600879	航天电子	4,601,074	48,173,244.78	0.37
35	300450	先导智能	1,910,700	47,480,895.00	0.36
36	000831	中国稀土	1,296,200	46,818,744.00	0.36
37	601099	太平洋	11,878,100	46,680,933.00	0.35
38	688235	百济神州	198,575	46,395,063.00	0.35
39	600352	浙江龙盛	4,537,692	46,102,950.72	0.35
40	002294	信立泰	971,271	45,970,256.43	0.35
41	300017	网宿科技	4,263,000	45,699,360.00	0.35
42	000933	神火股份	2,745,500	45,685,120.00	0.35
43	600885	宏发股份	2,033,587	45,369,325.97	0.34
44	002185	华天科技	4,475,217	45,199,691.70	0.34
45	601108	财通证券	5,664,950	44,809,754.50	0.34
46	688002	睿创微纳	639,038	44,553,729.36	0.34
47	688617	惠泰医疗	146,026	43,369,722.00	0.33
48	601128	常熟银行	5,787,431	42,653,366.47	0.32

49	688099	晶晨股份	590,947	41,963,146.47	0.32
50	002130	沃尔核材	1,758,300	41,882,706.00	0.32
51	601577	长沙银行	4,205,584	41,803,504.96	0.32
52	600079	人福医药	1,990,000	41,750,200.00	0.32
53	002281	光迅科技	844,915	41,671,207.80	0.32
54	300454	深信服	441,600	41,589,888.00	0.32
55	002085	万丰奥威	2,593,400	41,209,126.00	0.31
56	688122	西部超导	794,167	41,201,383.96	0.31
57	000423	东阿阿胶	787,500	41,186,250.00	0.31
58	688469	芯联集成	8,631,244	41,111,030.88	0.31
59	002595	豪迈科技	690,855	40,912,433.10	0.31
60	000997	新大陆	1,261,050	40,832,799.00	0.31
61	300223	北京君正	587,514	40,655,968.80	0.31
62	002738	中矿资源	1,259,380	40,501,660.80	0.31
63	300058	蓝色光标	6,165,959	40,448,691.04	0.31
64	002532	天山铝业	4,863,600	40,416,516.00	0.31
65	300002	神州泰岳	3,419,698	40,352,436.40	0.31
66	000783	长江证券	5,791,500	40,135,095.00	0.31
67	300458	全志科技	1,006,330	39,941,237.70	0.30
68	603129	春风动力	184,303	39,901,599.50	0.30
69	300474	景嘉微	545,806	39,843,838.00	0.30
70	600109	国金证券	4,531,000	39,736,870.00	0.30
71	002472	双环传动	1,184,700	39,675,603.00	0.30
72	002138	顺络电子	1,405,590	39,525,190.80	0.30
73	002078	太阳纸业	2,921,672	39,325,705.12	0.30
74	603596	伯特利	742,090	39,100,722.10	0.30
75	002436	兴森科技	2,943,900	38,977,236.00	0.30
76	601933	永辉超市	7,908,900	38,753,610.00	0.29
77	002410	广联达	2,879,000	38,607,390.00	0.29
78	002851	麦格米特	763,100	38,261,834.00	0.29
79	688525	佰维存储	566,821	38,203,735.40	0.29
80	300346	南大光电	1,207,080	38,192,011.20	0.29
81	300765	新诺威	736,800	38,085,192.00	0.29
82	600862	中航高科	1,456,202	37,977,748.16	0.29
83	002850	科达利	335,200	37,934,584.00	0.29
84	600143	金发科技	3,677,020	37,910,076.20	0.29
85	300136	信维通信	1,688,800	37,829,120.00	0.29
86	300024	机器人	2,197,700	37,756,486.00	0.29
87	600580	卧龙电驱	1,906,660	37,694,668.20	0.29
88	601198	东兴证券	3,379,098	37,676,942.70	0.29
89	300054	鼎龙股份	1,309,571	37,558,496.28	0.29
90	002065	东华软件	3,909,700	37,533,120.00	0.29
91	002353	杰瑞股份	1,069,399	37,428,965.00	0.28

