

华夏沪深 300 交易型开放式指数  
证券投资基金  
2024 年中期报告  
2024 年 6 月 30 日

基金管理人：华夏基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二四年八月三十日

## §1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 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 2024 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.....	12
§6 中期报告财务会计报告（未经审计）.....	12
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	14
6.3 净资产变动表.....	15
6.4 报表附注.....	16
§7 投资组合报告.....	42
7.1 期末基金资产组合情况.....	42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	43
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.....	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	51
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	52
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.....	52
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.....	53
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.....	53
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.....	53
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	53
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	53
7.12 投资组合报告附注.....	53
§8 基金份额持有人信息.....	54
§9 开放式基金份额变动.....	55
§10 重大事件揭示.....	55
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	58
§12 备查文件目录.....	58

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	华夏沪深 300ETF
场内简称	华夏 300（扩位证券简称：沪深 300ETF 华夏）
基金主代码	510330
交易代码	510330
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2012 年 12 月 25 日
基金管理人	华夏基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	27,828,249,828 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	2013 年 1 月 16 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、权证投资策略等。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为沪深 300 指数。
风险收益特征	本基金属于股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股，在股票基金中属于较高风险、较高收益的产品。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华夏基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李彬	郭明
	联系电话	400-818-6666	010-66105799
	电子邮箱	service@ChinaAMC.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-818-6666	95588
传真		010-63136700	010-66105798
注册地址		北京市顺义区安庆大街甲3号院	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址		北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座8层	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码		100033	100140
法定代表人		张佑君	廖林

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.ChinaAMC.com
基金中期报告备置地点	基金管理人和/或基金托管人的住所/办公地址

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
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（2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	44,068,804.93
本期利润	3,897,722,462.50
加权平均基金份额本期利润	0.1619
本期加权平均净值利润率	4.51%
本期基金份额净值增长率	1.65%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024年6月30日)
期末可供分配利润	31,235,530,374.96
期末可供分配基金份额利润	1.1224
期末基金资产净值	99,221,094,884.26
期末基金份额净值	3.5655
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年6月30日)
基金份额累计净值增长率	77.58%

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
过去一个月	-2.65%	0.48%	-3.30%	0.48%	0.65%	0.00%
过去三个	-1.26%	0.75%	-2.14%	0.76%	0.88%	-0.01%

月						
过去六个月	1.65%	0.90%	0.89%	0.90%	0.76%	0.00%
过去一年	-8.21%	0.87%	-9.91%	0.87%	1.70%	0.00%
过去三年	-30.03%	1.04%	-33.74%	1.05%	3.71%	-0.01%
自基金合同生效起至今	77.58%	1.36%	45.37%	1.37%	32.21%	-0.01%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金  
 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  
 (2012 年 12 月 25 日至 2024 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，国内首家承诺“碳中和”具体目标和路径的公募基金公司，香港子公司是首批 RQFII 基金管理人。华夏基金是业务领域最广泛的基金管理公司之一。

华夏基金是境内 ETF 基金资产管理规模最大的基金管理公司之一，在 ETF 基金管理方面积累了丰富的经验，形成了覆盖大盘蓝筹、宽基指数、中小创指数、主题指数、行业指数、SmartBeta 策略、海外市场指数、信用债指数、商品指数等较为完整的产品线。

华夏基金以深入的投资研究为基础，尽力捕捉市场机会，为投资人谋求良好的回报。根据银河证券基金研究中心《中国基金业绩评价报告》，截至 2024 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 1/10；在对冲策略绝对收益目标基金(A 类)华夏安泰对冲策略 3 个月定开混合排名第 1/22；在 QDII 混合基金(A 类)中华夏全球科技先锋混合(QDII)排名第 2/48；在汽车主题行业偏股型基金(A 类)中华夏新能源车龙头混合发起式(A 类)排名第 3/17；在消费行业偏股型基金(A 类)中华夏网购精选混合(A 类)排名第 3/78、华夏消费臻选混合发起式(A 类)排名第 7/78。

固收与固收+产品：在 QDII 债券型基金(A 类)中华夏收益债券 (QDII) (A 类)排名第 1/24、华夏大中华信用债券 (QDII) (A 类)排名第 2/24；在信用债指数债券型基金(A 类)中华夏亚债中国指数(A 类)排名第 2/18；在定开纯债债券型基金(A 类)中华夏鼎华一年定开债券排名第 5/616、华夏鼎成一年定开债券排名第 14/616；在普通债券型基金(可投转债)(A 类)中华夏稳定双利债券(A 类)排名第 12/241；在长期纯债债券型基金(A 类)中华夏鼎航债券(A 类)排名第 7/793、华夏鼎茂债券(A 类)排名第 19/793、华夏鼎英债券(A 类)排名第 25/793、华夏鼎隆债券(A 类)排名第 26/793、华夏鼎信债券(A 类)排名第 52/793；在普通债券型基金(二级)(A 类)中华夏稳享增利 6 个月债券(A 类)排名第 13/416、华夏鼎源债券(A 类)排名第 27/416、华夏希望债券(A 类)排名第 29/416。

