华夏中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

2025 年年度报告

2025 年 12 月 31 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

送出日期：二〇二六年三月三十一日

§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。本年度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 2026 年 3 月 27 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。

本报告中的财务资料经审计，安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2025 年 1 月 1 日起至 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况 4
3.1 主要会计数据和财务指标 4
3.2 基金净值表现 5
3.3 过去三年基金的利润分配情况 6
§4 管理人报告 6
§5 托管人报告 13
§6 审计报告 13
§7 年度财务报表 15
7.1 资产负债表 15
7.2 利润表 17
7.3 净资产变动表 18
7.4 报表附注 19
§8 投资组合报告 55
8.1 期末基金资产组合情况 55
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 56
8.3 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 56
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 69
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 70
8.6 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 71
8.7 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 71
8.8 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 71
8.9 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 71
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 71
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 71
8.12 本报告期投资基金情况 72
8.13 投资组合报告附注 72
§9 基金份额持有人信息 72
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 72
9.2 期末上市基金前十名持有人 73
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 73
9.4 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 73
§10 开放式基金份额变动 74
§11 重大事件揭示 74
§12 影响投资者决策的其他重要信息 78
§13 备查文件目录 79

§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	4,340,008,794 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		邹迎光	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》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.ChinaAMC.com
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 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
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

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2025 年	2024 年	2023 年
本期已实现收益	1,894,273,049.94	633,830,505.52	-385,547,522.85
本期利润	4,427,013,690.63	1,543,315,695.21	-394,000,801.64
加权平均基金份额本期利润	1.0703	0.3615	-0.2521
本期加权平均净值利润率	30.52%	12.57%	-7.98%
本期基金份额净值增长率	32.79%	7.10%	-6.33%
3.1.2 期末数据和指标	2025 年末	2024 年末	2023 年末
期末可供分配利润	-1,742,808,860.06	-6,218,542,591.25	-3,588,744,009.56
期末可供分配基金份额利润	-0.4016	-1.4305	-1.6384
期末基金资产净值	18,084,819,959.00	13,641,979,924.36	6,418,289,296.14
期末基金份额净值	4.1670	3.1381	2.9302
3.1.3 累计期末指标	2025 年末	2024 年末	2023 年末
基金份额累计净值增长率	-8.79%	-31.31%	-35.86%

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基金管理人以 2015 年 5 月 22 日为基金份额折算日对本基金进行了份额折算，折算结果详情请参见 2015 年 5 月 26 日发布的《华夏基金管理有限公司关于华夏中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金份额折算结果的公告》。

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
过去三个月	1.11%	1.24%	0.72%	1.24%	0.39%	0.00%
过去六个月	27.28%	1.17%	26.21%	1.17%	1.07%	0.00%
过去一年	32.79%	1.26%	30.39%	1.26%	2.40%	0.00%
过去三年	33.20%	1.36%	27.30%	1.37%	5.90%	-0.01%
过去五年	26.97%	1.30%	17.25%	1.30%	9.72%	0.00%
自基金合同生效起至今	-8.79%	1.56%	-12.28%	1.59%	3.49%	-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

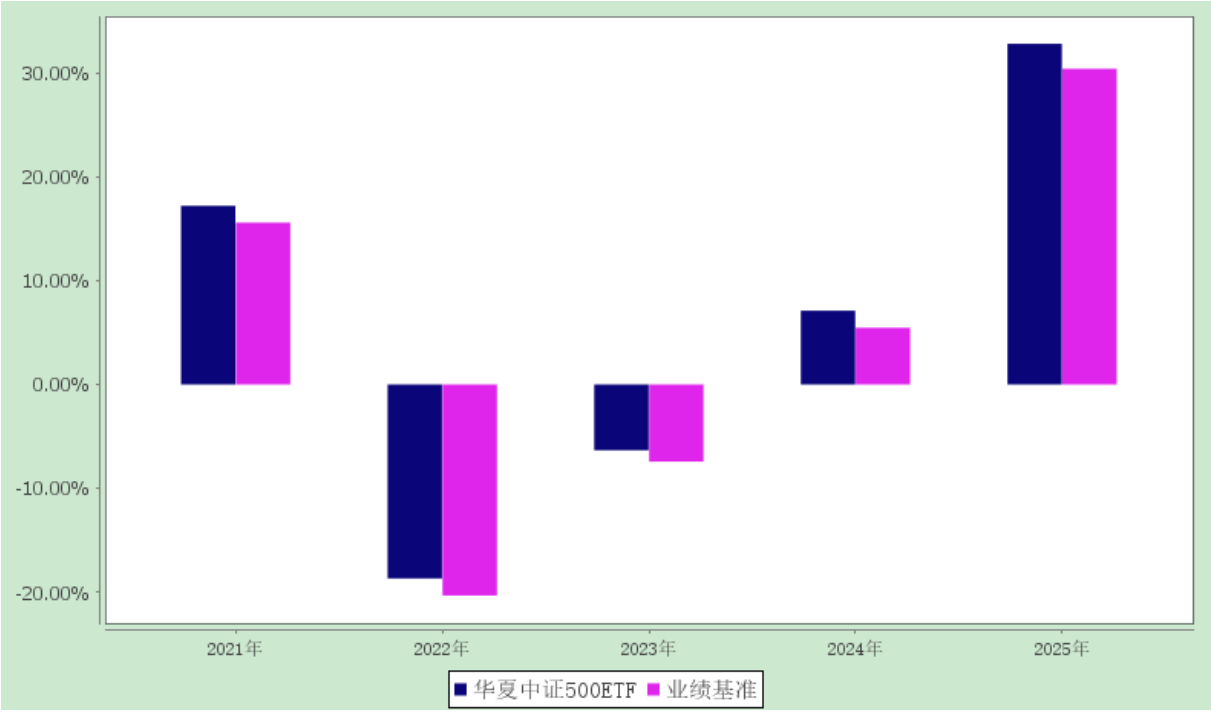
(2015 年 5 月 5 日至 2025 年 12 月 31 日)



3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华夏中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

过去五年基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年无利润分配事项。

§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。

华夏基金是境内权益 ETF 管理规模最大的基金管理公司之一，在指数基金管理方面积累了丰富的经验，形成了覆盖宽基、港股、行业主题、策略、跨境、商品等较为完整的指数产品线。

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 12 月 31 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 TMT 与信息技术行业偏股型基金(A 类)中华夏数字产业混合排名第 3/62；在混合型 FOF(权益资产 30%-60%)(A 类)中华夏聚源优选三个月持有混合（FOF）排名第 3/25；在养老目标日期 FOF(2050)(A 类)中华夏养老 2050 五年持有混合（FOF）排名第 4/16。

固收与固收+产品：在普通债券型基金(可投转债)(A 类)中华夏聚利债券排名第 2/273；在可转换债券型基金(A 类)中华夏可转债增强债券排名第 3/38；在普通偏债型基金(股票上限不高于 30%)(A 类)中华夏永康添福混合排名第 4/313；在短期纯债债券型基金(A 类)中华夏安益短债债券排名第 4/132；在债券型 FOF(A 类)中华夏聚顺优选六个月持有债券（FOF）排名第 5/17；在普通偏债型基金(股票上限不高于 30%)(A 类)中华夏永顺一年持有混合排名前 5%（第 14/313），华夏兴源稳健一年持有混合排名前 5%（第 15/313）。

在客户服务方面，2025 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、交易时间预估、交易场景密码验证功能给客户更方便直观安全的使用体验；（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，优化长辈模式下的业务办理功能，从客户投资需求出发，进一步提升操作体验；（3）与云湾基金、日照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“一些 ETF 小妙招送给大家”、“当你持有红利低波的时间越长，就越能感到它的可贵”“黄金的信仰比黄金贵”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	本基金的基金经理、投委会成员	2016-10-20	-	15 年	硕士。2010 年 7 月加入华夏基金管理有限公司。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型开放式证券投资基金发起式联接基金基金经理（2020 年 1 月 13 日至 2022 年 8 月 22 日期间)、华夏粤港澳大湾区创新 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2020 年 2 月 25 日至 2022 年 8 月 22 日期间)、华夏粤港澳大湾区创新 100 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理（2020 年 4 月 29 日至 2022 年 8 月 22 日期间)等。

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

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

4.1.3 基金经理薪酬机制

本基金管理人旗下基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的，基金经理个人薪酬激励与其管理的私募资产管理计划浮动管理费或产品业绩表现不直接挂钩，公司对其进行年度综合考核，考核结果作为确定其薪酬激励的重要参考因素之一。

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 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规制定了《华夏基金管理有限公司公平交易制度》。公司通过科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时，通过监察稽核、事后分析和信息披露来保证公平交易过程和结果的监督。

4.3.2 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。

4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

本基金管理人一贯严格执行公平交易原则，对兼任基金经理的交易情况进行持续监测。本年度所有相关组合的交易行为均符合法规、制度和流程要求，未发现违反公平交易原则的情况。本年度同一基金经理管理的不同组合在邻近交易日的同向和反向交易，交易时机和交易价差均可合理解释，未发现异常。

本基金管理人根据《基金经理兼任私募资产管理计划投资经理工作指引（试行）》要求，针对同经理管理多个组合间的收益率差异进行归因分析，本年度各组合间收益率差异均属正常情况，主要原因为业绩基准不同、投资策略不同，收益率差异可以合理解释。

4.3.3 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 137 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。

2025 年，国内宏观经济稳健运行，物价水平低位企稳，M1 温和回升。化债已过最艰难的阶段，地产对经济的负面影响降低，各类金融资产走势共同反映了经济的边际向好势头。债券市场转弱，估值层面利率下行至历史低水位，同时基本面无明显有利债市的边际变化。权益市场大放异彩，既有宽基指数表现又有个股轮动普涨。4 月关税问题之后，市场波动率降到多年低位，夏普比改善显著，市场呈现低波上涨的慢牛局面。人工智能是市场主线，市场重心放在挖掘算力需求的机会，海外算力需求带动光模块、pcb、液冷、柴发等细分行业，国产算力需求带动半导体行业。此外，以黄金、铜为代表的大宗商品价格走强。

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、光大证券股份有限公司、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、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 12 月 31 日，本基金份额净值为 4.1670 元，本报告期份额净值增长率为 32.79%，同期业绩比较基准增长率 30.39%。本基金本报告期跟踪偏离度为+2.40%，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 2026 年，党的二十届四中全会再次强调“以经济建设为中心”，我们对十五五开局之年持更加积极的态度，期待看到 PPI 同比转正，以及更多内需政策，大环境有利于权益市场表现。市场整体估值水平不高，经过连续两年的上涨，如果通过业绩增长消化估值对市场而言更为健康，上市公司整体业绩改善的幅度至关重要。科技和大宗涨价仍是非常重要的投资方向，估值处于低位的内需顺周期领域同样值得关注。海外方面，重点关注新任美联储主席人选的确定，中期选举前后海外市场是否波动加剧。

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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