92	300395	菲利华	730,712	37,339,383.20	0.28
93	000034	神州数码	991,300	37,312,532.00	0.28
94	603606	东方电缆	721,500	37,308,765.00	0.28
95	002223	鱼跃医疗	1,047,319	37,284,556.40	0.28
96	600298	安琪酵母	1,057,848	37,204,514.16	0.28
97	600873	梅花生物	3,474,313	37,140,405.97	0.28
98	688072	拓荆科技	241,394	37,104,671.74	0.28
99	002202	金风科技	3,611,597	37,018,869.25	0.28
100	002673	西部证券	4,675,055	36,839,433.40	0.28
101	600363	联创光电	630,700	36,788,731.00	0.28
102	300496	中科创达	639,600	36,597,912.00	0.28
103	601615	明阳智能	3,168,400	36,404,916.00	0.28
104	688578	艾力斯	388,330	36,130,223.20	0.27
105	300857	协创数据	419,580	36,109,054.80	0.27
106	000728	国元证券	4,565,629	36,022,812.81	0.27
107	002624	完美世界	2,367,000	35,907,390.00	0.27
108	300383	光环新网	2,505,100	35,822,930.00	0.27
109	002008	大族激光	1,466,700	35,743,479.00	0.27
110	000021	深科技	1,904,000	35,680,960.00	0.27
111	300115	长盈精密	1,661,100	35,547,540.00	0.27
112	603659	璞泰来	1,862,565	34,978,970.70	0.27
113	600549	厦门钨业	1,662,490	34,779,290.80	0.26
114	600895	张江高科	1,350,143	34,698,675.10	0.26
115	300604	长川科技	771,200	34,634,592.00	0.26
116	603605	珀莱雅	414,958	34,354,372.82	0.26
117	603087	甘李药业	626,900	34,341,582.00	0.26
118	603160	汇顶科技	483,000	34,307,490.00	0.26
119	300012	华测检测	2,932,200	34,277,418.00	0.26
120	000426	兴业银锡	2,168,700	34,265,460.00	0.26
121	002155	湖南黄金	1,906,480	34,030,668.00	0.26
122	688220	翱捷科技	433,170	33,917,211.00	0.26
123	600171	上海贝岭	987,900	33,835,575.00	0.26
124	000733	振华科技	673,916	33,729,495.80	0.26
125	300627	华测导航	953,576	33,375,160.00	0.25
126	605589	圣泉集团	1,182,600	32,817,150.00	0.25
127	688361	中科飞测	386,604	32,548,190.76	0.25
128	601216	君正集团	5,884,800	32,484,096.00	0.25
129	600392	盛和资源	2,442,857	32,172,426.69	0.24
130	300037	新宙邦	912,720	32,127,744.00	0.24
131	000750	国海证券	7,794,743	32,114,341.16	0.24
132	601665	齐鲁银行	5,080,095	32,106,200.40	0.24
133	300699	光威复材	1,013,642	32,102,042.14	0.24
134	002444	巨星科技	1,251,068	31,914,744.68	0.24

135	601997	贵阳银行	5,098,420	31,814,140.80	0.24
136	688180	君实生物	935,109	31,775,003.82	0.24
137	000932	华菱钢铁	7,219,920	31,767,648.00	0.24
138	000729	燕京啤酒	2,455,452	31,748,994.36	0.24
139	300003	乐普医疗	2,295,400	31,630,612.00	0.24
140	600060	海信视像	1,365,060	31,423,681.20	0.24
141	600153	建发股份	3,029,694	31,417,926.78	0.24
142	000519	中兵红箭	1,430,495	31,313,535.55	0.24
143	601717	郑煤机	1,881,400	31,268,868.00	0.24
144	601990	南京证券	3,853,700	31,137,896.00	0.24
145	000878	云南铜业	2,443,800	31,085,136.00	0.24
146	601233	桐昆股份	2,932,530	31,084,818.00	0.24
147	601696	中银证券	2,904,000	31,043,760.00	0.24
148	300001	特锐德	1,289,502	30,909,362.94	0.24
149	002821	凯莱英	349,700	30,861,025.00	0.23
150	300073	当升科技	699,856	30,702,682.72	0.23
151	300142	沃森生物	2,788,300	30,671,300.00	0.23
152	600673	东阳光	2,624,643	30,524,598.09	0.23
153	002414	高德红外	2,976,100	30,505,025.00	0.23
154	600369	西南证券	6,949,800	30,231,630.00	0.23
155	603979	金诚信	650,400	30,204,576.00	0.23
156	002837	英维克	1,012,389	30,078,077.19	0.23
157	688052	纳芯微	172,194	30,046,131.06	0.23
158	600699	均胜电子	1,720,275	30,001,596.00	0.23
159	002007	华兰生物	1,910,994	29,945,275.98	0.23
160	688065	凯赛生物	631,913	29,763,102.30	0.23
161	300373	扬杰科技	567,200	29,437,680.00	0.22
162	600118	中国卫星	1,029,484	29,412,357.88	0.22
163	600177	雅戈尔	4,025,997	29,389,778.10	0.22
164	600521	华海药业	1,574,985	29,341,970.55	0.22
165	688027	国盾量子	106,517	29,293,240.17	0.22
166	600398	海澜之家	4,185,677	29,132,311.92	0.22
167	000893	亚钾国际	966,200	29,121,268.00	0.22
168	002152	广电运通	2,166,500	29,117,760.00	0.22
169	603345	安井食品	359,000	28,870,780.00	0.22
170	600435	北方导航	1,841,375	28,707,036.25	0.22
171	600704	物产中大	5,432,055	28,626,929.85	0.22
172	300748	金力永磁	1,199,360	28,592,742.40	0.22
173	600909	华安证券	4,900,004	28,567,023.32	0.22
174	000738	航发控制	1,375,967	28,551,315.25	0.22
175	688249	晶合集成	1,398,663	28,350,899.01	0.22
176	600316	洪都航空	751,957	28,348,778.90	0.22
177	000623	吉林敖东	1,670,087	28,307,974.65	0.22