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，华夏创新前沿股票荣获“金基金·股票型基金五年期奖”，华夏行业景气混合荣获“金基金·偏股混合型基金五年期奖”。

在客户服务方面，2024 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，升级搜索及查询等功能，给客户更方便直观的使用体验；（2）华夏基金管家客户端上线亲子账户，通过亲子账户客户可以为子女创建专属理财账户，管理和储备孩子的零花钱、教育资金，从客户投资需求出发，进一步提升操作体验；（3）与常熟农商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“送你长期主义的花朵”、“领定制户口本”、“打工人又爱又怕的一天要来了”、“希望高考也这么简单”等活动，为客户提供了多样化的投资者教育和关怀服务。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
赵宗庭	本基金的基金经理	2017-04-17	-	16 年	硕士。曾任华夏基金管理有限公司研究发展部产品经理、数量投资部研究员，嘉实基金管理有限公司指数投资部基金经理助理，嘉实国际资产管理有限公司基金经理。2016 年 11 月加入华夏基金管理有限公司。历任华夏中证四川国企改革交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理（2020 年 12 月 8 日至 2022 年 1 月 13 日期间）、华夏中证四川国企改革交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2020 年 12 月 8 日至 2022 年 1 月 13 日期间）、华夏中证浙江国资创新发展交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2020 年 12 月 8 日至 2022 年 1 月 13 日期间）、华夏中证浙江国资创新发展交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（2020 年 12 月 8 日至 2022 年 1 月

					<p>13 日期间)、上证主要消费交易型开放式指数发起式证券投资基金基金经理 (2020 年 2 月 12 日至 2022 年 8 月 22 日期间)、华夏中证大数据产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理 (2021 年 2 月 9 日至 2022 年 8 月 22 日期间)、华夏中证新能源交易型开放式指数证券投资基金基金经理 (2021 年 3 月 9 日至 2022 年 8 月 22 日期间)、华夏中证新材料主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理 (2021 年 8 月 4 日至 2023 年 3 月 27 日期间)、华夏中证石化产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理 (2021 年 12 月 2 日至 2023 年 3 月 27 日期间)、华夏国证消费电子主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理 (2021 年 8 月 12 日至 2023 年 6 月 29 日期间)、华夏中证机器人交易型开放式指数证券投资基金基金经理 (2021 年 12 月 17 日至 2023 年 6 月 29 日期间)、华夏中证细分有色金属产业主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理 (2021 年 6 月 9 日至 2023 年 12 月 28 日期间)、华夏中证细分有色金属产业主题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 (2022 年 10 月 18 日至 2023 年 12 月 28 日期间)等。</p>
张弘弢	本基金的基金经理、投委会成员	2012-12-25	-	24 年	<p>硕士。2000 年 4 月加入华夏基金管理有限公司。历任研究发展部总经理、数量投资部副总经理、上证能源交易型开放式指数发起式证券投资基金基金经理 (2013 年 3 月 28 日至 2016 年 3 月 28 日期间)、恒生交易型开放式指数证券投资基金基金经理 (2012 年 8 月 9 日至 2017 年 11 月 10 日期间)、恒生交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理 (2012 年 8 月 21 日至 2017 年 11 月 10 日期间)、华夏沪港通恒生交易型开放式指数证券投资基金基金经理 (2014 年 12 月 23 日至</p>

				<p>2017 年 11 月 10 日期间)、华夏沪港通恒生交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理 (2015 年 1 月 13 日至 2017 年 11 月 10 日期间)、MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金基金经理 (2015 年 2 月 12 日至 2017 年 11 月 10 日期间)、MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理 (2015 年 2 月 12 日至 2017 年 11 月 10 日期间)、华夏睿磐泰利六个月定期开放混合型证券投资基金基金经理 (2017 年 12 月 27 日至 2019 年 2 月 26 日期间)、华夏睿磐泰盛六个月定期开放混合型证券投资基金基金经理 (2017 年 3 月 15 日至 2021 年 1 月 5 日期间)、华夏睿磐泰兴混合型证券投资基金基金经理 (2017 年 7 月 14 日至 2021 年 5 月 26 日期间)、华夏睿磐泰茂混合型证券投资基金基金经理 (2017 年 12 月 6 日至 2021 年 5 月 26 日期间)、华夏睿磐泰荣混合型证券投资基金基金经理 (2017 年 12 月 27 日至 2021 年 5 月 26 日期间)、华夏睿磐泰利混合型证券投资基金基金经理 (2019 年 2 月 27 日至 2021 年 5 月 26 日期间)、华夏睿磐泰盛混合型证券投资基金基金经理 (2021 年 1 月 6 日至 2021 年 5 月 26 日期间)、上证医药卫生交易型开放式指数发起式证券投资基金基金经理 (2013 年 3 月 28 日至 2021 年 5 月 27 日期间)、华夏鼎融债券型证券投资基金基金经理 (2016 年 12 月 29 日至 2022 年 3 月 7 日期间)等。</p>
--	--	--	--	---