在合规管理方面，公司通过合规审核、合规检查、合规咨询、合规宣传与合规培训等对合规风险进行管理，确保公司合规体系高效运行，合规风险有效控制。报告期内，公司持续推进制度体系建设，结合法律法规和业务实际，在保密管理、专兼职合规人员管理、投资管理人员职业道德与行为规范、洗钱风险管理等方面新增和修订多项管理制度，制度化水平显著提高。持续开展合规培训，在全员覆盖的基础上，着重加强投资研究和关键涉密岗位等重点人员的合规督导培训，强化员工主动合规意识和红线意识。持续优化合规管理的机制化和系统化，完善合规管理综合服务平台，提高合规管理效能。持续做好信息披露业务，通过流程优化、系统优化及强化培训持续保障信息披露的完整性、准确性、及时性。持续做好《推动公募基金高质量发展行动方案》及相关法规配套落实工作。公司高度重视洗钱风险管理，深入贯彻基于风险的原则，依法采取预防、管控措施，建立健全反洗钱内部控制制度，切实履行客户尽职调查、客户身份资料和交易记录保存、可疑交易报告、反洗钱特别预防措施等反洗钱义务，持续提升洗钱风险管理的有效性。

在风险控制方面，公司秉承数字化管理理念，持续升级优化内部风险管理系统、积极探索智能化业务应用，稳步夯实投资风险管理基础。紧密跟踪各项法律法规要求、加强风险研究，在严格管控基金日常投资运作风险的同时，持续完善风险管理制度建设，提升基金流动性风险、市场风险、合规风险、操作风险等关键风险的管控水平，努力保障各项风险管理措施落实到位。

在监察稽核方面，公司按照法规要求，做好日常合规监控，开展内部检查，排查业务风险隐患，促进公司整体业务合规运作、稳健经营。

报告期内，本基金管理人所管理的基金整体运作合法合规。本基金管理人将继续以风险控制为核心，坚持基金份额持有人利益优先的原则，提高监察稽核工作的科学性和有效性，切实保障基金合规稳健运作。

4.7 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。

4.8 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。

4.9 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 托管人对本年度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 审计报告

安永华明（2026）审字第 70035283_A238 号

华夏中证 500 交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人：

6.1 审计意见

我们审计了华夏中证 500 交易型开放式指数证券投资基金的财务报表，包括 2025 年 12 月 31 日的资产负债表，2025 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。

我们认为，后附的华夏中证 500 交易型开放式指数证券投资基金的财务报表在所有重大方面按

照企业会计准则的规定编制，公允反映了华夏中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及 2025 年度的经营成果和净资产变动情况。

6.2 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照《中国注册会计师独立性准则第 1 号——财务报表审计和审阅业务对独立性的要求》和中国注册会计师职业道德守则，我们独立于华夏中证 500 交易型开放式指数证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们在审计中遵循了对公众利益实体审计的独立性要求。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

6.3 其他信息

华夏中证 500 交易型开放式指数证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。

我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。

结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。

基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。

6.4 管理层和治理层对财务报表的责任

管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时，管理层负责评估华夏中证 500 交易型开放式指数证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。

治理层负责监督华夏中证 500 交易型开放式指数证券投资基金的财务报告过程。

6.5 注册会计师对财务报表审计的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

（2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

（3）评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

（4）对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对华夏中证 500 交易型开放式指数证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致华夏中证 500 交易型开放式指数证券投资基金不能持续经营。

（5）评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）　　中国注册会计师

蒋燕华　张晓阳

北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层

2026 年 3 月 27 日

§7 年度财务报表

7.1 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 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	7.4.7.1	61,001,886.44	47,910,882.67
结算备付金		220,801,792.17	103,009,927.41
存出保证金		36,135,087.23	19,141,476.80
交易性金融资产	7.4.7.2	17,776,658,592.98	13,485,646,077.06
其中：股票投资		17,774,743,563.60	13,485,646,077.06
基金投资		-	-
债券投资		1,915,029.38	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收清算款		50,523,390.44	40,352,906.05
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		18,145,120,749.26	13,696,061,269.99
负债和净资产	**附注号**	**本期末 2025 年 12 月 31 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		31,581,292.76	44,773,818.96
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		2,157,323.89	1,828,496.98
应付托管费		719,107.97	609,498.99
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		327,839.51	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	25,515,226.13	6,869,530.70
负债合计		60,300,790.26	54,081,345.63
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	19,827,628,819.06	19,860,522,515.61
未分配利润	7.4.7.8	-1,742,808,860.06	-6,218,542,591.25
净资产合计		18,084,819,959.00	13,641,979,924.36
负债和净资产总计		18,145,120,749.26	13,696,061,269.99

注：报告截止日 2025 年 12 月 31 日，基金份额净值 4.1670 元，基金份额总额 4,340,008,794.00 份。

7.2 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
一、营业总收入		4,457,437,555.97	1,614,473,276.26
1.利息收入		2,140,453.57	3,230,975.64
其中：存款利息收入	7.4.7.9	2,140,453.57	1,241,133.08
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		-	1,989,842.56
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,914,055,087.61	716,521,627.29
其中：股票投资收益	7.4.7.10	1,615,422,990.82	446,473,045.95
基金投资收益	7.4.7.11	-	-
债券投资收益	7.4.7.12	3,957,384.44	641,378.60
资产支持证券投资收益	7.4.7.13	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	91,046,987.59	16,818,567.52
股利收益	7.4.7.16	203,627,724.76	252,588,635.22
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	2,532,740,640.69	909,485,189.69
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	8,501,374.10	-14,764,516.36
减：二、营业总支出		30,423,865.34	71,157,581.05
1.管理人报酬		21,736,276.86	55,744,433.76
2.托管费		7,245,425.68	11,462,709.59
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	7.4.7.20	-	-
7.税金及附加		328,146.99	71,051.41
8.其他费用	7.4.7.21	1,114,015.81	3,879,386.29
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		4,427,013,690.63	1,543,315,695.21

减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		4,427,013,690.63	1,543,315,695.21
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		4,427,013,690.63	1,543,315,695.21

7.3 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 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）	-32,893,696.55	4,475,733,731.19	4,442,840,034.64
（一）、综合收益总额	-	4,427,013,690.63	4,427,013,690.63
（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）	-32,893,696.55	48,720,040.56	15,826,344.01
其中：1.基金申购款	13,435,247,161.41	-3,332,742,407.13	10,102,504,754.28
2.基金赎回款	-13,468,140,857.96	3,381,462,447.69	-10,086,678,410.27
（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	19,827,628,819.06	-1,742,808,860.06	18,084,819,959.00
项目	**上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 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）	9,853,489,209.91	-2,629,798,581.69	7,223,690,628.22
（一）、综合收益总额	-	1,543,315,695.21	1,543,315,695.21
（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）	9,853,489,209.91	-4,173,114,276.90	5,680,374,933.01
其中：1.基金申购款	31,431,753,422.29	-11,740,311,239.38	19,691,442,182.91
2.基金赎回款	-21,578,264,212.38	7,567,196,962.48	-14,011,067,249.90
（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	19,860,522,515.61	-6,218,542,591.25	13,641,979,924.36

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：邹迎光，主管会计工作负责人：朱威，会计机构负责人：朱威

7.4 报表附注

7.4.1 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。

7.4.2 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 7.4.4 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。

7.4.3 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。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

1、金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产

分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

（1）债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益。基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资、资产支持证券投资和基金投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

（2）权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

2、金融负债的分类

本基金的金融负债于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

3、衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计

利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，其公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益。

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益。

本基金对以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础，进行减值处理并确认损失准备。本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况。当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产。当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

1、存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

2、当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

3、如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。对于曾经实施份额拆分或折算的基金，由于基金份额拆分或折算引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日或基金份额折算日根据拆分前或折算前的基金份额数及确定的拆分或折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。对于已开放转换业务的基金，上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额。损益

平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/（累计亏损）。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

境内基金投资在持有期间应取得的现金红利于除息日确认为投资收益；境外基金投资在持有期间应取得的基金分红收益扣除基金交易所在地适用的预缴所得税后的净额确认投资收益。境内股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益；境外股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除股票交易所在地适用的预缴所得税后的净额确认为投资收益。境内债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。境外债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在交易所在地适用的预缴所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；处置时其公允价值与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

本基金参与的转融通证券出借业务，是指基金以一定的费率通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司(以下简称“证金公司”)出借证券，证金公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务。由于基金参与转融通证券出借业务不属于实质性证券转让行为，基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认该出借证券，仍按原金融资产类别进行后续计量，并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息确认为利息收入，将出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为投资收益。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的按直线法近似计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

针对基金合同约定费率和计算方法的费用，本基金在费用涵盖期间按合同约定进行确认。

其他以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的按直线法近似计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

1、每一基金份额享有同等分配权。

2、当基金累计报酬率超过同期标的指数累计报酬率达到 1%以上时，可进行收益分配。

3、若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配。

4、本基金收益分配采用现金方式。

5、在符合基金收益分配条件的情况下，本基金收益每年最多分配 4 次，每次基金收益分配数额的确定原则为使收益分配后基金累计报酬率尽可能贴近标的指数同期累计报酬率。

6、法律法规、监管机关、登记机构、上海证券交易所另有规定的，从其规定。

在不违反法律法规且对现有基金份额持有人利益无实质不利影响的情况下，基金管理人、登记机构可对基金收益分配原则进行调整，不需召开基金份额持有人大会。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

1、对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

2、对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6 号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》进行估值。

3、对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566 号《关于发布<关于固定收益品种的估值处理标准>的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场交易的固定收益品种，按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 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。

7.4.6 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》、财政部税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》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。2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。

（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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
活期存款	61,001,886.44	47,910,882.67
等于：本金	60,994,387.98	47,906,297.15
加：应计利息	7,498.46	4,585.52
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	61,001,886.44	47,910,882.67

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2025 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		14,659,660,404.29	-	17,774,743,563.60	3,115,083,159.31
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	1,915,000.00	29.38	1,915,029.38	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	1,915,000.00	29.38	1,915,029.38	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		14,661,575,404.29	29.38	17,776,658,592.98	3,115,083,159.31
项目		上年度末 2024 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		12,886,298,398.44	-	13,485,646,077.06	599,347,678.62
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-

其他	-	-	-	-
合计	12,886,298,398.44	-	13,485,646,077.06	599,347,678.62

注：□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。

□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。

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 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 12 月 31 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	278,352,400.00	-	-	-
其中：股指期货	278,352,400.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	278,352,400.00	-	-	-
项目	上年度末 2024 年 12 月 31 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	146,223,640.00	-	-	-
其中：股指期货	146,223,640.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	146,223,640.00	-	-	-

7.4.7.3.2 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
IC2603	中证 500 期货 IC2603 合约	100	147,332,000.00	6,245,200.00
IC2606	中证 500 期货 IC2606 合约	100	143,648,000.00	6,382,400.00
合计	-	-	-	12,627,600.00
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	12,627,600.00
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。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