178	600497	驰宏锌锗	5,322,200	28,154,438.00	0.21
179	002044	美年健康	5,460,600	28,067,484.00	0.21
180	000009	中国宝安	3,148,832	27,961,628.16	0.21
181	002318	久立特材	1,194,800	27,946,372.00	0.21
182	002958	青农商行	7,741,100	27,945,371.00	0.21
183	688385	复旦微电	565,739	27,873,960.53	0.21
184	603179	新泉股份	593,200	27,862,604.00	0.21
185	600038	中直股份	716,897	27,822,772.57	0.21
186	600765	中航重机	1,644,877	27,765,523.76	0.21
187	600141	兴发集团	1,346,672	27,647,176.16	0.21
188	600562	国睿科技	866,500	27,286,085.00	0.21
189	002409	雅克科技	497,500	27,208,275.00	0.21
190	603228	景旺电子	649,823	27,188,594.32	0.21
191	000400	许继电气	1,245,000	27,103,650.00	0.21
192	000528	柳工	2,815,960	27,061,375.60	0.21
193	600155	华创云信	3,884,500	27,036,120.00	0.21
194	002683	广东宏大	796,463	27,031,954.22	0.21
195	001696	宗申动力	1,199,970	26,939,326.50	0.20
196	300919	中伟股份	818,120	26,899,785.60	0.20
197	000960	锡业股份	1,723,098	26,363,399.40	0.20
198	300724	捷佳伟创	484,700	26,319,210.00	0.20
199	002607	中公教育	8,599,200	26,313,552.00	0.20
200	600637	东方明珠	3,518,172	26,280,744.84	0.20
201	688188	柏楚电子	199,095	26,212,847.70	0.20
202	600498	烽火通信	1,240,400	26,085,612.00	0.20
203	300757	罗博特科	173,680	26,046,789.60	0.20
204	600884	杉杉股份	2,745,045	25,968,125.70	0.20
205	300623	捷捷微电	871,035	25,956,843.00	0.20
206	603939	益丰药房	1,055,228	25,821,429.16	0.20
207	300558	贝达药业	440,400	25,521,180.00	0.19
208	688568	中科星图	707,994	25,494,863.94	0.19
209	600529	山东药玻	1,150,600	25,474,284.00	0.19
210	600563	法拉电子	233,038	25,422,115.42	0.19
211	002841	视源股份	730,300	25,268,380.00	0.19
212	002739	万达电影	2,210,300	25,263,729.00	0.19
213	000039	中集集团	3,212,090	25,247,027.40	0.19
214	000415	渤海租赁	7,546,200	25,128,846.00	0.19
215	301358	湖南裕能	793,700	24,755,503.00	0.19
216	600486	扬农化工	425,719	24,691,702.00	0.19
217	002653	海思科	584,380	24,672,523.60	0.19
218	002025	航天电器	477,714	24,559,276.74	0.19
219	002926	华西证券	2,746,300	24,551,922.00	0.19
220	600901	江苏金租	4,040,098	24,482,993.88	0.19

221	002385	大北农	5,997,929	24,231,633.16	0.18
222	000887	中鼎股份	1,377,300	24,226,707.00	0.18
223	300285	国瓷材料	1,390,605	24,126,996.75	0.18
224	300763	锦浪科技	418,200	24,000,498.00	0.18
225	688017	绿的谐波	189,725	23,694,755.25	0.18
226	002939	长城证券	2,813,200	23,574,616.00	0.18
227	300144	宋城演艺	2,743,974	23,460,977.70	0.18
228	300679	电连技术	516,600	23,443,308.00	0.18
229	002568	百润股份	914,860	23,429,564.60	0.18
230	603486	科沃斯	401,800	23,396,814.00	0.18
231	600820	隧道股份	3,834,900	23,392,890.00	0.18
232	600863	内蒙华电	5,687,040	23,373,734.40	0.18
233	688114	华大智造	359,435	23,302,171.05	0.18
234	600132	重庆啤酒	422,301	23,268,785.10	0.18
235	688582	芯动联科	345,800	23,237,760.00	0.18
236	000723	美锦能源	5,367,104	23,185,889.28	0.18
237	600008	首创环保	7,674,907	23,178,219.14	0.18
238	002080	中材科技	1,172,800	22,869,600.00	0.17
239	002064	华峰化学	3,458,400	22,860,024.00	0.17
240	600390	五矿资本	3,917,900	22,841,357.00	0.17
241	600516	方大炭素	4,914,374	22,802,695.36	0.17
242	603568	伟明环保	1,190,780	22,720,082.40	0.17
243	000513	丽珠集团	630,243	22,713,957.72	0.17
244	002312	川发龙蟒	1,975,000	22,673,000.00	0.17
245	000703	恒逸石化	3,853,827	22,660,502.76	0.17
246	600998	九州通	4,401,223	22,622,286.22	0.17
247	688538	和辉光电	9,645,060	22,569,440.40	0.17
248	600763	通策医疗	544,932	22,494,792.96	0.17
249	600166	福田汽车	8,276,000	22,427,960.00	0.17
250	300487	蓝晓科技	442,750	22,270,325.00	0.17
251	600170	上海建工	9,288,700	22,199,993.00	0.17
252	002262	恩华药业	1,061,458	22,057,097.24	0.17
253	688183	生益电子	430,695	22,051,584.00	0.17
254	603816	顾家家居	860,300	21,954,856.00	0.17
255	601179	中国西电	3,575,357	21,952,691.98	0.17
256	600208	衢州发展	7,415,900	21,951,064.00	0.17
257	002500	山西证券	3,754,660	21,927,214.40	0.17
258	600312	平高电气	1,418,800	21,835,332.00	0.17
259	605358	立昂微	936,056	21,810,104.80	0.17
260	300676	华大基因	437,860	21,792,292.20	0.17
261	603589	口子窖	625,800	21,777,840.00	0.17
262	000683	博源化工	4,539,500	21,744,205.00	0.17
263	002203	海亮股份	2,092,900	21,598,728.00	0.16