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

②证券从业的含义遵从行业协会《证券投资基金经营机构董事、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 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量 (只)	资产净值(元)	任职时间
----	------	----------	---------	------

张弘弢	公募基金	8	309,439,843,876.75	2009-07-10
	私募资产管理计划	2	48,946,515.85	2021-11-18
	其他组合	-	-	-
	合计	10	309,488,790,392.60	

#### 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 119 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沪深 300 指数，沪深 300 指数由沪深 A 股中规模大、流动性好、最具代表性的 300 只股票组成，自 2005 年 4 月 8 日起正式发布，以综合反映沪深 A 股市场整体表现。沪深 300 指数是内地首只股指期货的标的指数。本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好地跟踪标的指数，实现基金投资目标。

2024 年上半年，外部环境变得更为复杂严峻，全球经济增长动力不足，虽然通胀有所回落但仍然存在一定的粘性，同时各主要经济体的经济增长和货币政策也呈现一定的分化。国内方面，我国经济运行总体平稳，延续回升向好态势，具体体现在生产稳定增长，需求持续恢复，就业物价总体稳定，居民收入继续增加等方面，但同时可以看到，在外部环境错综复杂的情况下，国内有效需求依然不足，社会预期依旧偏弱，经济回升向好的基础仍需巩固，而宏观政策效应持续释放、外需有

所回暖、新质生产力加速发展等因素也形成了新的支撑。

市场方面，上半年 A 股主要指数表现分化，沪深 300 等大盘指数表现占优，表现较好的行业有银行、煤炭、公用事业、家用电器、石油石化，基本上都是红利策略覆盖的行业。市场风格方面，大盘价值风格相对占优，小盘成长风格相对偏弱。

基金投资运作方面，报告期内，本基金在做好跟踪标的指数的基础上，认真应对投资者日常申购、赎回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、东海证券股份有限公司、方正证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、申万宏源证券有限公司、招商证券股份有限公司、浙商证券股份有限公司、中国国际金融股份有限公司、中泰证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、长江证券股份有限公司、国金证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、华安证券股份有限公司、西部证券股份有限公司、中国银河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 2024 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 3.5655 元，本报告期份额净值增长率为 1.65%，同期业绩比较基准增长率 0.89%。本基金本报告期跟踪偏离度为+0.76%，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

2024 年下半年，随着越来越多经济体进入降息通道，全球经济正式从对抗通胀模式切换至通胀与增长相对平衡的新均衡状态。国内方面，外部环境不稳定性、不确定性料将进一步上升，国内面临的困难挑战依然不少，但下半年经济仍将延续回升向好态势，综合考虑积极政策、基数效应、客观利好等因素，预期下半年可以实现好于上半年的经济增长表现。

市场方面，下半年中国股票市场存在持续修复的机会，经过总体修复和再次调整后，中国股票市场的估值与全球其他主要市场相比依然处于较低位置，下半年三中全会等会议的召开将会推出更多深化改革、刺激经济的政策，市场的风险偏好也将逐步提升，积极因素逐渐涌现，低估值或将逐步转化为反弹，市场可能呈现震荡向上的整体趋势。

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

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

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

## §5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本基金的管理人——华夏基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对华夏基金管理有限公司编制和披露的本基金 2024 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## §6 中期报告财务会计报告（未经审计）

## 6.1 资产负债表

会计主体：华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	437,311,931.24	53,430,556.36
结算备付金		28,746,124.99	41,417,891.22
存出保证金		54,257,558.69	11,612,294.10
交易性金融资产	6.4.7.2	98,797,872,774.65	37,569,849,864.15
其中：股票投资		98,797,872,774.65	37,569,849,864.15
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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	-	-8,203.65
应收清算款		135,540,721.84	452,694,570.75
应收股利		139,695.08	79,882.60
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	40,991.62	437,990.90
资产总计		99,453,909,798.11	38,129,514,846.43
<b>负债和净资产</b>			
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		122,123,732.88	349,499,948.12
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		39,784,479.35	14,312,054.92
应付托管费		7,956,895.89	2,862,410.97
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		11,319.52	47,820.37
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-

其他负债	6.4.7.6	62,938,486.21	80,327,200.87
负债合计		232,814,913.85	447,049,435.25
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	67,985,564,509.30	26,244,737,541.30
未分配利润	6.4.7.8	31,235,530,374.96	11,437,727,869.88
净资产合计		99,221,094,884.26	37,682,465,411.18
负债和净资产总计		99,453,909,798.11	38,129,514,846.43