7.4.7.5 其他资产

无。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 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	950,185.82	1,951,610.20
其中：交易所市场	950,185.82	1,951,610.20
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	195,000.00	195,000.00
可退替代款	125,461.75	-
应退替代款	24,244,578.56	3,597,248.33
应付指数使用费	-	1,125,672.17
合计	25,515,226.13	6,869,530.70

7.4.7.7 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 12 月 31 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	2,940,800,000.00	13,435,247,161.41
本期赎回（以“-”号填列）	-2,948,000,000.00	-13,468,140,857.96
本期末	4,340,008,794.00	19,827,628,819.06

注：基金管理人以 2015 年 5 月 22 日为基金份额折算日对本基金进行了份额折算，折算结果详情请参见 2015 年 5 月 26 日发布的《华夏基金管理有限公司关于华夏中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金份额折算结果的公告》。

7.4.7.8 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	1,894,273,049.94	2,532,740,640.69	4,427,013,690.63
本期基金份额交易产生的变动数	93,481,204.29	-44,761,163.73	48,720,040.56
其中：基金申购款	463,436,258.64	-3,796,178,665.77	-3,332,742,407.13
基金赎回款	-369,955,054.35	3,751,417,502.04	3,381,462,447.69
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,003,487,018.29	-3,746,295,878.35	-1,742,808,860.06

7.4.7.9 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	297,199.59	188,375.16
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	1,836,995.85	1,010,451.59
其他	6,258.13	42,306.33
合计	2,140,453.57	1,241,133.08

7.4.7.10 股票投资收益

7.4.7.10.1 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	1,256,006,831.76	310,401,965.01
股票投资收益——赎回差价收入	359,416,159.06	136,071,080.94
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	1,615,422,990.82	446,473,045.95

7.4.7.10.2 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	9,224,476,040.51	11,661,816,728.02
减：卖出股票成本总额	7,960,840,461.11	11,339,596,944.52
减：交易费用	7,628,747.64	11,817,818.49
买卖股票差价收入	1,256,006,831.76	310,401,965.01

7.4.7.10.3 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
赎回基金份额对价总额	10,086,678,410.27	14,011,067,249.90
减：现金支付赎回款总额	5,235,725,808.25	7,237,579,972.90
减：赎回股票成本总额	4,491,536,442.96	6,637,416,196.06
减：交易费用	-	-
赎回差价收入	359,416,159.06	136,071,080.94

7.4.7.11 基金投资收益

无。

7.4.7.12 债券投资收益

7.4.7.12.1 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12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日
债券投资收益——利息收入	1,249.56	1,566.70
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	3,956,134.88	639,811.90
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	3,957,384.44	641,378.60

7.4.7.12.2 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12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	17,526,593.76	11,006,377.49

减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	13,568,500.00	10,364,500.00
减：应计利息总额	1,257.81	1,625.47
减：交易费用	701.07	440.12
买卖债券差价收入	3,956,134.88	639,811.90

7.4.7.13 资产支持证券投资收益

无。

7.4.7.14 贵金属投资收益

无。

7.4.7.15 衍生工具收益

7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

7.4.7.15.2 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12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日
股指期货投资收益	91,046,987.59	16,818,567.52

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日
股票投资产生的股利收益	203,627,724.76	252,588,635.22
其中：证券出借权益补偿收入	-	9,245,098.29
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	203,627,724.76	252,588,635.22

7.4.7.17 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12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日
1.交易性金融资产	2,515,735,480.69	913,503,709.69
——股票投资	2,515,735,480.69	913,503,709.69
——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	17,005,160.00	-4,018,520.00
——权证投资	-	-
——期货投资	17,005,160.00	-4,018,520.00
3.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	2,532,740,640.69	909,485,189.69

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日
基金赎回费收入	-	-
替代损益	8,499,915.91	-14,766,440.15
其他	1,458.19	1,923.79
合计	8,501,374.10	-14,764,516.36

7.4.7.19 持有基金产生的费用

无。

7.4.7.20 信用减值损失

无。

7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日
审计费用	75,000.00	75,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行费用	884.26	1,477.65
指数使用费	908,312.04	3,674,179.98
存托服务费	9,819.51	8,728.66
合计	1,114,015.81	3,879,386.29

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无或有事项。

7.4.8.2 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。

7.4.9 关联方关系

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
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
中信证券股份有限公司（“中信证券”）	基金管理人的股东
天津海鹏科技咨询有限公司	基金管理人的股东
Qatar Holding LLC	基金管理人的股东
MACKENZIE FINANCIAL CORPORATION	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
华夏资本管理有限公司（“华夏资本”）	基金管理人的子公司
华夏股权投资基金管理（北京）有限公司	基金管理人的子公司
北京华夏金科信息服务有限公司	基金管理人的子公司
China Asset Management （Hong Kong） Limited（中文名：华夏基金（香港）有限公司）	基金管理人的子公司
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：①根据华夏基金管理有限公司于 2025 年 7 月 11 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%）、Qatar Holding LLC（出资比例 10%）。

②下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 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12月31日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31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	3,285,847,668.23	17.44%	10,833,450,354.83	40.82%

7.4.10.1.2 权证交易

无。

7.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年1月1日至2025年12月31日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
中信证券	4,023,831.96	22.96%	2,332,658.07	21.19%

7.4.10.1.4 债券回购交易

无。

7.4.10.1.5 基金交易

无。

7.4.10.1.6 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12月31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	315,746.87	17.45%	303,491.41	31.94%
关联方名称	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31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	1,122,077.40	26.18%	-	-

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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	21,736,276.86	55,744,433.76
其中：应支付销售机构的客户维护费	351,759.98	237,921.91
应支付基金管理人的净管理费	21,384,516.88	55,506,511.85

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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	7,245,425.68	11,462,709.59

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。

7.4.10.2.3 销售服务费

无。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.10.4 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

7.4.10.4.1 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。

7.4.10.4.2 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12月31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12月31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	778,270,137.64	0.41~5.60	1.21	339,276.22	-	-

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.4.10.5.2 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 12 月 31 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	489,076,423.00	11.27%	606,362,823.00	13.95%
中信证券	6,247.00	0.00%	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。

7.4.10.6 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12月31日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31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	61,001,886.44	297,199.59	47,910,882.67	188,375.16

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。

7.4.10.7 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 12 月 31 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	688795	摩尔线程	新股发行	15,468	1,767,683.04
中信证券	600930	华电新能	新股发行	363,650	1,156,407.00
中信证券	688783	西安奕材	新股发行	73,950	637,449.00
中信证券	688759	必贝特	新股发行	20,920	371,957.60

中信证券	688775	影石创新	新股发行	5,725	270,620.75
中信证券	001280	中国铀业	新股发行	7,588	135,749.32
中信证券	688807	优迅股份	新股发行	1,303	67,312.98
中信证券	688583	思看科技	新股发行	1,742	58,287.32
中信证券	001285	瑞立科密	新股发行	1,361	57,543.08
中信证券	688755	汉邦科技	新股发行	2,023	46,063.71
中信证券	301687	新广益	新股发行	1,942	42,588.06
中信证券	301662	宏工科技	新股发行	1,429	38,011.40
中信证券	301584	建发致新	新股发行	4,465	31,478.25
中信证券	603257	中国瑞林	新股发行	780	16,005.60
中信证券	001396	誉帆科技	新股发行	688	15,335.52
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 12 月 31 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	688708	佳驰科技	新股发行	7,794	211,061.52
中信证券	001391	国货航	新股发行	46,851	107,757.30
中信证券	301613	新铝时代	新股发行	2,756	76,341.20
中信证券	603091	众鑫股份	新股发行	940	24,910.00

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

7.4.10.8.1 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）。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配事项。

7.4.12 期末（2025 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002156	通富微	2025-08-07	6 个月	大宗转	24.96	36.97	500,000	12,480,000.00	18,485,000.00	-

	电			让流通受限						
603893	瑞芯微	2025-07-14	6 个月	大宗转让流通受限	141.77	176.42	80,000	11,341,600.00	14,113,600.00	-
301308	江波龙	2025-09-22	6 个月	大宗转让流通受限	116.78	222.54	50,000	5,839,000.00	11,127,000.00	-
688525	佰维存储	2025-10-09	6 个月	大宗转让流通受限	93.87	104.38	100,000	9,387,000.00	10,438,000.00	-
300604	长川科技	2025-12-30	6 个月	大宗转让流通受限	95.40	90.83	100,000	9,540,000.00	9,083,000.00	-
688120	华海清科	2025-12-15	6 个月	大宗转让流通受限	144.43	139.66	50,000	7,221,500.00	6,983,000.00	-

688120	华海清科	2025-12-22	6 个月	大宗转让流通受限	144.43	139.66	50,000	7,221,500.00	6,983,000.00	-
688234	天岳先进	2025-10-14	6 个月	大宗转让流通受限	69.14	83.01	70,000	4,839,800.00	5,810,700.00	-
300604	长川科技	2025-09-24	6 个月	大宗转让流通受限	80.00	95.56	60,000	4,800,000.00	5,733,600.00	-
689009	九号公司	2025-07-15	6 个月	大宗转让流通受限	54.00	55.03	100,000	5,400,000.00	5,503,000.00	-
689009	九号公司	2025-07-30	6 个月	大宗转让流通受限	55.04	54.80	100,000	5,504,000.00	5,480,000.00	-
688608	恒玄科技	2025-08-28	6 个月	大宗转让流	282.31	218.49	25,000	7,057,750.00	5,462,250.00	-

				通受限						
603129	春风动力	2025-11-11	6 个月	大宗转让流通受限	228.04	263.53	20,000	4,560,800.00	5,270,600.00	-
688578	艾力斯	2025-09-01	6 个月	大宗转让流通受限	106.45	101.78	50,000	5,322,500.00	5,089,000.00	-
688578	艾力斯	2025-09-03	6 个月	大宗转让流通受限	107.65	101.72	50,000	5,382,500.00	5,086,000.00	-
002244	滨江集团	2025-12-16	6 个月	大宗转让流通受限	9.20	9.50	500,000	4,600,000.00	4,750,000.00	-
688220	翱捷科技	2025-11-13	6 个月	大宗转让流通受限	75.82	75.91	60,000	4,549,200.00	4,554,600.00	-
688795	摩尔	2025-11-26	9 个月	新发	114.28	416.02	10,828	1,237,423.84	4,504,664.56	-

	线程			流通受限						
300676	华大基因	2025-09-23	6 个月	非公开发行流通受限	44.10	44.36	100,000	4,410,000.00	4,436,000.00	-
688525	佰维存储	2025-10-20	6 个月	大宗转让流通受限	93.96	104.20	40,000	3,758,400.00	4,168,000.00	-
688297	中无人机	2025-11-28	6 个月	非公开发行流通受限	41.99	45.26	90,000	3,779,100.00	4,073,400.00	-
688220	翱捷科技	2025-11-06	6 个月	大宗转让流通受限	79.38	76.42	50,000	3,969,000.00	3,821,000.00	-
603927	中科软	2025-07-17	6 个月	大宗转让流通受	18.14	18.97	200,000	3,628,000.00	3,794,000.00	-