264	600021	上海电力	2,453,376	21,565,175.04	0.16
265	601155	新城控股	1,574,100	21,533,688.00	0.16
266	600985	淮北矿业	1,877,600	21,291,984.00	0.16
267	600126	杭钢股份	2,354,307	21,188,763.00	0.16
268	002244	滨江集团	2,171,494	21,172,066.50	0.16
269	000403	派林生物	1,166,340	21,145,744.20	0.16
270	600380	健康元	1,912,663	21,096,672.89	0.16
271	002432	九安医疗	577,500	21,038,325.00	0.16
272	600583	海油工程	3,851,800	21,030,828.00	0.16
273	000591	太阳能	4,779,700	20,982,883.00	0.16
274	601000	唐山港	5,163,952	20,965,645.12	0.16
275	688728	格科微	1,360,240	20,947,696.00	0.16
276	600348	华阳股份	3,145,160	20,946,765.60	0.16
277	603338	浙江鼎力	441,570	20,930,418.00	0.16
278	000060	中金岭南	4,562,300	20,895,334.00	0.16
279	000921	海信家电	808,550	20,779,735.00	0.16
280	300567	精测电子	342,800	20,777,108.00	0.16
281	000629	钒钛股份	8,100,207	20,736,529.92	0.16
282	603885	吉祥航空	1,531,630	20,631,056.10	0.16
283	600872	中炬高新	1,084,600	20,607,400.00	0.16
284	000830	鲁西化工	1,996,600	20,564,980.00	0.16
285	601991	大唐发电	6,482,252	20,548,738.84	0.16
286	002603	以岭药业	1,455,700	20,525,370.00	0.16
287	603379	三美股份	426,089	20,503,402.68	0.16
288	600535	天士力	1,303,020	20,392,263.00	0.16
289	002439	启明星辰	1,268,600	20,284,914.00	0.15
290	002984	森麒麟	1,081,440	20,277,000.00	0.15
291	688278	特宝生物	280,840	20,251,372.40	0.15
292	600816	建元信托	6,864,800	20,251,160.00	0.15
293	002056	横店东磁	1,417,700	20,060,455.00	0.15
294	300146	汤臣倍健	1,780,031	20,007,548.44	0.15
295	600095	湘财股份	1,992,000	19,979,760.00	0.15
296	600970	中材国际	2,301,045	19,742,966.10	0.15
297	000062	深圳华强	731,600	19,650,776.00	0.15
298	600499	科达制造	2,004,100	19,640,180.00	0.15
299	002423	中粮资本	1,604,400	19,621,812.00	0.15
300	603927	中科软	1,013,012	19,591,652.08	0.15
301	601016	节能风电	6,767,934	19,559,329.26	0.15
302	600685	中船防务	718,200	19,527,858.00	0.15
303	603000	人民网	963,254	19,467,363.34	0.15
304	000636	风华高科	1,411,781	19,397,870.94	0.15
305	601611	中国核建	2,103,700	19,333,003.00	0.15
306	300390	天华新能	1,012,911	19,316,212.77	0.15

307	000958	电投产融	2,815,300	19,256,652.00	0.15
308	601666	平煤股份	2,590,700	19,197,087.00	0.15
309	603298	杭叉集团	913,400	19,135,730.00	0.15
310	300212	易华录	879,080	19,128,780.80	0.15
311	600511	国药股份	655,554	19,115,954.64	0.15
312	000563	陕国投 A	5,346,800	19,088,076.00	0.15
313	600859	王府井	1,371,617	19,051,760.13	0.14
314	301308	江波龙	217,038	18,988,654.62	0.14
315	000155	川能动力	1,930,400	18,956,528.00	0.14
316	603737	三棵树	513,851	18,935,409.35	0.14
317	601880	辽港股份	12,616,190	18,924,285.00	0.14
318	601456	国联民生	1,826,367	18,902,898.45	0.14
319	603077	和邦生物	10,787,064	18,877,362.00	0.14
320	600655	豫园股份	3,394,700	18,840,585.00	0.14
321	600004	白云机场	2,065,500	18,796,050.00	0.14
322	000598	兴蓉环境	2,603,656	18,772,359.76	0.14
323	601966	玲珑轮胎	1,276,800	18,730,656.00	0.14
324	300677	英科医疗	790,180	18,711,462.40	0.14
325	600325	华发股份	3,836,376	18,683,151.12	0.14
326	600483	福能股份	1,937,505	18,677,548.20	0.14
327	688297	中无人机	349,497	18,663,139.80	0.14
328	603156	养元饮品	879,281	18,605,585.96	0.14
329	603899	晨光股份	640,333	18,563,253.67	0.14
330	002773	康弘药业	640,400	18,552,388.00	0.14
331	600131	国网信通	1,045,644	18,507,898.80	0.14
332	601958	金钼股份	1,689,100	18,478,754.00	0.14
333	688520	神州细胞	307,444	18,400,523.40	0.14
334	000050	深天马 A	2,144,400	18,270,288.00	0.14
335	600663	陆家嘴	2,055,166	18,208,770.76	0.14
336	600378	昊华科技	672,400	18,201,868.00	0.14
337	688301	奕瑞科技	207,335	18,164,619.35	0.14
338	600282	南钢股份	4,297,100	18,047,820.00	0.14
339	300529	健帆生物	836,390	18,040,932.30	0.14
340	000987	越秀资本	2,625,858	18,013,385.88	0.14
341	002507	涪陵榨菜	1,408,022	18,008,601.38	0.14
342	000951	中国重汽	1,023,100	17,986,098.00	0.14
343	600754	锦江酒店	798,100	17,909,364.00	0.14
344	600271	航天信息	1,936,900	17,896,956.00	0.14
345	600598	北大荒	1,241,104	17,896,719.68	0.14
346	002756	永兴材料	562,830	17,869,852.50	0.14
347	301536	星辰科技	295,500	17,818,650.00	0.14
348	601001	晋控煤业	1,457,900	17,815,538.00	0.14
349	300601	康泰生物	1,170,900	17,785,971.00	0.14