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，基金份额净值 3.5655 元，基金份额总额 27,828,249,828.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		4,169,911,858.68	232,507,611.92
1.利息收入		6,022,532.59	12,666,778.56
其中：存款利息收入	6.4.7.9	1,168,019.50	1,145,342.22
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		8,203.65	-
其他利息收入		4,846,309.44	11,521,436.34
2.投资收益（损失以“-”填列）		290,004,968.78	-220,479,141.42
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-843,623,958.38	-506,656,833.05
基金投资收益	6.4.7.11	-	-
债券投资收益	6.4.7.12	-	763,536.41
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	19,531,029.88	-5,086,489.00
股利收益	6.4.7.16	1,114,097,897.28	290,500,644.22
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	3,853,653,657.57	439,129,592.48
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	20,230,699.74	1,190,382.30
<b>减：二、营业总支出</b>		272,189,396.18	78,728,104.56
1.管理人报酬		215,850,655.39	62,352,789.76
2.托管费		43,170,131.11	12,470,557.97
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		95,576.34	42,821.28
8.其他费用	6.4.7.21	13,073,033.34	3,861,935.55
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>3,897,722,462.50</b>	<b>153,779,507.36</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>3,897,722,462.50</b>	<b>153,779,507.36</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		<b>-</b>	<b>-</b>
<b>六、综合收益总额</b>		<b>3,897,722,462.50</b>	<b>153,779,507.36</b>

注：根据《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>》修订版调整，可比期 2023 年中期报告利润表中“证券出借利息收入”项目金额列示在“其他利息收入”。

### 6.3 净资产变动表

会计主体：华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 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	26,244,737,541.30	11,437,727,869.88	37,682,465,411.18
二、本期期初净资产	26,244,737,541.30	11,437,727,869.88	37,682,465,411.18
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	41,740,826,968.00	19,797,802,505.08	61,538,629,473.08
（一）、综合收益总额	-	3,897,722,462.50	3,897,722,462.50
（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）	41,740,826,968.00	15,900,080,042.58	57,640,907,010.58
其中：1.基金申购款	49,449,599,585.93	19,498,036,033.52	68,947,635,619.45
2.基金赎回款	-7,708,772,617.93	-3,597,955,990.94	-11,306,728,608.87
（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	67,985,564,509.30	31,235,530,374.96	99,221,094,884.26
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 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	15,457,732,843.21	9,450,797,099.63	24,908,529,942.84
二、本期期初净资产	15,457,732,843.21	9,450,797,099.63	24,908,529,942.84
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-426,555,015.67	-583,895,637.05	-1,010,450,652.72
（一）、综合收益总额	-	153,779,507.36	153,779,507.36
（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）	-426,555,015.67	-305,928,905.33	-732,483,921.00
其中：1.基金申购款	3,062,840,917.60	1,989,105,067.22	5,051,945,984.82
2.基金赎回款	-3,489,395,933.27	-2,295,033,972.55	-5,784,429,905.82
（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）	-	-431,746,239.08	-431,746,239.08
四、本期期末净资产	15,031,177,827.54	8,866,901,462.58	23,898,079,290.12

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

华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2012]1653 号《关于核准华夏沪深 300 交易型开放式指数证

券投资基金募集的批复》的核准，由华夏基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金运作管理办法》、《华夏沪深 300 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 2012 年 12 月 17 日至 2012 年 12 月 19 日期间共募集 602,764,295.00 元（不含认购资金利息），业经德勤华永会计师事务所有限公司德师报（验）字（12）第 0075 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2012 年 12 月 25 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 602,808,845 份基金份额，其中认购资金利息折合 44,550 份基金份额。本基金的基金管理人为华夏基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华夏沪深 300 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。为更好地实现投资目标，基金还可投资于非成份股、债券、股指期货、权证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。

根据《华夏沪深 300 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 2013 年 1 月 9 日为基金份额折算日。折算后的基金份额净值与 2013 年 1 月 9 日沪深 300 指数收盘值的千分之一基本一致。折算前基金份额总额为 16,020,609,566 份，本次基金份额折算比例为 0.40932601，折算后基金份额总额为 6,557,649,828 份。

#### 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 2024 年 6 月 30 日
活期存款	437,311,931.24
等于：本金	437,271,592.48
加：应计利息	40,338.76
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	437,311,931.24

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	100,126,444,587.66	-	98,797,872,774.65	-1,328,571,813.01
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	100,126,444,587.66	-	98,797,872,774.65	-1,328,571,813.01

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。

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 2024 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	416,634,840.00	-	-	-
其中：股指期货	416,634,840.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	416,634,840.00	-	-	-