				限						
300735	光弘科技	2025-09-09	6 个月	非公开发行流通受限	23.33	24.04	150,000	3,499,500.00	3,606,000.00	-
688375	国博电子	2025-12-02	6 个月	大宗转让流通受限	60.86	85.94	40,000	2,434,400.00	3,437,600.00	-
688375	国博电子	2025-10-22	6 个月	大宗转让流通受限	64.94	86.63	35,000	2,272,900.00	3,032,050.00	-
688802	沐曦股份	2025-12-09	9 个月	新发流通受限	104.66	399.40	3,994	418,012.04	1,595,203.60	-
600930	华电新能	2025-07-09	6 个月	新发流通受限	3.18	6.24	254,555	809,484.90	1,588,423.20	-
688765	禾元生物	2025-10-16	9 个月	新发流通受限	29.06	52.80	16,470	478,618.20	869,616.00	-
688783	西	2025-	9 个月	新	8.62	18.39	44,370	382,469.40	815,964.30	-

	安奕材	10-20		发流通受限						
688759	必贝特	2025-10-21	9 个月	新发流通受限	17.78	25.13	12,552	223,174.56	315,431.76	-
688790	昂瑞微	2025-12-09	9 个月	新发流通受限	83.06	117.07	2,319	192,616.14	271,485.33	-
301656	联合动力	2025-09-17	6 个月	新发流通受限	12.48	25.46	7,395	92,289.60	188,276.70	-
001280	中国铀业	2025-11-25	6 个月	新发流通受限	17.89	45.36	2,277	40,735.53	103,284.72	-
688729	屹唐股份	2025-07-01	6 个月	新发流通受限	8.45	24.28	3,505	29,617.25	85,101.40	-
688809	强一股份	2025-12-23	6 个月	新发流通受限	85.09	203.31	259	22,038.31	52,657.29	-
301638	南网数字	2025-11-11	6 个月	新发流通	5.69	14.21	2,322	13,212.18	32,995.62	-

				受限						
001386	马可波罗	2025-10-15	6 个月	新发流通受限	13.75	18.53	1,626	22,357.50	30,129.78	-
688727	恒坤新材	2025-11-11	6 个月	新发流通受限	14.99	34.87	563	8,439.37	19,631.81	-
001233	海安集团	2025-11-18	6 个月	新发流通受限	48.00	51.88	370	17,760.00	19,195.60	-
688796	百奥赛图	2025-12-02	6 个月	新发流通受限	26.68	42.25	423	11,285.64	17,871.75	-
688807	优迅股份	2025-12-10	6 个月	新发流通受限	51.66	135.56	131	6,767.46	17,758.36	-
301632	广东建科	2025-08-05	6 个月	新发流通受限	6.56	23.68	656	4,303.36	15,534.08	-
301563	云汉芯城	2025-09-23	6 个月	新发流通受限	27.00	133.69	110	2,970.00	14,705.90	-
301491	汉	2025-	6 个月	新	28.91	55.11	245	7,082.95	13,501.95	-

	桑科技	07-29		发流通受限						
301584	建发致新	2025-09-18	6 个月	新发流通受限	7.05	26.82	447	3,151.35	11,988.54	-
001369	双欣环保	2025-12-23	6 个月	新发流通受限	6.85	12.89	897	6,144.45	11,562.33	-
301609	山大电力	2025-07-16	6 个月	新发流通受限	14.66	40.99	277	4,060.82	11,354.23	-
301687	新广益	2025-12-24	6 个月	新发流通受限	21.93	54.39	195	4,276.35	10,606.05	-
001221	悍高集团	2025-07-23	6 个月	新发流通受限	15.43	56.94	160	2,468.80	9,110.40	-
301667	纳百川	2025-12-10	6 个月	新发流通受限	22.63	57.07	151	3,417.13	8,617.57	-
688805	健信超导	2025-12-17	6 个月	新发流通	18.58	32.37	265	4,923.70	8,578.05	-

				受限						
603418	友升股份	2025-09-16	6 个月	新发流通受限	46.36	59.06	139	6,444.04	8,209.34	-
603175	超颖电子	2025-10-17	6 个月	新发流通受限	17.08	48.56	169	2,886.52	8,206.64	-
603092	德力佳	2025-10-30	6 个月	新发流通受限	46.68	55.66	146	6,815.28	8,126.36	-
001285	瑞立科密	2025-09-23	6 个月	新发流通受限	42.28	56.08	137	5,792.36	7,682.96	-
301668	昊创瑞通	2025-09-15	6 个月	新发流通受限	21.00	44.80	165	3,465.00	7,392.00	-
301449	天溯计量	2025-12-16	6 个月	新发流通受限	36.80	65.23	112	4,121.60	7,305.76	-
601026	道生天合	2025-10-09	6 个月	新发流通受限	5.98	14.28	451	2,696.98	6,440.28	-
301575	艾	2025-	6 个月	新	27.69	49.55	126	3,488.94	6,243.30	-

	芬达	09-03		发流通受限						
603406	天富龙	2025-07-30	6 个月	新发流通受限	23.60	40.16	153	3,610.80	6,144.48	-
603262	技源集团	2025-07-16	6 个月	新发流通受限	10.88	28.10	155	1,686.40	4,355.50	-
603248	锡华科技	2025-12-16	6 个月	新发流通受限	10.10	16.30	260	2,626.00	4,238.00	-
001388	信通电子	2025-06-24	6 个月	新发流通受限	16.42	42.94	94	1,543.48	4,036.36	-
603370	华新精科	2025-08-27	6 个月	新发流通受限	18.60	46.35	82	1,525.20	3,800.70	-
603376	大明电子	2025-10-28	6 个月	新发流通受限	12.55	26.21	111	1,393.05	2,909.31	-
603334	丰倍生物	2025-10-29	6 个月	新发流通	24.49	32.82	88	2,155.12	2,888.16	-

				受限						
001396	誉帆科技	2025-12-23	6 个月	新发流通受限	22.29	35.39	69	1,538.01	2,441.91	-
7.4.12.1.2 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(单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
118063	金 05 转债	2025-12-25	1 个月内（含）	新发流通受限	100.00	100.00	19,150	1,915,000.00	1,915,029.38	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。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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内。

7.4.13.2 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。

7.4.13.3 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“7.4.12 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。

7.4.13.3.1 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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 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	17,774,743,563.60	98.29	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	1,915,029.38	0.01	-	-
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	17,776,658,592.98	98.30	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。

7.4.13.4.3.2 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 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
	-5%	-892,296,986.80	-687,582,920.12
	+5%	892,296,986.80	687,582,920.12

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 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 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	17,603,693,528.02	13,450,588,351.51
第二层次	1,915,029.38	27,736.50
第三层次	171,050,035.58	35,029,989.05
合计	17,776,658,592.98	13,485,646,077.06

7.4.14.2.2 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）和非公开发行等导致流通受限的情况，本基金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所属层次。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。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	35,029,989.05	35,029,989.05
当期购买	-	175,948,927.00	175,948,927.00
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	4,315,639.69	4,315,639.69
转出第三层次	-	74,736,675.74	74,736,675.74
当期利得或损失总额	-	30,492,155.58	30,492,155.58
其中：计入损益的利得或损失	-	30,492,155.58	30,492,155.58
计入其他综合收益的利得或损失（若有）	-	-	-
期末余额	-	171,050,035.58	171,050,035.58
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	24,152,239.45	24,152,239.45
项目	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	44,582,000.00	44,582,000.00
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	201,941.03	201,941.03
转出第三层次	-	10,739,000.00	10,739,000.00
当期利得或损失总额	-	985,048.02	985,048.02
其中：计入损益的利得或损失	-	985,048.02	985,048.02
计入其他综合	-	-	-

收益的利得或损失（若有）			
期末余额	-	35,029,989.05	35,029,989.05
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-1,065,951.98	-1,065,951.98

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	171,050,035.58	平均价格亚式期权模型	预期年化波动率	0.1343-3.0323	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	35,029,989.05	平均价格亚式期权模型	预期年化波动率	0.3423-5.7444	负相关

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

截至 2025 年 12 月 31 日止，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

7.4.14.4 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。

7.4.15 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。

§8 投资组合报告

8.1 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	17,774,743,563.60	97.96
	其中：股票	17,774,743,563.60	97.96

2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,915,029.38	0.01
	其中：债券	1,915,029.38	0.01
	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	281,803,678.61	1.55
8	其他各项资产	86,658,477.67	0.48
9	合计	18,145,120,749.26	100.00

注：股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值。

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	84,381,005.35	0.47
B	采矿业	742,075,718.25	4.10
C	制造业	12,126,672,208.45	67.05
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	514,557,121.79	2.85
E	建筑业	144,270,424.55	0.80
F	批发和零售业	268,178,989.95	1.48
G	交通运输、仓储和邮政业	263,977,327.22	1.46
H	住宿和餐饮业	21,724,619.00	0.12
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,487,348,153.22	8.22
J	金融业	1,309,872,075.98	7.24
K	房地产业	124,783,524.19	0.69
L	租赁和商务服务业	222,848,699.18	1.23
M	科学研究和技术服务业	117,546,468.18	0.65
N	水利、环境和公共设施管理业	77,274,999.32	0.43
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	25,562,008.00	0.14
Q	卫生和社会工作	55,088,794.72	0.30
R	文化、体育和娱乐业	124,792,640.28	0.69
S	综合	63,789,641.49	0.35
	合计	17,774,744,419.12	98.29

8.3 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	002837	英维克	1,099,289	117,503,001.21	0.65
2	300136	信维通信	1,828,300	113,354,600.00	0.63
3	002558	巨人网络	2,560,632	110,849,759.28	0.61
4	002738	中矿资源	1,363,280	107,085,644.00	0.59
5	600879	航天电子	4,986,274	106,307,361.68	0.59
6	600118	中国卫星	1,117,384	106,095,610.80	0.59
7	300450	先导智能	2,072,900	103,603,542.00	0.57
8	600580	卧龙电驱	2,067,560	101,517,196.00	0.56
9	600988	赤峰黄金	3,146,321	98,291,068.04	0.54
10	000426	兴业银锡	2,686,400	95,635,840.00	0.53
11	002202	金风科技	4,567,876	93,184,670.40	0.52
12	600487	亨通光电	3,731,808	92,287,611.84	0.51
13	601168	西部矿业	3,154,348	87,186,178.72	0.48
14	600549	厦门钨业	2,101,390	86,283,073.40	0.48
15	002156	通富微电	2,294,099	86,122,532.30	0.48
16	002532	天山铝业	5,275,400	85,355,972.00	0.47
17	300604	长川科技	839,300	83,636,483.00	0.46
18	300115	长盈精密	1,793,500	83,397,750.00	0.46
19	688347	华虹公司	769,652	83,022,361.24	0.46
20	002353	杰瑞股份	1,162,199	82,318,555.17	0.46
21	000933	神火股份	2,976,100	81,753,467.00	0.45
22	002340	格林美	9,669,100	80,833,676.00	0.45
23	600096	云天化	2,412,000	80,584,920.00	0.45
24	300395	菲利华	788,812	79,117,843.60	0.44
25	002261	拓维信息	2,381,100	78,814,410.00	0.44
26	300058	蓝色光标	6,781,759	78,125,863.68	0.43
27	600143	金发科技	3,987,520	77,916,140.80	0.43
28	300857	协创数据	457,780	77,218,330.40	0.43
29	301308	江波龙	316,038	76,263,743.92	0.42
30	002195	岩山科技	10,718,668	75,995,356.12	0.42
31	002851	麦格米特	831,100	74,857,177.00	0.41
32	300339	润和软件	1,505,600	74,527,200.00	0.41
33	300207	欣旺达	2,793,000	73,036,950.00	0.40
34	002131	利欧股份	12,787,700	72,122,628.00	0.40
35	600885	宏发股份	2,339,747	71,128,308.80	0.39
36	002517	恺英网络	3,229,700	70,633,539.00	0.39
37	002966	苏州银行	8,451,470	70,062,686.30	0.39
38	688002	睿创微纳	694,420	69,997,536.00	0.39
39	688120	华海清科	470,434	69,560,734.72	0.38
40	688525	佰维存储	615,732	69,215,276.28	0.38
41	002402	和而泰	1,746,777	68,333,916.24	0.38
42	601555	东吴证券	7,512,070	68,059,354.20	0.38