350	600739	辽宁成大	1,602,774	17,630,514.00	0.13
351	000559	万向钱潮	2,304,189	17,627,045.85	0.13
352	600737	中粮糖业	1,863,953	17,614,355.85	0.13
353	601918	新集能源	2,710,067	17,507,032.82	0.13
354	688234	天岳先进	296,657	17,316,401.35	0.13
355	600582	天地科技	2,884,400	17,277,556.00	0.13
356	002429	兆驰股份	3,943,600	17,272,968.00	0.13
357	688363	华熙生物	332,533	17,075,569.55	0.13
358	601333	广深铁路	5,908,401	17,075,278.89	0.13
359	300070	碧水源	3,790,300	17,056,350.00	0.13
360	688772	珠海冠宇	1,186,240	16,951,369.60	0.13
361	601866	中远海发	6,853,238	16,927,497.86	0.13
362	002120	韵达股份	2,525,000	16,917,500.00	0.13
363	603728	鸣志电器	293,900	16,890,433.00	0.13
364	600566	济川药业	640,825	16,872,922.25	0.13
365	601231	环旭电子	1,152,500	16,861,075.00	0.13
366	600867	通化东宝	2,055,319	16,853,615.80	0.13
367	600764	中国海防	495,100	16,833,400.00	0.13
368	603290	斯达半导	206,680	16,796,883.60	0.13
369	300751	迈为股份	241,100	16,770,916.00	0.13
370	300735	光弘科技	666,700	16,734,170.00	0.13
371	300888	稳健医疗	406,760	16,717,836.00	0.13
372	002430	杭氧股份	858,500	16,672,070.00	0.13
373	603688	石英股份	471,950	16,622,079.00	0.13
374	600329	达仁堂	496,500	16,563,240.00	0.13
375	600258	首旅酒店	1,170,282	16,536,084.66	0.13
376	603341	龙旗科技	406,000	16,495,780.00	0.13
377	601098	中南传媒	1,253,775	16,449,528.00	0.13
378	600995	南网储能	1,664,271	16,276,570.38	0.12
379	688778	厦钨新能	290,485	16,243,921.20	0.12
380	601212	白银有色	5,162,100	16,157,373.00	0.12
381	600707	彩虹股份	2,500,000	16,150,000.00	0.12
382	000032	深桑达 A	795,100	16,084,873.00	0.12
383	688561	奇安信	473,018	16,073,151.64	0.12
384	003031	中瓷电子	300,120	15,969,385.20	0.12
385	688676	金盘科技	475,612	15,909,221.40	0.12
386	000027	深圳能源	2,486,380	15,863,104.40	0.12
387	600578	京能电力	3,506,900	15,745,981.00	0.12
388	002508	老板电器	824,900	15,681,349.00	0.12
389	603858	步长制药	963,558	15,648,181.92	0.12
390	300573	兴齐眼药	301,240	15,601,219.60	0.12
391	000709	河钢股份	7,211,200	15,576,192.00	0.12
392	603529	爱玛科技	450,750	15,505,800.00	0.12