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
IF2409	沪深 300 期货 IF2409 合约	370	380,019,600.00	-10,839,180.00

IF2407	沪深 300 期货 IF2407 合约	25	25,777,500.00	1,440.00
合计	-	-	-	-10,837,740.00
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	-10,837,740.00
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

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
应收利息	-
其他应收款	40,991.62
待摊费用	-
合计	40,991.62

#### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 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	1,144,612.80
其中：交易所市场	1,144,612.80
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	119,344.68

应付指数使用费	12,951,039.33
应退替代款	48,504,655.41
可退替代款	218,833.99
合计	62,938,486.21

#### 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	10,742,649,828.00	26,244,737,541.30
本期申购	20,241,000,000.00	49,449,599,585.93
本期赎回（以“-”号填列）	-3,155,400,000.00	-7,708,772,617.93
本期末	27,828,249,828.00	67,985,564,509.30

#### 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	38,394,374,855.39	-26,956,646,985.51	11,437,727,869.88
本期期初	38,394,374,855.39	-26,956,646,985.51	11,437,727,869.88
本期利润	44,068,804.93	3,853,653,657.57	3,897,722,462.50
本期基金份额交易产生的变动数	60,430,496,680.86	-44,530,416,638.28	15,900,080,042.58
其中：基金申购款	71,569,264,454.53	-52,071,228,421.01	19,498,036,033.52
基金赎回款	-11,138,767,773.67	7,540,811,782.73	-3,597,955,990.94
本期已分配利润	-	-	-
本期末	98,868,940,341.18	-67,633,409,966.22	31,235,530,374.96

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
	活期存款利息收入
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	683,999.40
其他	36,489.65
合计	1,168,019.50

#### 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-886,666,103.39
股票投资收益——赎回差价收入	43,042,145.01
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	-843,623,958.38

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	10,984,174,084.83
减：卖出股票成本总额	11,858,397,211.93
减：交易费用	12,442,976.29
买卖股票差价收入	-886,666,103.39

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	11,306,728,608.87
减：现金支付赎回款总额	4,100,226,431.30
减：赎回股票成本总额	7,163,460,032.56
减：交易费用	-
赎回差价收入	43,042,145.01

6.4.7.10.4 股票投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.10.5 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.11 基金投资收益

无。

6.4.7.12 债券投资收益

无。

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 2024年1月1日至2024年6月30日
股指期货投资收益	19,531,029.88

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,114,097,897.28
其中：证券出借权益补偿收入	1,584,776.66
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,114,097,897.28

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
1.交易性金融资产	3,864,556,978.97
——股票投资	3,864,556,978.97
——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	-10,903,321.40
——权证投资	-
——期货投资	-10,903,321.40
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	3,853,653,657.57

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
----	----------------------------

基金赎回费收入	-
替代损益	20,230,699.74
合计	20,230,699.74

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 2024年1月1日至2024年6月30日
审计费用	59,672.34
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行费用	2,649.33
指数使用费	12,951,039.33
合计	13,073,033.34

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
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	基金托管人
华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（“华夏沪深 300ETF 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
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 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023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	18,707,930,369.22	43.07%	2,709,957,497.61	36.71%

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30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	-	-	5,841,800.16	100.00%

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 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	1,794,180.30	43.07%	823,745.35	71.97%
关联方名称	上年度可比期间 2023年1月1日至2023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	220,498.29	36.72%	91,086.26	4.23%

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。

#### 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 2024年1月1日至2024年6月 30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30 日
当期发生的基金应支付的管理费	215,850,655.39	62,352,789.76
其中：应支付销售机构的客户维护费	396,877.09	187,213.36
应支付基金管理人的净管理费	215,453,778.30	62,165,576.40

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 0.50%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×0.50%/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 2024年1月1日至2024年6月 30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30 日
当期发生的基金应支付的托管费	43,170,131.11	12,470,557.97

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 0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

②基金托管费计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.10%/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

单位：人民币元

本期 2024年1月1日至2024年6月30日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末证券出借业务余额
中信证券	-	-	-	-
上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末证券出借业务余额
中信证券	1,610,936,951.00	1,115,930.56	-	-

注：2023 年股票注册制全面改革，自注册制实施之日起，本基金没有与关联方通过约定方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务。

#### 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 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	1,722,879,217.23	0.24~6.43	1.57	1,003,447.72	21,532,805.24	9,325.99
上年度可比期间 2023年1月1日至2023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	1,566,258,324.00	1.10~6.00	2.99	1,805,615.13	254,664,388.00	180,819.20

注：上年度可比期间数据，按照最新 XBRL 模板要求调整披露信息。

#### 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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 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	-	-	2,731,300.00	0.03%
华夏沪深 300ETF 联接	2,792,667,096.00	10.04%	2,740,091,291.00	25.51%
中信证券	21,206,695.00	0.08%	153,601,474.00	1.43%

