

452	600316	洪都航空	2,100	58,674.00	0.00
453	002389	航天彩虹	3,300	58,641.00	0.00
454	601018	宁波港	18,600	58,590.00	0.00
455	600208	衢州发展	20,300	57,449.00	0.00
456	600008	首创环保	21,100	57,392.00	0.00
457	000932	华菱钢铁	16,400	56,908.00	0.00
458	600998	九州通	12,097	56,734.93	0.00
459	000738	航发控制	3,100	56,699.00	0.00
460	600170	上海建工	25,500	56,610.00	0.00
461	603486	科沃斯	1,100	55,825.00	0.00
462	300118	东方日升	4,400	54,780.00	0.00
463	600820	隧道股份	10,500	54,705.00	0.00
464	600161	天坛生物	4,700	54,426.00	0.00
465	688712	北芯生命	1,500	53,880.00	0.00
466	601238	广汽集团	10,600	53,848.00	0.00
467	688785	恒运昌	116	53,725.40	0.00
468	603816	顾家家居	2,400	53,664.00	0.00
469	688303	大全能源	3,077	53,632.11	0.00
470	603885	吉祥航空	5,200	53,508.00	0.00
471	002607	中公教育	29,500	53,100.00	0.00
472	603939	益丰药房	2,900	52,142.00	0.00
473	688166	博瑞医药	1,458	51,044.58	0.00
474	600763	通策医疗	1,500	50,820.00	0.00
475	601567	三星电气	3,400	50,796.00	0.00
476	600038	中直股份	2,000	50,580.00	0.00
477	300049	福瑞医科	1,300	50,544.00	0.00
478	300676	华大基因	1,400	49,084.00	0.00
479	601880	辽港股份	35,200	48,576.00	0.00
480	603392	万泰生物	1,800	48,546.00	0.00
481	600535	天士力	3,600	47,628.00	0.00

482	600511	国药股份	1,800	46,872.00	0.00
483	300573	兴齐眼药	1,147	46,751.72	0.00
484	600816	建元信托	18,800	45,872.00	0.00
485	002244	滨江集团	6,000	45,600.00	0.00
486	000833	粤桂股份	1,900	44,498.00	0.00
487	300100	双林股份	1,600	44,448.00	0.00
488	601155	新城控股	4,300	44,118.00	0.00
489	002120	韵达股份	6,900	43,884.00	0.00
490	300144	宋城演艺	7,500	43,575.00	0.00
491	688063	派能科技	803	42,775.81	0.00
492	000998	隆平高科	5,600	42,224.00	0.00
493	002544	普天科技	2,300	41,906.00	0.00
494	600064	南京高科	5,800	41,354.00	0.00
495	601866	中远海发	18,600	41,106.00	0.00
496	688813	泰金新能	234	40,269.06	0.00
497	300457	赢合科技	1,900	40,052.00	0.00
498	600635	大众公用	9,300	39,804.00	0.00
499	600754	锦江酒店	2,200	39,578.00	0.00
500	688635	长进光子	128	39,448.32	0.00
501	000035	中国天楹	8,000	38,640.00	0.00
502	600655	豫园股份	9,300	38,223.00	0.00
503	603899	晨光股份	1,800	37,134.00	0.00
504	300601	康泰生物	3,200	36,288.00	0.00
505	001257	盛龙股份	1,743	36,149.82	0.00
506	600004	白云机场	4,900	35,574.00	0.00
507	600663	陆家嘴	5,600	35,168.00	0.00
508	600258	首旅酒店	3,200	34,944.00	0.00
509	600859	王府井	3,800	34,884.00	0.00
510	002091	江苏国泰	4,700	33,981.00	0.00
511	300070	碧水源	10,400	33,176.00	0.00