393	002299	圣农发展	1,082,100	15,463,209.00	0.12
394	600906	财达证券	2,263,100	15,434,342.00	0.12
395	000967	盈峰环境	2,209,789	15,358,033.55	0.12
396	000883	湖北能源	3,397,800	15,324,078.00	0.12
397	002670	国盛金控	1,016,386	15,296,609.30	0.12
398	600517	国网英大	2,994,222	15,270,532.20	0.12
399	688318	财富趋势	132,612	15,239,771.04	0.12
400	600848	上海临港	1,675,060	15,192,794.20	0.12
401	002831	裕同科技	646,858	15,149,414.36	0.12
402	301498	乖宝宠物	138,100	15,103,997.00	0.11
403	600546	山煤国际	1,729,200	15,095,916.00	0.11
404	601399	国机重装	5,031,500	15,094,500.00	0.11
405	600959	江苏有线	4,356,216	14,985,383.04	0.11
406	601928	凤凰传媒	1,331,481	14,872,642.77	0.11
407	600968	海油发展	3,545,500	14,465,640.00	0.11
408	601156	东航物流	1,105,000	14,464,450.00	0.11
409	600808	马钢股份	4,175,800	14,406,510.00	0.11
410	300595	欧普康视	937,300	14,312,571.00	0.11
411	000825	太钢不锈	3,982,000	14,295,380.00	0.11
412	600528	中铁工业	1,935,225	14,281,960.50	0.11
413	000739	普洛药业	1,018,314	14,256,396.00	0.11
414	603225	新凤鸣	1,329,580	14,160,027.00	0.11
415	301301	川宁生物	1,172,800	14,120,512.00	0.11
416	002572	索菲亚	1,006,532	14,101,513.32	0.11
417	601118	海南橡胶	2,986,603	14,096,766.16	0.11
418	601636	旗滨集团	2,806,250	14,059,312.50	0.11
419	002266	浙富控股	4,550,713	14,016,196.04	0.11
420	603565	中谷物流	1,463,400	13,975,470.00	0.11
421	600977	中国电影	1,302,700	13,964,944.00	0.11
422	600801	华新水泥	1,179,467	13,964,889.28	0.11
423	601608	中信重工	3,193,594	13,956,005.78	0.11
424	000543	皖能电力	1,974,700	13,822,900.00	0.11
425	600871	石化油服	7,082,900	13,811,655.00	0.11
426	600062	华润双鹤	726,488	13,556,266.08	0.10
427	601598	中国外运	2,748,800	13,551,584.00	0.10
428	600056	中国医药	1,304,643	13,490,008.62	0.10
429	688387	信科移动	2,382,924	13,463,520.60	0.10
430	603650	彤程新材	418,100	13,441,915.00	0.10
431	601106	中国一重	4,779,800	13,383,440.00	0.10
432	000582	北部湾港	1,619,700	13,362,525.00	0.10
433	000785	居然智家	4,340,700	13,239,135.00	0.10
434	688563	航材股份	232,998	13,194,676.74	0.10
435	300957	贝泰妮	297,300	13,146,606.00	0.10

436	603233	大参林	795,548	12,967,432.40	0.10
437	688702	盛科通信	212,287	12,966,489.96	0.10
438	600925	苏能股份	2,400,600	12,555,138.00	0.10
439	600373	中文传媒	1,217,687	12,505,645.49	0.10
440	601965	中国汽研	696,900	12,369,975.00	0.09
441	002153	石基信息	1,427,029	12,358,071.14	0.09
442	000429	粤高速 A	911,300	12,147,629.00	0.09
443	000537	中绿电	1,440,600	12,043,416.00	0.09
444	600606	绿地控股	7,350,000	11,980,500.00	0.09
445	601568	北元集团	2,769,640	11,494,006.00	0.09
446	002372	伟星新材	1,108,163	11,480,568.68	0.09
447	600098	广州发展	1,833,800	11,461,250.00	0.09
448	600361	创新新材	2,862,900	11,422,971.00	0.09
449	688281	华秦科技	188,173	11,386,348.23	0.09
450	001286	陕西能源	1,308,500	11,383,950.00	0.09
451	688425	铁建重工	2,788,914	11,378,769.12	0.09
452	603658	安图生物	300,616	11,273,100.00	0.09
453	003022	联泓新科	695,900	11,016,097.00	0.08
454	600688	上海石化	3,832,100	10,921,485.00	0.08
455	600612	老凤祥	218,900	10,890,275.00	0.08
456	000937	冀中能源	1,848,200	10,627,150.00	0.08
457	688349	三一重能	423,333	10,557,925.02	0.08
458	601019	山东出版	1,089,578	10,318,303.66	0.08
459	301165	锐捷网络	164,740	10,124,920.40	0.08
460	002608	江苏国信	1,318,200	9,662,406.00	0.07
461	000898	鞍钢股份	4,162,213	9,656,334.16	0.07
462	601139	深圳燃气	1,503,040	9,559,334.40	0.07
463	600339	中油工程	2,919,000	9,545,130.00	0.07
464	600032	浙江新能	1,258,900	9,517,284.00	0.07
465	688100	威胜信息	254,581	9,432,226.05	0.07
466	603707	健友股份	845,719	9,429,766.85	0.07
467	600720	中交设计	1,202,020	9,291,614.60	0.07
468	000959	首钢股份	2,711,500	9,219,100.00	0.07
469	688248	南网科技	292,386	9,198,463.56	0.07
470	600928	西安银行	2,324,000	9,110,080.00	0.07
471	003035	南网能源	1,975,900	9,069,381.00	0.07
472	600295	鄂尔多斯	1,032,080	8,989,416.80	0.07
473	002461	珠江啤酒	778,500	8,789,265.00	0.07
474	603556	海兴电力	340,400	8,669,988.00	0.07
475	688475	萤石网络	271,831	8,568,113.12	0.07
476	688032	禾迈股份	85,667	8,554,706.62	0.07
477	601228	广州港	2,631,800	8,500,714.00	0.06
478	301267	华夏眼科	439,600	8,427,132.00	0.06