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 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行活期存款	437,311,931.24	447,530.45	94,511,003.05	83,232.56

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率或约定利率计息。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 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	601033	永兴股份	新股发行	12,577	203,747.40
中信证券	688584	上海合晶	新股发行	8,659	196,212.94
中信证券	001359	平安电工	新股发行	1,833	31,875.87
上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
中信证券	688343	云天励飞	新股发行	24,961	1,096,287.12
中信证券	688146	中船特气	新股发行	10,101	365,151.15
中信证券	001286	陕西能源	新股发行	37,667	361,603.20
中信证券	688581	安杰思	新股发行	1,629	204,928.20
中信证券	688539	高华科技	新股发行	5,334	203,865.48

中信证券	688522	纳睿雷达	新股发行	4,299	200,677.32
中信证券	301439	泓淋电力	新股发行	9,486	189,625.14
中信证券	688523	航天环宇	新股发行	4,717	103,113.62
中信证券	301293	三博脑科	新股发行	3,324	98,390.40
中信证券	301323	新莱福	新股发行	2,277	88,939.62
中信证券	688631	莱斯信息	新股发行	3,357	84,864.96
中信证券	301170	锡南科技	新股发行	2,496	84,864.00
中信证券	301157	华塑科技	新股发行	1,498	84,637.00
中信证券	601133	柏诚股份	新股发行	6,632	77,329.12
中信证券	301261	恒工精密	新股发行	1,973	72,803.70
中信证券	603281	江瀚新材	新股发行	863	30,714.17
中信证券	001367	海森药业	新股发行	549	24,419.52
中信证券	001324	长青科技	新股发行	1,131	21,353.28
中信证券	603162	海通发展	新股发行	523	19,481.75

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

于 2024 年 6 月 30 日，本基金（因指数成份股包括中信证券而被动）持有的中信证券股票估值总额为人民币 990,111,314.85 元，占基金资产净值的比例为 1.00%（2023 年 12 月 31 日，本基金（因指数成份股包括中信证券而被动）持有的中信证券股票估值总额为人民币 430,313,805.60 元，占基金资产净值的比例为 1.14%）。

于 2024 年 6 月 30 日，本基金（因指数成份股包括中国工商银行而被动）持有的中国工商银行股票估值总额为人民币 1,111,628,472.30 元，占基金资产净值的比例为 1.12%（2023 年 12 月 31 日，本基金（因指数成份股包括中国工商银行而被动）持有的中国工商银行股票估值总额为人民币 362,692,246.42 元，占基金资产净值的比例为 0.96%）。

本基金本报告期通过中信期货买卖期货成交额为 1,423,735,620.00 元（上年度可比期间：685,736,544.00 元），支付给中信期货的佣金为 46,983.4 元（上年度可比期间：25,934.53 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（2024 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	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

				限类型						
688717	艾罗能源	2023-12-26	6 个月	新发流通受限	55.66	47.02	11,303	629,124.98	531,467.06	-
301589	诺瓦星云	2024-02-01	6 个月	新发流通受限	126.89	188.01	1,244	87,680.99	233,884.44	含 证 券 送 配
688692	达梦数据	2024-06-04	6 个月	新发流通受限	86.96	174.93	175	15,218.00	30,612.75	-
603285	键邦股份	2024-06-28	1 个月内(含)	新发流通受限	18.65	18.65	1,158	21,596.70	21,596.70	-
601033	永兴股份	2024-01-11	6 个月	新发流通受限	16.20	15.96	1,258	20,379.60	20,077.68	-
603350	安乃达	2024-06-26	1 个月内(含)	新发流通受限	20.56	20.56	945	19,429.20	19,429.20	-
301536	星宸科技	2024-03-20	6 个月	新发流通受限	16.16	32.27	481	7,772.96	15,521.87	-

				限						
688584	上海合晶	2024-02-01	6 个月	新发流通受限	22.66	15.89	866	19,623.56	13,760.74	-
301538	骏鼎达	2024-03-13	6 个月	新发流通受限	55.82	91.24	150	5,972.74	13,686.00	含 证 券 送 配
301565	中仑新材	2024-06-13	6 个月	新发流通受限	11.88	18.98	711	8,446.68	13,494.78	-
603341	龙旗科技	2024-02-23	6 个月	新发流通受限	26.00	37.49	298	7,748.00	11,172.02	-
688691	灿芯股份	2024-04-02	6 个月	新发流通受限	19.86	42.51	247	4,905.42	10,499.97	-
301566	达利凯普	2023-12-22	6 个月	新发流通受限	8.90	16.97	576	5,126.40	9,774.72	-
301392	汇成真空	2024-05-28	6 个月	新发流通受限	12.20	41.66	219	2,671.80	9,123.54	-
301591	肯特	2024-02-20	6 个月	新	19.43	36.98	219	4,255.17	8,098.62	-