43	603228	景旺电子	930,523	68,011,926.07	0.38
44	002436	兴森科技	3,211,700	67,991,689.00	0.38
45	300223	北京君正	639,314	67,792,856.56	0.37
46	600601	方正科技	5,653,800	66,262,536.00	0.37
47	002273	水晶光电	2,629,651	66,056,833.12	0.37
48	000831	中国稀土	1,403,900	65,197,116.00	0.36
49	300751	迈为股份	316,000	65,092,840.00	0.36
50	600157	永泰能源	41,236,984	64,742,064.88	0.36
51	002008	大族激光	1,557,500	64,153,425.00	0.35
52	688122	西部超导	858,996	64,063,921.68	0.35
53	002281	光迅科技	914,515	63,970,324.25	0.35
54	002595	豪迈科技	754,955	63,801,247.05	0.35
55	600673	东阳光	2,843,943	63,789,641.49	0.35
56	688469	芯联集成	9,506,979	63,601,689.51	0.35
57	002130	沃尔核材	2,381,200	62,673,184.00	0.35
58	688361	中科飞测	399,252	61,081,563.48	0.34
59	002472	双环传动	1,283,800	60,864,958.00	0.34
60	002126	银轮股份	1,595,400	60,306,120.00	0.33
61	689009	九号公司	1,085,024	60,181,484.16	0.33
62	300390	天华新能	1,099,911	60,066,139.71	0.33
63	002128	电投能源	2,119,400	59,152,454.00	0.33
64	688027	国盾量子	117,321	59,105,146.59	0.33
65	002465	海格通信	3,752,200	59,097,150.00	0.33
66	688777	中控技术	1,196,410	59,030,869.40	0.33
67	688235	百济神州	218,641	58,726,972.60	0.32
68	600699	均胜电子	1,846,175	57,896,048.00	0.32
69	002850	科达利	361,600	57,082,176.00	0.32
70	600392	盛和资源	2,649,157	57,036,350.21	0.32
71	603129	春风动力	203,003	56,269,876.04	0.31
72	300346	南大光电	1,305,580	56,009,382.00	0.31
73	301358	湖南裕能	862,300	55,756,318.00	0.31
74	601162	天风证券	13,327,800	55,443,648.00	0.31
75	688099	晶晨股份	635,144	55,403,611.12	0.31
76	603659	璞泰来	2,019,465	55,212,173.10	0.31
77	300454	深信服	477,000	54,931,320.00	0.30
78	002797	第一创业	7,941,700	54,559,479.00	0.30
79	000878	云南铜业	2,652,300	54,398,673.00	0.30
80	002138	顺络电子	1,524,490	54,165,129.70	0.30
81	603979	金诚信	708,600	53,959,890.00	0.30
82	300054	鼎龙股份	1,428,171	53,699,229.60	0.30
83	601108	财通证券	6,143,400	53,570,448.00	0.30
84	600021	上海电力	2,664,976	53,352,819.52	0.30
85	688578	艾力斯	513,084	53,197,698.60	0.29
86	002185	华天科技	4,845,617	53,156,418.49	0.29

87	601099	太平洋	12,882,900	52,948,719.00	0.29
88	600352	浙江龙盛	4,919,892	52,446,048.72	0.29
89	688385	复旦微电	709,170	52,265,829.00	0.29
90	002294	信立泰	1,054,071	52,229,218.05	0.29
91	000021	深科技	2,065,500	52,215,840.00	0.29
92	000960	锡业股份	1,866,098	52,026,812.24	0.29
93	300037	新宙邦	989,520	51,850,848.00	0.29
94	000783	长江证券	6,271,500	51,112,725.00	0.28
95	601198	东兴证券	3,664,798	50,867,396.24	0.28
96	688213	思特威	534,537	50,829,123.33	0.28
97	688608	恒玄科技	224,400	50,714,086.00	0.28
98	600141	兴发集团	1,459,772	50,478,915.76	0.28
99	300724	捷佳伟创	526,900	50,371,640.00	0.28
100	000893	亚钾国际	1,048,400	50,291,748.00	0.28
101	600298	安琪酵母	1,149,548	50,281,229.52	0.28
102	601717	中创智领	2,041,000	50,106,550.00	0.28
103	603179	新泉股份	676,000	49,942,880.00	0.28
104	002078	太阳纸业	3,169,472	49,919,184.00	0.28
105	300474	景嘉微	692,606	49,777,593.22	0.28
106	601615	明阳智能	3,419,800	49,518,704.00	0.27
107	600498	烽火通信	1,543,200	49,505,856.00	0.27
108	002271	东方雨虹	3,613,243	49,103,972.37	0.27
109	600536	中国软件	1,059,456	49,052,812.80	0.27
110	688019	安集科技	224,214	48,860,714.88	0.27
111	000657	中钨高新	1,721,600	47,705,536.00	0.26
112	300017	网宿科技	4,650,300	47,665,575.00	0.26
113	300073	当升科技	822,256	47,526,396.80	0.26
114	688676	金盘科技	524,240	47,359,841.60	0.26
115	002414	高德红外	3,228,100	47,356,227.00	0.26
116	601696	中银证券	3,149,200	47,206,508.00	0.26
117	300496	中科创达	697,300	47,067,750.00	0.26
118	601233	桐昆股份	2,726,270	46,919,106.70	0.26
119	688017	绿的谐波	243,869	46,847,234.90	0.26
120	601665	齐鲁银行	8,141,795	46,733,903.30	0.26
121	603606	东方电缆	778,900	46,539,275.00	0.26
122	603087	甘李药业	678,400	46,178,688.00	0.26
123	002080	中材科技	1,267,800	46,071,852.00	0.25
124	002444	巨星科技	1,354,168	46,068,795.36	0.25
125	600884	杉杉股份	3,401,345	45,952,170.95	0.25
126	300458	全志科技	1,092,830	45,931,644.90	0.25
127	600109	国金证券	4,902,900	45,596,970.00	0.25
128	688183	生益电子	474,216	45,377,729.04	0.25
129	002157	正邦科技	13,987,200	45,318,528.00	0.25
130	688568	中科星图	762,603	44,993,577.00	0.25

131	002085	万丰奥威	2,808,900	44,970,489.00	0.25
132	300757	罗博特科	191,080	44,578,964.00	0.25
133	601577	长沙银行	4,559,284	44,225,054.80	0.24
134	601128	常熟银行	6,268,631	44,131,162.24	0.24
135	300748	金力永磁	1,292,960	44,102,865.60	0.24
136	601179	中国西电	4,844,357	44,083,648.70	0.24
137	002155	湖南黄金	2,068,310	43,620,657.90	0.24
138	002223	鱼跃医疗	1,137,819	43,476,063.99	0.24
139	300699	光威复材	1,100,642	43,431,333.32	0.24
140	000559	万向钱潮	2,510,589	43,182,130.80	0.24
141	300012	华测检测	3,179,700	43,084,935.00	0.24
142	300024	机器人	2,367,100	43,057,549.00	0.24
143	600363	联创光电	682,100	43,013,226.00	0.24
144	300002	神州泰岳	3,717,398	42,824,424.96	0.24
145	002624	完美世界	2,567,600	42,082,964.00	0.23
146	300373	扬杰科技	616,900	41,949,200.00	0.23
147	000034	神州数码	1,076,100	41,871,051.00	0.23
148	000423	东阿阿胶	851,400	41,786,712.00	0.23
149	600497	驰宏锌锗	5,715,800	41,782,498.00	0.23
150	603160	汇顶科技	527,200	41,648,800.00	0.23
151	300285	国瓷材料	1,508,005	41,334,417.05	0.23
152	000728	国元证券	4,949,529	41,328,567.15	0.23
153	002064	华峰化学	3,751,388	41,265,268.00	0.23
154	002683	广东宏大	861,363	41,173,151.40	0.23
155	603596	伯特利	801,547	41,095,314.69	0.23
156	300919	中伟股份	886,120	41,053,939.60	0.23
157	688599	天合光能	2,471,469	40,902,811.95	0.23
158	002409	雅克科技	540,000	40,014,000.00	0.22
159	002673	西部证券	5,070,155	40,003,522.95	0.22
160	600765	中航重机	2,085,323	39,954,788.68	0.22
161	603920	世运电路	816,400	39,521,924.00	0.22
162	002410	广联达	3,123,600	39,294,888.00	0.22
163	688617	惠泰医疗	160,801	39,118,059.27	0.22
164	002065	东华软件	4,240,600	38,801,490.00	0.21
165	002756	永兴材料	714,530	38,763,252.50	0.21
166	688220	翱捷科技	476,941	38,688,596.01	0.21
167	300003	乐普医疗	2,439,100	38,562,171.00	0.21
168	000733	振华科技	734,616	38,501,224.56	0.21
169	000997	新大陆	1,339,850	37,944,552.00	0.21
170	002335	科华数据	683,048	37,929,655.44	0.21
171	600079	ST 人福	2,083,800	37,737,618.00	0.21
172	600873	梅花生物	3,709,413	37,576,353.69	0.21
173	600637	东方明珠	3,812,372	37,551,864.20	0.21
174	603766	隆鑫通用	2,328,450	37,511,329.50	0.21