479	688172	燕东微	415,217	8,163,166.22	0.06
480	688375	国博电子	133,727	8,024,957.27	0.06
481	603786	科博达	139,358	7,721,826.78	0.06
482	600927	永安期货	506,900	7,507,189.00	0.06
483	601061	中信金属	939,400	7,430,654.00	0.06
484	002563	森马服饰	1,408,900	7,410,814.00	0.06
485	600007	中国国贸	352,439	7,253,194.62	0.06
486	000539	粤电力 A	1,550,500	7,039,270.00	0.05
487	600299	安迪苏	703,700	6,790,705.00	0.05
488	002945	华林证券	470,700	6,763,959.00	0.05
489	603826	坤彩科技	343,980	6,731,688.60	0.05
490	300140	节能环境	1,088,000	6,712,960.00	0.05
491	688819	天能股份	234,886	6,520,435.36	0.05
492	001213	中铁特货	1,548,000	6,284,880.00	0.05
493	601921	浙版传媒	776,408	6,257,848.48	0.05
494	601858	中国科传	277,600	5,399,320.00	0.04
495	301236	软通动力	100,100	5,387,382.00	0.04
496	601158	重庆水务	1,003,200	4,654,848.00	0.04
497	688153	唯捷创芯	148,536	4,606,101.36	0.04
498	600956	新天绿能	535,500	4,134,060.00	0.03
499	001389	广合科技	66,100	3,884,697.00	0.03
500	688295	中复神鹰	170,865	3,553,992.00	0.03
501	603868	飞科电器	82,680	2,965,731.60	0.02
502	688775	影石创新	573	71,143.68	0.00
503	603049	中策橡胶	724	31,023.40	0.00
504	688545	兴福电子	994	26,788.30	0.00
505	301458	钧崴电子	701	23,911.11	0.00
506	301275	汉朔科技	397	22,307.43	0.00
507	688583	思看科技	227	18,087.36	0.00
508	301678	新恒汇	382	17,014.28	0.00
509	301602	超研股份	658	16,318.40	0.00
510	301501	恒鑫生活	350	15,827.00	0.00
511	001388	信通电子	937	15,385.54	0.00
512	603202	天有为	166	15,049.56	0.00
513	301479	弘景光电	182	14,172.34	0.00
514	301535	浙江华远	734	13,938.66	0.00
515	688757	胜科纳米	536	13,903.84	0.00
516	603072	天和磁材	226	12,305.70	0.00
517	301662	宏工科技	143	11,797.50	0.00
518	301601	惠通科技	342	11,576.70	0.00
519	001356	富岭股份	709	10,237.96	0.00
520	301658	首航新能	437	10,042.26	0.00
521	301665	泰禾股份	393	8,799.27	0.00

522	688755	汉邦科技	203	7,983.99	0.00
523	301173	毓恬冠佳	173	7,781.54	0.00
524	001382	新亚电缆	366	7,396.86	0.00
525	603014	威高血净	205	6,699.40	0.00
526	301636	泽润新能	128	6,074.88	0.00
527	301595	太力科技	196	5,703.60	0.00
528	301560	众捷汽车	190	5,215.50	0.00
529	603210	泰鸿万立	286	4,464.46	0.00
530	603271	永杰新材	126	4,420.08	0.00
531	603124	江南新材	88	4,075.28	0.00
532	001395	亚联机械	80	3,780.00	0.00
533	603409	汇通控股	100	3,332.00	0.00
534	001390	古麒绒材	178	3,225.36	0.00
535	603257	中国瑞林	78	2,922.66	0.00
536	603400	华之杰	57	2,497.17	0.00
537	603382	海阳科技	105	2,350.95	0.00
538	001335	信凯科技	80	2,244.00	0.00
539	603120	肯特催化	65	2,172.95	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	688608	恒玄科技	55,336,603.91	0.41
2	688235	百济神州	49,346,987.52	0.36
3	000933	神火股份	47,710,829.00	0.35
4	300450	先导智能	43,926,850.00	0.32
5	300454	深信服	41,975,799.00	0.31
6	002130	沃尔核材	40,197,979.00	0.29
7	300458	全志科技	39,977,677.70	0.29
8	300346	南大光电	38,740,885.00	0.28
9	002851	麦格米特	36,620,551.32	0.27
10	600363	联创光电	36,339,461.80	0.27
11	002156	通富微电	36,001,929.40	0.26
12	300115	长盈精密	35,878,835.00	0.26
13	300857	协创数据	35,833,557.20	0.26
14	002625	光启技术	35,294,719.40	0.26
15	002966	苏州银行	33,226,785.49	0.24
16	000988	华工科技	32,768,805.58	0.24
17	002007	华兰生物	31,749,154.78	0.23
18	300627	华测导航	31,603,179.72	0.23
19	600171	上海贝岭	30,994,501.00	0.23
20	605589	圣泉集团	30,533,646.00	0.22