	股份			发 流 通 受 限						
301587	中瑞 股份	2024-03-27	6 个月	新 发 流 通 受 限	21.73	25.26	306	6,649.38	7,729.56	-
001389	广合 科技	2024-03-26	6 个月	新 发 流 通 受 限	17.43	34.56	222	3,869.46	7,672.32	-
301539	宏鑫 科技	2024-04-03	6 个月	新 发 流 通 受 限	10.64	19.82	361	3,841.04	7,155.02	-
688695	中创 股份	2024-03-06	6 个月	新 发 流 通 受 限	22.43	31.55	186	4,171.98	5,868.30	-
688530	欧莱 新材	2024-04-29	6 个月	新 发 流 通 受 限	9.60	16.10	344	3,302.40	5,538.40	-
301588	美新 科技	2024-03-06	6 个月	新 发 流 通 受 限	14.50	21.25	257	3,726.50	5,461.25	-
301502	华阳 智能	2024-01-26	6 个月	新 发 流 通 受 限	28.01	37.83	138	3,865.38	5,220.54	-

				通受限						
603325	博隆技术	2024-01-03	6 个月	新发流通受限	72.46	68.06	66	4,782.36	4,491.96	-
603381	永臻股份	2024-06-19	6 个月	新发流通受限	23.35	25.13	178	4,156.30	4,473.14	-
001359	平安电工	2024-03-19	6 个月	新发流通受限	17.39	20.60	184	3,199.76	3,790.40	-
603312	西典新能	2024-01-04	6 个月	新发流通受限	29.02	25.36	130	3,772.60	3,296.80	-
603082	北自科技	2024-01-23	6 个月	新发流通受限	21.28	29.49	107	2,276.96	3,155.43	-
001379	腾达科技	2024-01-11	6 个月	新发流通受限	16.98	13.48	213	3,616.74	2,871.24	-
603375	盛景微	2024-01-17	6 个月	新发流通受限	38.18	38.90	72	2,748.96	2,800.80	-

				限						
603285	键邦股份	2024-06-28	6 个月	新发流通受限	18.65	18.65	129	2,405.85	2,405.85	-
603350	安乃达	2024-06-26	6 个月	新发流通受限	20.56	20.56	106	2,179.36	2,179.36	-

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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	出借到期日	期末估值单价	数量（股）	期末估值总额
1	300142	沃森生物	2024 年 7 月 2 日	11.38	826,500.00	9,405,570.00

			-2024 年 7 月 2 日			
2	600900	长江电力	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 2 日	28.92	320,000.00	9,254,400.00
3	000977	浪潮信息	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	36.37	215,500.00	7,837,735.00
4	600048	保利发展	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 2 日	8.76	544,200.00	4,767,192.00
5	000983	山西焦煤	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	10.31	459,000.00	4,732,290.00
6	601799	星宇股份	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 2 日	112.04	42,000.00	4,705,680.00
7	601360	三六零	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	7.68	480,800.00	3,692,544.00
8	300979	华利集团	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	60.85	59,400.00	3,614,490.00
9	601698	中国卫通	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	14.09	253,000.00	3,564,770.00
10	300308	中际旭创	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 2 日	137.88	23,380.00	3,223,634.40
11	600031	三一重工	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 2 日	16.50	192,700.00	3,179,550.00
12	002460	赣锋锂业	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	28.65	97,100.00	2,781,915.00
13	603833	欧派家居	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	53.56	47,900.00	2,565,524.00
14	601865	福莱特	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 2 日	20.10	125,900.00	2,530,590.00
15	000617	中油资本	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	5.52	440,000.00	2,428,800.00
16	600760	中航沈飞	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 2 日	40.10	50,300.00	2,017,030.00
17	300896	爱美客	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	172.10	11,700.00	2,013,570.00
18	300957	贝泰妮	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	48.32	41,200.00	1,990,784.00
19	002603	以岭药业	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 2 日	15.33	123,200.00	1,888,656.00
20	600732	爱旭股份	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	9.05	194,100.00	1,756,605.00
21	002304	洋河股份	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	80.74	20,000.00	1,614,800.00
22	601059	信达证券	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	14.21	102,400.00	1,455,104.00
23	603019	中科曙光	2024 年 7 月 2 日	41.50	28,200.00	1,170,300.00