512	000069	华侨城 A	19,200	31,488.00	0.00
513	600864	哈投股份	6,000	31,140.00	0.00
514	301078	孩子王	4,200	28,392.00	0.00
515	603459	红板科技	330	27,825.60	0.00
516	002292	奥飞娱乐	4,200	27,552.00	0.00
517	603833	欧派家居	900	27,099.00	0.00
518	600325	华发股份	10,500	24,255.00	0.00
519	002891	中宠股份	900	24,048.00	0.00
520	001365	天海电子	719	22,511.89	0.00
521	002572	索菲亚	2,800	20,440.00	0.00
522	688811	有研新材	834	20,124.42	0.00
523	301696	三瑞智能	216	18,748.80	0.00
524	001237	惠康科技	285	16,740.90	0.00
525	301669	高特电子	546	15,506.40	0.00
526	001393	维通利	387	15,089.13	0.00
527	301531	春光集团	290	14,952.40	0.00
528	301599	理奇智能	433	14,059.51	0.00
529	601112	振石股份	775	13,632.25	0.00
530	301680	固德电材	117	13,122.72	0.00
531	301683	慧谷新材	96	11,689.92	0.00
532	688816	易思维	177	10,106.70	0.00
533	603407	长裕集团	137	10,064.02	0.00
534	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
535	920136	永励精密	300	5,784.00	0.00
536	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
537	603352	至信股份	112	2,858.24	0.00
538	920193	吉和昌	300	2,556.00	0.00
539	603293	埃泰克	72	2,442.96	0.00
540	001312	福恩股份	134	2,248.52	0.00
541	920189	康美特	200	1,628.00	0.00

542	603284	林平发展	46	1,604.02	0.00
543	001220	世盟股份	57	1,583.46	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	300750	宁德时代	4,487,519.00	0.06
2	600519	贵州茅台	3,405,623.00	0.04
3	300308	中际旭创	2,832,041.00	0.04
4	601318	中国平安	2,388,762.00	0.03
5	601899	紫金矿业	2,183,589.00	0.03
6	600036	招商银行	1,781,373.00	0.02
7	300502	新易盛	1,698,233.00	0.02
8	002028	思源电气	1,548,662.00	0.02
9	000333	美的集团	1,540,686.00	0.02
10	600900	长江电力	1,495,431.00	0.02
11	688981	中芯国际	1,306,620.40	0.02
12	002544	普天科技	1,267,077.00	0.02
13	000400	许继电气	1,254,468.00	0.02
14	600089	特变电工	1,242,944.00	0.02
15	688256	寒武纪	1,222,267.40	0.02
16	601398	工商银行	1,216,626.00	0.02
17	600030	中信证券	1,163,854.00	0.01
18	601166	兴业银行	1,144,411.00	0.01
19	688008	澜起科技	1,115,824.42	0.01
20	002475	立讯精密	1,096,857.00	0.01

注：“买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
----	------	------	----------	-----------------

1	300750	宁德时代	4,855,513.00	0.06
2	300308	中际旭创	4,067,877.00	0.05
3	600519	贵州茅台	3,497,277.00	0.04
4	601318	中国平安	2,334,778.00	0.03
5	601899	紫金矿业	2,265,953.00	0.03
6	300502	新易盛	2,209,343.00	0.03
7	600036	招商银行	1,822,147.00	0.02
8	688256	寒武纪	1,704,076.05	0.02
9	000333	美的集团	1,672,604.00	0.02
10	002028	思源电气	1,669,585.00	0.02
11	688820	盛合晶微	1,649,651.41	0.02
12	600900	长江电力	1,554,149.00	0.02
13	600930	华电新能	1,485,820.10	0.02
14	688008	澜起科技	1,483,891.64	0.02
15	002475	立讯精密	1,407,922.00	0.02
16	603986	兆易创新	1,293,042.00	0.02
17	601398	工商银行	1,271,291.00	0.02
18	688981	中芯国际	1,217,420.43	0.02
19	002384	东山精密	1,215,998.00	0.02
20	600030	中信证券	1,209,202.00	0.02

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	186,001,945.69
卖出股票收入（成交）总额	195,941,910.53

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）	6,000.28	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	6,000.28	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	113704	春风转债	60	6,000.28	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