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	002625	光启技术	149,282,729.90	1.09
2	600418	江淮汽车	119,446,760.97	0.88
3	002384	东山精密	104,304,634.55	0.76
4	301236	软通动力	76,625,571.89	0.56
5	300866	安克创新	60,014,578.86	0.44
6	302132	中航成飞	56,015,157.10	0.41
7	002128	电投能源	50,733,527.93	0.37
8	000988	华工科技	40,619,023.66	0.30
9	688047	龙芯中科	40,420,783.15	0.30
10	300339	润和软件	37,968,813.15	0.28
11	002156	通富微电	36,577,021.50	0.27
12	300476	胜宏科技	35,244,279.02	0.26
13	002407	多氟多	33,180,103.55	0.24
14	002202	金风科技	32,421,299.00	0.24
15	000818	航锦科技	30,801,478.00	0.23
16	002850	科达利	29,550,035.84	0.22
17	002340	格林美	29,077,910.00	0.21
18	600642	申能股份	28,717,867.70	0.21
19	300395	菲利华	28,661,481.61	0.21
20	002261	拓维信息	28,630,937.00	0.21

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	4,064,805,136.70
卖出股票收入（成交）总额	4,634,049,164.26

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	-	-
	其中：政策性金融债	-	-

4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	243,015.98	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	243,015.98	0.00

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	123257	安克转债	2,430	243,015.98	0.00
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。

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基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

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，天风证券股份有限公司、赤峰吉隆黄金矿业股份有限公司、苏州银行股份有限公司、东吴证券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。本基金为指数型基金，采取完全复制策略，苏州银行、东吴证券、天风证券、赤峰黄金系标的指数成份股，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	38,727,102.66
2	应收清算款	157,303,031.12
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	196,030,133.78

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	689009	九号公司	7,001,830.00	0.05	大宗转让流通受限

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

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		华夏中证 500ETF 联接	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总 份额 比例	持有份额	占总份 额比例
19,142	209,884.48	3,236,947,452.00	80.57%	226,662,919.00	5.64%	553,998,423.00	13.79%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	中央汇金投资有限责任公司	2,050,885,600.00	51.05%
2	华夏基金－中央汇金资产管理有限责任公司－华夏基金－汇金资管单一资产管理计划	404,500,000.00	10.07%
3	大家人寿保险股份有限公司－万能产品	72,867,374.00	1.81%
4	中国平安人寿保险股份有限公司－自有资金	66,878,900.00	1.66%
5	中国人寿保险股份有限公司	63,226,315.00	1.57%
6	中国平安人寿保险股份有限公司－分红一个险分红	60,006,600.00	1.49%
7	中国平安人寿保险股份有限公司－万能一个险万能	55,909,800.00	1.39%
8	大家人寿保险股份有限公司－传统产品	47,090,275.00	1.17%
9	大家人寿保险股份有限公司－分红产品	45,563,000.00	1.13%
10	中国人寿保险股份有限公司	40,486,824.00	1.01%
11	中国建设银行股份有限公司－华夏中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	553,998,423.00	13.79%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	-	-

8.4 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	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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015 年 5 月 5 日）基金份额总额	2,134,473,505
本报告期期初基金份额总额	4,347,208,794
本报告期基金总申购份额	1,445,600,000
减：本报告期基金总赎回份额	1,775,200,000
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	4,017,608,794

§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。

中国建设银行股份有限公司（以下简称“中国建设银行”）研究决定，聘任陈颖钰为中国建设银行资产托管业务部总经理。

陈颖钰女士曾先后在中国建设银行财务会计、重组改制、资产负债、同业业务、金融科技等领域工作，并在中国建设银行总行同业业务中心、财务会计部、资产托管业务部以及山东省分行、建信金融科技有限责任公司等机构担任领导职务，具有丰富的财会、科技和资金资产管理经验。

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	
华泰证券	3	2,989,012,768.65	34.37%	286,828.35	34.35%	-
申万宏源证券	2	1,737,614,417.42	19.98%	166,631.45	19.96%	-
中信建投证券	4	1,614,267,001.66	18.56%	155,586.20	18.63%	-
中金公司	5	1,050,014,877.67	12.07%	100,707.71	12.06%	-
东方证券	1	800,930,128.79	9.21%	76,821.22	9.20%	-
招商证券	2	502,313,699.95	5.78%	48,176.61	5.77%	-
国泰海通证券	3	2,569,152.64	0.03%	246.79	0.03%	-

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，本基金还选择了东兴证券、方正证券、光大证券、广发证券、国盛证券、国投证券、华西证券、万联证券、粤开证券、浙商证券、中国银河证券、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。

⑤在上述租用的券商交易单元中，华泰证券、中国银河证券的部分交易单元为本基金本期新增的交易单元。本期没有剔除的券商交易单元。

⑥国泰君安证券股份有限公司自合并交割日 2025 年 3 月 14 日起吸收合并海通证券股份有限公司。根据《国泰海通证券股份有限公司关于完成公司名称变更、注册资本变更、公司章程修订及相应市场主体变更登记的公告》，自 2025 年 4 月 3 日起，国泰君安证券股份有限公司中文名称变更为“国泰海通证券股份有限公司”。

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
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	5,537,044.36	91.03%	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	545,373.14	8.97%	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰	-	-	-	-	-	-	-	-

海通 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办公地址变更的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025-03-07
2	华夏基金管理有限公司关于广州分公司营业场所变更的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025-03-12
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	2025-03-14
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	2025-04-12
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	2025-05-10

§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	2025-01-01 至 2025-06-30	2,050,885,600.00	-	-	2,050,885,600.00	51.05%
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。							

§12 备查文件目录

12.1 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。

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

二〇二五年八月三十日