175	601231	环旭电子	1,246,900	37,407,000.00	0.21
176	002318	久立特材	1,292,100	37,406,295.00	0.21
177	600862	中航高科	1,580,502	37,347,262.26	0.21
178	000932	华菱钢铁	6,530,520	36,701,522.40	0.20
179	000703	恒逸石化	3,405,527	36,677,525.79	0.20
180	000683	博源化工	4,918,200	36,591,408.00	0.20
181	000528	柳工	3,073,860	36,486,718.20	0.20
182	300627	华测导航	1,040,976	36,340,472.16	0.20
183	605589	圣泉集团	1,278,900	36,192,870.00	0.20
184	300972	万辰集团	179,526	36,097,292.82	0.20
185	600909	华安证券	5,305,604	35,971,995.12	0.20
186	600060	海信视像	1,480,160	35,938,284.80	0.20
187	688234	天岳先进	408,293	35,878,181.84	0.20
188	300001	特锐德	1,396,302	35,857,035.36	0.20
189	000750	国海证券	8,450,843	35,831,574.32	0.20
190	000830	鲁西化工	2,160,900	35,806,113.00	0.20
191	605358	立昂微	1,015,456	35,358,177.92	0.20
192	603486	科沃斯	437,600	35,305,568.00	0.20
193	000623	吉林敖东	1,807,687	35,304,127.11	0.20
194	000039	中集集团	3,482,490	35,138,324.10	0.19
195	688629	华丰科技	350,412	35,062,224.72	0.19
196	002821	凯莱英	377,100	35,043,903.00	0.19
197	603444	吉比特	82,100	34,798,085.00	0.19
198	600737	中粮糖业	2,021,853	34,796,090.13	0.19
199	000887	中鼎股份	1,493,200	34,657,172.00	0.19
200	688180	君实生物	1,014,168	34,643,978.88	0.19
201	000400	许继电气	1,347,200	34,636,512.00	0.19
202	300570	太辰光	299,600	34,618,780.00	0.19
203	000060	中金岭南	5,876,500	34,377,525.00	0.19
204	688052	纳芯微	216,679	34,274,284.22	0.19
205	600332	白云山	1,328,000	34,182,720.00	0.19
206	688322	奥比中光	381,150	34,177,720.50	0.19
207	300383	光环新网	2,719,800	34,024,698.00	0.19
208	688065	凯赛生物	680,112	33,869,577.60	0.19
209	600369	西南证券	7,537,700	33,768,896.00	0.19
210	300567	精测电子	369,500	33,698,400.00	0.19
211	300677	英科医疗	866,280	33,698,292.00	0.19
212	600521	华海药业	1,981,285	33,622,406.45	0.19
213	000009	中国宝安	3,412,732	33,615,410.20	0.19
214	600171	上海贝岭	1,072,500	33,515,625.00	0.19
215	601799	星宇股份	271,400	33,482,618.00	0.19
216	688387	信科移动	2,585,599	33,354,227.10	0.18
217	600177	雅戈尔	4,372,197	33,228,697.20	0.18
218	601990	南京证券	4,182,300	33,123,816.00	0.18

219	688702	盛科通信	233,738	33,118,337.22	0.18
220	300142	沃森生物	3,023,700	32,988,567.00	0.18
221	002203	海亮股份	2,600,000	32,916,000.00	0.18
222	001696	宗申动力	1,515,370	32,868,375.30	0.18
223	601212	白银有色	5,598,900	32,753,565.00	0.18
224	603568	伟明环保	1,287,898	32,686,851.24	0.18
225	600704	物产中大	5,867,555	32,682,281.35	0.18
226	688266	泽璟制药	352,120	32,641,524.00	0.18
227	601997	贵阳银行	5,529,720	32,459,456.40	0.18
228	002152	广电运通	2,349,200	32,442,452.00	0.18
229	688018	乐鑫科技	190,574	32,397,580.00	0.18
230	300432	富临精工	1,939,000	32,381,300.00	0.18
231	300763	锦浪科技	451,300	32,227,333.00	0.18
232	600486	扬农化工	459,636	31,894,142.04	0.18
233	000738	航发控制	1,491,767	31,789,554.77	0.18
234	002429	兆驰股份	4,280,500	31,761,310.00	0.18
235	002739	万达电影	2,793,500	31,622,420.00	0.17
236	002007	华兰生物	2,073,194	31,367,425.22	0.17
237	002044	美年健康	5,921,800	31,267,104.00	0.17
238	002841	视源股份	788,400	31,244,292.00	0.17
239	600801	华新建材	1,272,067	31,216,524.18	0.17
240	600378	昊华科技	975,400	31,173,784.00	0.17
241	600208	衢州发展	8,045,800	31,137,246.00	0.17
242	688375	国博电子	339,784	31,123,688.24	0.17
243	002939	长城证券	3,051,100	31,121,220.00	0.17
244	600435	北方导航	1,999,975	30,839,614.50	0.17
245	601216	君正集团	6,382,700	30,764,614.00	0.17
246	601611	中国核建	2,280,500	30,741,140.00	0.17
247	603605	珀莱雅	448,858	30,737,795.84	0.17
248	603345	安井食品	387,500	30,721,000.00	0.17
249	601567	三星医疗	1,327,400	30,556,748.00	0.17
250	603699	纽威股份	586,900	30,501,193.00	0.17
251	600153	建发股份	3,290,394	30,436,144.50	0.17
252	600516	方大炭素	5,329,374	30,324,138.06	0.17
253	688615	合合信息	133,041	30,277,470.78	0.17
254	600499	科达制造	2,176,300	30,185,281.00	0.17
255	002056	横店东磁	1,537,800	29,987,100.00	0.17
256	000729	燕京啤酒	2,665,052	29,928,533.96	0.17
257	688188	柏楚电子	219,471	29,823,914.19	0.16
258	688778	厦钨新能	383,628	29,681,298.36	0.16
259	300487	蓝晓科技	479,750	29,624,562.50	0.16
260	688114	华大智造	474,906	28,855,288.56	0.16
261	600642	申能股份	3,701,940	28,801,093.20	0.16
262	000519	中兵红箭	1,579,995	28,771,708.95	0.16

263	603816	顾家家居	931,400	28,631,236.00	0.16
264	603728	鸣志电器	395,400	28,607,190.00	0.16
265	601958	金钼股份	1,831,700	28,537,886.00	0.16
266	000155	川能动力	2,442,800	28,458,620.00	0.16
267	000415	渤海租赁	7,015,100	28,411,155.00	0.16
268	600316	洪都航空	812,457	28,362,873.87	0.16
269	301611	珂玛科技	328,800	28,188,024.00	0.16
270	600348	华阳股份	3,412,060	28,183,615.60	0.16
271	688692	达梦数据	107,649	28,125,454.23	0.16
272	600038	中直股份	776,397	28,051,223.61	0.16
273	603379	三美股份	461,489	28,021,612.08	0.15
274	002262	恩华药业	1,152,958	27,820,876.54	0.15
275	688538	和辉光电	10,444,404	27,782,114.64	0.15
276	688772	珠海冠宇	1,284,427	27,653,713.31	0.15
277	600863	内蒙华电	6,170,340	27,643,123.20	0.15
278	002926	华西证券	2,977,400	27,630,272.00	0.15
279	688166	博瑞医药	562,819	27,611,900.14	0.15
280	002430	杭氧股份	924,400	27,611,828.00	0.15
281	603806	福斯特	1,972,538	27,536,630.48	0.15
282	600398	海澜之家	4,539,977	27,466,860.85	0.15
283	000723	美锦能源	5,829,004	27,396,318.80	0.15
284	300679	电连技术	562,500	27,382,500.00	0.15
285	603156	养元饮品	952,181	27,375,203.75	0.15
286	000629	钒钛股份	8,783,607	27,229,181.70	0.15
287	603338	浙江鼎力	478,470	27,100,540.80	0.15
288	600967	内蒙一机	1,609,219	27,034,879.20	0.15
289	600820	隧道股份	4,161,500	27,008,135.00	0.15
290	002603	以岭药业	1,579,600	26,963,772.00	0.15
291	600563	法拉电子	256,538	26,923,663.10	0.15
292	600901	江苏金租	4,381,698	26,815,991.76	0.15
293	600170	上海建工	10,080,300	26,712,795.00	0.15
294	601699	潞安环能	2,263,400	26,708,120.00	0.15
295	600312	平高电气	1,539,307	26,706,976.45	0.15
296	600562	国睿科技	938,800	26,530,488.00	0.15
297	603077	和邦生物	11,690,464	26,420,448.64	0.15
298	603298	杭叉集团	990,460	26,316,522.20	0.15
299	600166	福田汽车	8,983,100	26,230,652.00	0.15
300	001389	广合科技	321,022	26,205,025.86	0.14
301	601399	国机重装	5,454,600	26,072,988.00	0.14
302	002958	青农商行	8,404,300	26,053,330.00	0.14
303	002385	大北农	6,506,029	26,024,116.00	0.14
304	688278	特宝生物	310,275	25,963,812.00	0.14
305	002025	航天电器	516,714	25,902,872.82	0.14
306	601106	中国一重	6,484,800	25,874,352.00	0.14

307	603737	三棵树	558,251	25,830,273.77	0.14
308	600970	中材国际	2,478,145	25,747,926.55	0.14
309	300100	双林股份	649,600	25,737,152.00	0.14
310	300623	捷捷微电	943,535	25,635,845.95	0.14
311	002607	中公教育	9,329,200	25,562,008.00	0.14
312	688582	芯动联科	381,715	25,235,178.65	0.14
313	000050	深天马 A	2,789,300	25,187,379.00	0.14
314	300676	华大基因	553,860	25,023,089.60	0.14
315	600008	首创环保	8,328,007	24,984,021.00	0.14
316	603939	益丰药房	1,146,728	24,906,932.16	0.14
317	002984	森麒麟	1,175,940	24,894,649.80	0.14
318	003031	中瓷电子	340,220	24,890,495.20	0.14
319	002432	九安医疗	615,800	24,656,632.00	0.14
320	600329	达仁堂	539,100	24,593,742.00	0.14
321	603885	吉祥航空	1,652,330	24,586,670.40	0.14
322	601991	大唐发电	7,033,152	24,545,700.48	0.14
323	600282	南钢股份	4,662,800	24,526,328.00	0.14
324	600998	九州通	4,767,710	24,410,675.20	0.13
325	002500	山西证券	4,072,260	24,392,837.40	0.13
326	688297	中无人机	513,084	24,389,893.68	0.13
327	300144	宋城演艺	2,977,074	24,382,236.06	0.13
328	688301	奕瑞科技	241,049	24,372,464.39	0.13
329	600380	健康元	2,075,563	23,972,752.65	0.13
330	600095	湘财股份	2,162,900	23,921,674.00	0.13
331	600132	重庆啤酒	457,201	23,884,180.24	0.13
332	601155	新城控股	1,710,531	23,861,907.45	0.13
333	600763	通策医疗	592,432	23,821,690.72	0.13
334	603589	口子窖	790,400	23,751,520.00	0.13
335	000513	丽珠集团	686,443	23,654,825.78	0.13
336	600390	五矿资本	4,253,100	23,604,705.00	0.13
337	002312	川发龙蟒	2,143,800	23,431,734.00	0.13
338	002244	滨江集团	2,354,694	23,389,674.70	0.13
339	002583	海能达	2,063,200	23,355,424.00	0.13
340	000987	越秀资本	2,847,261	23,176,704.54	0.13
341	300146	汤臣倍健	1,918,431	23,040,356.31	0.13
342	000591	太阳能	5,186,600	23,028,504.00	0.13
343	600583	海油工程	4,180,200	22,949,298.00	0.13
344	601608	中信重工	3,462,794	22,819,812.46	0.13
345	600995	南网储能	1,814,273	22,805,411.61	0.13
346	600602	云赛智联	1,219,700	22,796,193.00	0.13
347	003021	兆威机电	182,600	22,675,268.00	0.13
348	600985	淮北矿业	2,036,800	22,628,848.00	0.13
349	601865	福莱特	1,437,300	22,522,491.00	0.12
350	603225	新凤鸣	1,153,680	22,450,612.80	0.12