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末无国债期货投资。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货投资。

7.12 本报告期投资基金情况

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

金额单位：人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	华夏中证 A500ETF	股票型	交易型开放式	华夏基金管理有限公司	7,004,523,046.88	91.02

7.13 投资组合报告附注

7.13.1 报告期内，本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求，未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.13.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同约定的备选股票库。

7.13.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	17,281,572.93
2	应收清算款	18,734,118.67
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	22,052,700.70
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	58,068,392.30

7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的 公允价值	占基金资产净 值比例（%）	流通受限情况说明
1	688795	摩尔线程	7,329,906.32	0.10	新发流通受限
2	688802	沐曦股份	3,070,946.66	0.04	新发流通受限
3	688783	西安奕材	2,547,725.40	0.03	新发流通受限

7.13.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户 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
华夏中证 A500ETF 联 接 A	64,309	40,030.55	710,929,036.02	27.62%	1,863,395,473.47	72.38%
华夏中证 A500ETF 联 接 C	80,107	36,452.30	446,471,983.76	15.29%	2,473,612,610.91	84.71%
华夏中证 A500ETF 联 接 Y	30,405	8,700.35	-	-	264,534,264.20	100.00%
合计	174,821	32,941.94	1,157,401,019.78	20.10%	4,601,542,348.58	79.90%

注：本章节持有人户数合计按份额级别汇总，未予以合并剔重。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人 员持有本基金	华夏中证 A500ETF 联 接 A	5,354,346.41	0.21%
	华夏中证 A500ETF 联 接 C	164,306.92	0.01%
	华夏中证 A500ETF 联 接 Y	521,984.15	0.20%
	合计	6,040,637.48	0.10%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	华夏中证 A500ETF 联接 A	10~50
	华夏中证 A500ETF 联接 C	0
	华夏中证 A500ETF 联接 Y	0~10
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	华夏中证 A500ETF 联接 A	0
	华夏中证 A500ETF 联接 C	10~50
	华夏中证 A500ETF 联接 Y	0
	合计	10~50

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华夏中证 A500ETF 联接 A	华夏中证 A500ETF 联接 C	华夏中证 A500ETF 联接 Y
基金合同生效日（2024 年 11 月 18 日）基金份额总额	993,388,046.27	2,066,372,202.48	-
本报告期初基金份额总额	2,667,192,287.38	3,814,122,261.41	154,711,759.98
本报告期基金总申购份额	1,890,190,245.34	3,112,977,812.18	156,247,908.14
减：本报告期基金总赎回份额	1,983,058,023.23	4,007,015,478.92	46,425,403.92
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期期末基金份额总额	2,574,324,509.49	2,920,084,594.67	264,534,264.20

§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，基金托管人无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期未发生影响基金管理人经营或公募基金运营业务的诉讼。

本报告期内，无涉及基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金所聘用的会计师事务所未发生改变。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人未受到调查或处罚。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人相关从业人员未受到调查或处罚。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的基金托管业务不涉及受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人相关从业人员没有受到监管部门调查或处罚。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华泰证券	2	349,443,211.49	92.41%	68,457.19	92.43%	-
华西证券	1	28,444,784.66	7.52%	5,572.42	7.52%	-
中金公司	2	260,585.59	0.07%	32.59	0.04%	-

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，本基金还选择了长江证券、中泰证券、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本报告期内，本基金租用的券商交易单元未发生变更。

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
华泰证券	-	-	50,000,000.00	100.00%	-	-	3,266,096,106.64	79.39%
华西证券	-	-	-	-	-	-	848,051,042.91	20.61%
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-01-22
2	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-03-26
3	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-04-03
4	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-04-15

5	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-04-16
6	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-04-18
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	中国证监会规定报刊及网站	2026-06-04
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	中国证监会规定报刊及网站	2026-06-18
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	中国证监会规定报刊及网站	2026-06-26

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金本报告期无需要披露的单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会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

二〇二六年八月三十一日