351	601880	辽港股份	13,925,990	22,281,584.00	0.12
352	300558	贝达药业	477,100	22,275,799.00	0.12
353	600977	中国电影	1,411,400	22,187,208.00	0.12
354	600685	中船防务	777,900	22,131,255.00	0.12
355	601156	东航物流	1,201,574	22,120,977.34	0.12
356	601666	平煤股份	2,802,500	22,055,675.00	0.12
357	688728	格科微	1,475,090	22,037,844.60	0.12
358	603290	斯达半导	227,580	21,868,162.20	0.12
359	600754	锦江酒店	859,700	21,724,619.00	0.12
360	000921	海信家电	873,950	21,682,699.50	0.12
361	002568	百润股份	991,060	21,615,018.60	0.12
362	601016	节能风电	7,309,424	21,562,800.80	0.12
363	601000	唐山港	5,604,552	21,521,479.68	0.12
364	300735	光弘科技	869,800	21,500,228.00	0.12
365	600535	天士力	1,411,720	21,274,620.40	0.12
366	600848	上海临港	1,811,860	21,198,762.00	0.12
367	600004	白云机场	2,238,400	21,175,264.00	0.12
368	000825	太钢不锈	4,309,100	21,071,499.00	0.12
369	600816	建元信托	7,445,220	21,069,972.60	0.12
370	603927	中科软	1,100,312	20,980,956.08	0.12
371	002773	康弘药业	697,600	20,907,072.00	0.12
372	600126	杭钢股份	2,554,124	20,841,651.84	0.12
373	000032	深桑达 A	1,076,000	20,820,600.00	0.12
374	601001	晋控煤业	1,582,500	20,809,875.00	0.12
375	603650	彤程新材	465,700	20,555,998.00	0.11
376	600511	国药股份	714,254	20,534,802.50	0.11
377	002266	浙富控股	4,935,713	20,532,566.08	0.11
378	002423	中粮资本	1,743,600	20,400,120.00	0.11
379	000598	兴蓉环境	2,822,256	20,235,575.52	0.11
380	600598	北大荒	1,346,104	20,124,254.80	0.11
381	601966	玲珑轮胎	1,382,700	20,090,631.00	0.11
382	000563	陕国投 A	5,802,300	20,017,935.00	0.11
383	603000	人民网	1,045,354	19,913,993.70	0.11
384	600483	福能股份	2,102,805	19,913,563.35	0.11
385	002831	裕同科技	697,058	19,873,123.58	0.11
386	000958	电投产融	3,053,500	19,756,145.00	0.11
387	000062	深圳华强	792,400	19,508,888.00	0.11
388	600517	国网英大	3,244,422	19,498,976.22	0.11
389	601333	广深铁路	6,413,401	19,496,739.04	0.11
390	002299	圣农发展	1,176,000	19,451,040.00	0.11
391	601918	新集能源	2,938,067	19,420,622.87	0.11
392	600739	辽宁成大	1,736,374	19,412,661.32	0.11
393	002439	启明星辰	1,373,400	19,392,408.00	0.11
394	300718	长盛轴承	227,100	19,385,256.00	0.11

395	600578	京能电力	3,798,400	19,371,840.00	0.11
396	688318	财富趋势	146,012	19,320,307.84	0.11
397	688281	华秦科技	258,985	19,113,093.00	0.11
398	301536	星宸科技	318,000	19,051,380.00	0.11
399	600808	马钢股份	4,512,800	19,044,016.00	0.11
400	601118	海南橡胶	3,237,303	18,938,222.55	0.10
401	600546	山煤国际	1,873,200	18,900,588.00	0.10
402	600655	豫园股份	3,682,500	18,891,225.00	0.10
403	603899	晨光股份	697,433	18,872,536.98	0.10
404	000951	中国重汽	1,111,100	18,777,590.00	0.10
405	603341	龙旗科技	444,256	18,774,258.56	0.10
406	300601	康泰生物	1,268,300	18,732,791.00	0.10
407	603688	石英股份	512,050	18,730,789.00	0.10
408	601866	中远海发	7,378,938	18,594,923.76	0.10
409	002670	国盛证券	1,097,986	18,490,084.24	0.10
410	002120	韵达股份	2,741,700	18,479,058.00	0.10
411	688561	奇安信	518,597	18,451,681.26	0.10
412	600566	济川药业	697,625	18,347,537.50	0.10
413	600131	国网信通	1,133,444	18,293,786.16	0.10
414	600582	天地科技	3,130,200	18,249,066.00	0.10
415	000883	湖北能源	4,017,700	18,240,358.00	0.10
416	000709	河钢股份	7,821,100	18,066,741.00	0.10
417	603786	科博达	230,258	17,983,149.80	0.10
418	603833	欧派家居	344,700	17,955,423.00	0.10
419	000739	普洛药业	1,095,514	17,824,012.78	0.10
420	300529	健帆生物	905,390	17,809,021.30	0.10
421	601598	中国外运	2,930,600	17,759,436.00	0.10
422	600663	陆家嘴	2,232,566	17,659,597.06	0.10
423	600707	彩虹股份	2,714,600	17,617,754.00	0.10
424	000027	深圳能源	2,699,180	17,598,653.60	0.10
425	000967	盈峰环境	2,394,289	17,574,081.26	0.10
426	000088	盐田港	3,931,500	17,495,175.00	0.10
427	002508	老板电器	892,600	17,271,810.00	0.10
428	600528	中铁工业	2,100,425	17,181,476.50	0.10
429	000582	北部湾港	1,793,400	16,822,092.00	0.09
430	002153	石基信息	1,548,129	16,766,237.07	0.09
431	688709	成都华微	363,062	16,697,221.38	0.09
432	300888	稳健医疗	440,060	16,651,870.40	0.09
433	600871	石化油服	7,686,700	16,603,272.00	0.09
434	600906	财达证券	2,456,200	16,382,854.00	0.09
435	600959	江苏有线	4,728,106	16,264,684.64	0.09
436	300070	碧水源	4,111,500	16,117,080.00	0.09
437	688363	华熙生物	366,136	15,992,820.48	0.09
438	603565	中谷物流	1,588,500	15,948,540.00	0.09

439	300957	贝泰妮	399,900	15,840,039.00	0.09
440	002265	建设工业	586,325	15,725,236.50	0.09
441	603858	步长制药	996,758	15,589,295.12	0.09
442	688172	燕东微	537,655	15,559,735.70	0.09
443	688425	铁建重工	3,025,409	15,338,823.63	0.08
444	601098	中南传媒	1,359,975	15,313,318.50	0.08
445	603233	大参林	860,468	15,161,446.16	0.08
446	688192	迪哲医药	262,920	15,144,192.00	0.08
447	003022	联泓新科	758,800	15,031,828.00	0.08
448	688563	航材股份	256,542	14,994,879.90	0.08
449	301498	乖宝宠物	228,300	14,873,745.00	0.08
450	600968	海油发展	3,844,500	14,762,880.00	0.08
451	600764	中国海防	537,600	14,697,984.00	0.08
452	601061	中信金属	1,019,100	14,675,040.00	0.08
453	603529	爱玛科技	492,850	14,637,645.00	0.08
454	601928	凤凰传媒	1,443,081	14,488,533.24	0.08
455	301200	大族数控	121,315	14,408,582.55	0.08
456	688248	南网科技	321,932	14,403,237.68	0.08
457	600062	华润双鹤	786,988	14,394,010.52	0.08
458	000959	首钢股份	2,934,400	14,378,560.00	0.08
459	603893	瑞芯微	80,000	14,113,600.00	0.08
460	688336	三生国健	234,417	13,964,220.69	0.08
461	600295	鄂尔多斯	1,121,080	13,856,548.80	0.08
462	000785	居然智家	4,709,900	13,752,908.00	0.08
463	002032	苏泊尔	302,000	13,312,160.00	0.07
464	600606	绿地控股	7,975,800	13,239,828.00	0.07
465	001286	陕西能源	1,420,053	13,220,693.43	0.07
466	600098	广州发展	1,988,300	13,003,482.00	0.07
467	301301	川宁生物	1,266,200	12,839,268.00	0.07
468	000537	中绿电	1,563,100	12,833,051.00	0.07
469	601965	中国汽研	759,800	12,612,680.00	0.07
470	002372	伟星新材	1,204,963	12,567,764.09	0.07
471	600720	中交设计	1,736,420	12,536,952.40	0.07
472	688349	三一重能	466,110	11,783,260.80	0.07
473	000429	粤高速 A	987,900	11,637,462.00	0.06
474	600688	上海石化	4,157,300	11,557,294.00	0.06
475	603658	安图生物	323,066	11,442,997.72	0.06
476	000898	鞍钢股份	4,515,813	11,425,006.89	0.06
477	688295	中复神鹰	342,056	11,222,857.36	0.06
478	688100	威胜信息	280,307	11,016,065.10	0.06
479	688520	神州细胞	253,883	10,995,672.73	0.06
480	000937	冀中能源	2,004,100	10,782,058.00	0.06
481	601139	深圳燃气	1,632,240	10,772,784.00	0.06
482	600339	中油工程	3,167,300	10,610,455.00	0.06

483	002608	江苏国信	1,428,100	10,553,659.00	0.06
484	601019	山东出版	1,184,578	10,234,753.92	0.06
485	600032	浙江新能	1,363,100	10,100,571.00	0.06
486	003035	南网能源	2,149,000	9,842,420.00	0.05
487	603049	中策橡胶	166,181	9,297,826.95	0.05
488	601228	广州港	2,854,400	9,248,256.00	0.05
489	688475	萤石网络	299,299	9,011,892.89	0.05
490	600927	永安期货	550,600	8,848,142.00	0.05
491	688819	天能股份	258,621	8,591,389.62	0.05
492	603707	健友股份	915,819	8,269,845.57	0.05
493	300140	节能环境	1,172,600	7,938,502.00	0.04
494	002945	华林证券	510,500	7,825,965.00	0.04
495	002461	珠江啤酒	838,600	7,790,594.00	0.04
496	600007	中国国贸	380,239	7,536,336.98	0.04
497	000539	粤电力 A	1,684,200	7,444,164.00	0.04
498	600299	安迪苏	761,900	6,834,243.00	0.04
499	001213	中铁特货	1,681,400	6,809,670.00	0.04
500	601921	浙版传媒	839,408	6,564,170.56	0.04
501	688795	摩尔线程	10,828	4,504,664.56	0.02
502	001221	悍高集团	68,460	3,964,363.40	0.02
503	688802	沐曦股份	3,994	1,595,203.60	0.01
504	600930	华电新能	254,555	1,588,423.20	0.01
505	688765	禾元生物	16,470	869,616.00	0.00
506	688783	西安奕材	44,370	815,964.30	0.00
507	688759	必贝特	12,552	315,431.76	0.00
508	688790	昂瑞微	2,319	271,485.33	0.00
509	301656	联合动力	7,395	188,276.70	0.00
510	001280	中国铀业	2,277	103,284.72	0.00
511	688729	屹唐股份	3,505	85,101.40	0.00
512	688809	强一股份	259	52,657.29	0.00
513	301638	南网数字	2,322	32,995.62	0.00
514	001386	马可波罗	1,626	30,129.78	0.00
515	688727	恒坤新材	563	19,631.81	0.00
516	001233	海安集团	370	19,195.60	0.00
517	688796	百奥赛图	423	17,871.75	0.00
518	688807	优迅股份	131	17,758.36	0.00
519	301632	广东建科	656	15,534.08	0.00
520	301563	云汉芯城	110	14,705.90	0.00
521	301491	汉桑科技	245	13,501.95	0.00
522	301584	建发致新	447	11,988.54	0.00
523	001369	双欣环保	897	11,562.33	0.00
524	301609	山大电力	277	11,354.23	0.00
525	301687	新广益	195	10,606.05	0.00
526	301667	纳百川	151	8,617.57	0.00

527	688805	健信超导	265	8,578.05	0.00
528	603418	友升股份	139	8,209.34	0.00
529	603175	超颖电子	169	8,206.64	0.00
530	603092	德力佳	146	8,126.36	0.00
531	001285	瑞立科密	137	7,682.96	0.00
532	301668	昊创瑞通	165	7,392.00	0.00
533	301449	天溯计量	112	7,305.76	0.00
534	601026	道生天合	451	6,440.28	0.00
535	301575	艾芬达	126	6,243.30	0.00
536	603406	天富龙	153	6,144.48	0.00
537	603262	技源集团	155	4,355.50	0.00
538	603248	锡华科技	260	4,238.00	0.00
539	001388	信通电子	94	4,036.36	0.00
540	603370	华新精科	82	3,800.70	0.00
541	603376	大明电子	111	2,909.31	0.00
542	603334	丰倍生物	88	2,888.16	0.00
543	001396	誉帆科技	69	2,441.91	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	300476	胜宏科技	94,206,246.60	0.69
2	002156	通富微电	78,374,990.26	0.57
3	002402	和而泰	77,702,844.73	0.57
4	688347	华虹公司	76,829,763.44	0.56
5	300450	先导智能	74,640,465.08	0.55
6	002130	沃尔核材	72,805,220.00	0.53
7	000933	神火股份	72,370,561.10	0.53
8	688608	恒玄科技	71,597,817.46	0.52
9	000988	华工科技	69,630,409.82	0.51
10	002128	电投能源	68,165,404.02	0.50
11	002131	利欧股份	66,243,857.00	0.49
12	600601	方正科技	65,132,485.00	0.48
13	002851	麦格米特	63,776,818.39	0.47
14	300454	深信服	62,917,162.57	0.46
15	002966	苏州银行	62,037,809.49	0.45
16	002261	拓维信息	61,217,422.78	0.45
17	300346	南大光电	61,140,791.70	0.45
18	300339	润和软件	60,624,259.96	0.44
19	688235	百济神州	59,460,066.02	0.44

20	300115	长盈精密	59,090,963.12	0.43

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。

8.4.2 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	300476	胜宏科技	416,690,432.54	3.05
2	000988	华工科技	215,999,236.38	1.58
3	002625	光启技术	149,282,729.90	1.09
4	600418	江淮汽车	119,446,760.97	0.88
5	300803	指南针	117,828,698.66	0.86
6	002384	东山精密	104,304,634.55	0.76
7	688521	芯原股份	98,266,500.44	0.72
8	688072	拓荆科技	95,774,105.06	0.70
9	000066	中国长城	90,139,423.50	0.66
10	300251	光线传媒	82,198,584.26	0.60
11	301236	软通动力	82,129,625.89	0.60
12	002156	通富微电	74,892,261.10	0.55
13	603893	瑞芯微	71,768,500.98	0.53
14	300339	润和软件	64,177,550.15	0.47
15	600839	四川长虹	62,283,426.64	0.46
16	300866	安克创新	60,014,578.86	0.44
17	300604	长川科技	58,483,896.25	0.43
18	600895	张江高科	57,540,969.74	0.42
19	300765	新诺威	56,130,865.43	0.41
20	302132	中航成飞	56,015,157.10	0.41

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。

8.4.3 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	9,639,154,232.09
卖出股票收入（成交）总额	9,224,476,040.51

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。

8.5 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）	1,915,029.38	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,915,029.38	0.01

8.6 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	118063	金 05 转债	19,150	1,915,029.38	0.01
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 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。

8.11.2 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。

8.12 本报告期投资基金情况

8.12.1 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。

8.13 投资组合报告附注

8.13.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，赤峰吉隆黄金矿业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，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。

8.13.2 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。

8.13.3 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	36,135,087.23
2	应收清算款	50,523,390.44
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	86,658,477.67

8.13.4 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。

8.13.5 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。

8.13.6 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。

§9 基金份额持有人信息

9.1 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	持有人结构		
		机构投资者	个人投资者	华夏中证 500ETF 联接

	额	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
15,442	281,052.25	3,684,550,380.00	84.90%	166,381,991.00	3.83%	489,076,423.00	11.27%

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。

9.2 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	47.26%
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	803,000,000.00	18.50%
3	中国人寿保险股份有限公司	124,927,268.00	2.88%
4	中国平安人寿保险股份有限公司－分红－个险分红	76,279,088.00	1.76%
5	北京诚旸投资有限公司－诚旸灵活配置私募证券投资基金	68,687,900.00	1.58%
6	中国平安财产保险股份有限公司－传统－普通保险产品	59,557,400.00	1.37%
7	大家人寿保险股份有限公司－万能产品	57,286,774.00	1.32%
8	大家人寿保险股份有限公司－传统产品	47,090,275.00	1.09%
9	大家人寿保险股份有限公司－分红产品	45,563,000.00	1.05%
10	中国平安人寿保险股份有限公司－自有资金	44,422,000.00	1.02%
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	489,076,423.00	11.27%

9.3 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	-	-

9.4 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

§10 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	2,940,800,000
减：本报告期基金总赎回份额	2,948,000,000
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	4,340,008,794

§11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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，邹迎光先生担任本基金管理人董事长，李一梅女士担任本基金管理人副董事长，张佑君先生离任本基金管理人董事长。

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。

11.3 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。

11.4 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。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期应支付给安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为 75,000.00 元人民币。截至本报告期末，该事务所已向本基金提供 2 年的审计服务。

11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

11.6.1 管理人受调查或处罚等情况

管理人受调查或处罚等情况	内容
受到调查或处罚等措施的主体	华夏基金管理有限公司
受到调查或处罚等措施的时间	2025 年 11 月 4 日
采取调查或处罚等措施的机构	中国证监会北京监管局
受到调查或处罚等措施类型	行政监管措施
受到的具体措施类型	出具警示函
受到调查或处罚等措施的原因	人员管理、其他问题（内部控制、销售管理等）
受到处罚的依据	《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》《公开募集证券投资基金运作管理办法》《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》《证券发行与承销管理办法(2018 年修订)》《公开募集证券投资基金宣传推介材料管理暂行规定》《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》《证券期货经营机构及其工作人员廉洁从业规定》《证券基金经营机构信息技术管理办法(2021 年修正)》《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》《证券公司和证券投资基金管理公司境外设立、收购、参股经营机构管理办法(2021 年修正)》
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	基金管理人高度重视，从业务改进、制度优化、培训宣贯等方面进行了整改，现已完成全部整改工作，并向监管机构报送整改报告。
其他	无

11.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

管理人相关从业人员受调查或处罚等情况	内容
受到调查或处罚等措施的主体	高级管理人员
受到调查或处罚等措施的时间	2025 年 12 月 26 日
采取调查或处罚等措施的机构	中国证监会北京监管局
受到调查或处罚等措施类型	行政监管措施
受到的具体措施类型	出具警示函
受到调查或处罚等措施的原因	人员管理、其他问题（内部控制、销售管理等）
受到处罚的依据	《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	基金管理人高度重视，从业务改进、制度优化、培训宣贯等方面进行了整改，现已完成全部整改工作，并向监管机构报送整改报告。
其他	无

11.6.3 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。

11.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	6,424,417,358.93	34.10%	616,335.28	34.06%	-
中信证券	18	3,285,847,668.23	17.44%	315,746.87	17.45%	-
申万宏源证券	2	2,127,942,927.93	11.29%	204,066.98	11.28%	-
招商证券	2	1,970,158,428.83	10.46%	188,954.75	10.44%	-
中信建投证券	4	1,614,267,001.66	8.57%	155,586.20	8.60%	-
中金公司	5	1,402,658,666.95	7.44%	135,286.56	7.48%	-
广发证券	1	860,177,691.72	4.57%	82,771.09	4.57%	-
东方证券	1	800,930,128.79	4.25%	76,821.22	4.24%	-
方正证券	1	307,690,343.04	1.63%	29,574.00	1.63%	-
国泰海通证券	3	47,721,287.18	0.25%	4,649.40	0.26%	-

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，本基金还选择了光大证券、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，东兴证券的交易单元为本期剔除的交易单元。

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”。

11.7.2 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	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	4,023,831.96	22.96%	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	5,868,763.66	33.48%	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	545,373.14	3.11%	-	-	-	-	-	-
中金公司	4,421,157.97	25.23%	-	-	-	-	-	-
广发证券	2,667,467.03	15.22%	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-

11.8 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
6	华夏基金管理有限公司公告	中国证监会规定报刊及网站	2025-07-11
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	2025-07-11
8	华夏基金管理有限公司关于设立北京华夏金科信息服务有限公司的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025-08-06
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	2025-09-25
10	华夏基金管理有限公司公告	中国证监会规定报刊及网站	2025-10-01
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	中国证监会规定报刊及网站	2025-10-23
12	华夏基金管理有限公司关于旗下交易型开放式指数基金在首批科创成长层股票上市首日的风险提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2025-10-28
13	华夏基金管理有限公司关于调整旗下部分交易型开放式指数证券投资基金申购赎回现金替代相关内容并修订招募说明书的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025-11-24
14	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	2025-11-27
15	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	2025-12-12
16	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	2025-12-25
17	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	2025-12-26

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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	2,050,885,600.00	-	-	2,050,885,600.00	47.26%

		2025-12-31					
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。							

§13 备查文件目录

13.1 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。

13.2 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。

13.3 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

二〇二六年三月三十一日