			-2024 年 7 月 2 日			
24	001979	招商蛇口	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 2 日	8.79	105,000.00	922,950.00
25	000733	振华科技	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 2 日	41.53	21,200.00	880,436.00
26	688363	华熙生物	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 2 日	56.57	14,900.00	842,893.00
27	600132	重庆啤酒	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 2 日	60.70	13,300.00	807,310.00
28	601236	红塔证券	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	6.42	122,700.00	787,734.00
29	002459	晶澳科技	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	11.20	69,800.00	781,760.00
30	603260	合盛硅业	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 2 日	46.71	14,400.00	672,624.00
31	601816	京沪高铁	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 2 日	5.37	119,300.00	640,641.00
32	600061	国投资本	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 2 日	5.65	110,000.00	621,500.00
33	600918	中泰证券	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 2 日	5.67	106,000.00	601,020.00
34	603799	华友钴业	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 2 日	22.13	23,700.00	524,481.00
35	601006	大秦铁路	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	7.16	70,300.00	503,348.00
36	600460	士兰微	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 2 日	17.51	27,300.00	478,023.00
37	000800	一汽解放	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	7.83	56,500.00	442,395.00
38	002129	TCL 中环	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	8.65	30,900.00	267,285.00
39	601100	恒立液压	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	46.58	4,700.00	218,926.00
40	605117	德业股份	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 2 日	74.34	2,900.00	215,586.00
41	601800	中国交建	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	8.94	18,300.00	163,602.00
42	600188	兖矿能源	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	22.73	6,100.00	138,653.00
43	601872	招商轮船	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	8.45	15,100.00	127,595.00
44	300751	迈为股份	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	119.48	1,000.00	119,480.00
45	000786	北新建材	2024 年 7 月 9 日	29.66	3,500.00	103,810.00

			-2024 年 7 月 9 日			
46	601995	中金公司	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	29.61	3,000.00	88,830.00
47	603806	福斯特	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	14.70	5,680.00	83,496.00
48	601186	中国铁建	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	8.57	8,900.00	76,273.00
49	002271	东方雨虹	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	12.34	5,000.00	61,700.00
50	600741	华域汽车	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	16.38	3,200.00	52,416.00
51	601066	中信建投	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 2 日	19.24	1,800.00	34,632.00
52	002812	恩捷股份	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	31.65	1,000.00	31,650.00
53	002555	三七互娱	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	13.05	2,300.00	30,015.00
54	002466	天齐锂业	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	29.91	1,000.00	29,910.00
55	600745	闻泰科技	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	28.25	1,000.00	28,250.00
56	001289	龙源电力	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 2 日	17.25	1,600.00	27,600.00
57	601633	长城汽车	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	25.30	1,000.00	25,300.00
58	600588	用友网络	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	10.00	2,100.00	21,000.00
59	600837	海通证券	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	8.56	2,100.00	17,976.00
60	601319	中国人保	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	5.15	3,400.00	17,510.00
61	601377	兴业证券	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	5.06	2,900.00	14,674.00
62	601012	隆基绿能	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	14.02	1,000.00	14,020.00
63	300919	中伟股份	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	30.99	400.00	12,396.00
64	002410	广联达	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	9.58	1,000.00	9,580.00
65	600023	浙能电力	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	7.11	1,000.00	7,110.00
66	601618	中国中冶	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	3.10	1,600.00	4,960.00
67	601868	中国能建	2024 年 7 月 9 日	2.12	1,000.00	2,120.00

			-2024 年 7 月 9 日			
68	600803	新奥股份	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 2 日	20.80	100.00	2,080.00
69	601699	潞安环能	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 2 日	18.13	100.00	1,813.00
合计	-	-	-	-	5,707,560.00	93,748,896.40

注：出借证券中如有其他流通受限的情况详见本报告“本基金持有的流通受限证券”部分内容。

#### 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内。

##### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指由于基金所投资债券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息，债券发行人信用评级降低导致债券价格下降，或基金在交易过程中发生交收违约，而造成基金资产损失的可能性。

本基金管理人通过信用分析团队建立了内部评级体系和交易对手库，对发行人及债券投资进行内部评级，对交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度，以控制可能出现的信用风险。

##### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是在市场或持有资产流动性不足的情况下，基金管理人可能无法迅速、低成本地调整基金投资组合，从而对基金收益造成不利影响。

除在“6.4.12 期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限制的情况外，本基金所投资的证券均能及时变现。

##### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

在日常运作中，本基金的流动性安排能够与基金合同约定的申购赎回安排以及投资者的申购赎回规律相匹配。

在资产端，本基金主要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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 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	98,797,872,774.65	99.57	37,569,849,864.15	99.70
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	98,797,872,774.65	99.57	37,569,849,864.15	99.70

注：①本表中交易性金融资产-债券投资科目仅包含可转换公司债券和可交换公司债券等。

②由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
	-5%	-4,805,461,832.30	-1,850,665,580.40
	+5%	4,805,461,832.30	1,850,665,580.40

#### 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 2024 年 6 月 30 日
第一层次	98,796,846,238.91
第二层次	45,611.11
第三层次	980,924.63
合计	98,797,872,774.65

###### 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）和非公开发售等情况，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 2024 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	98,797,872,774.65	99.34
	其中：股票	98,797,872,774.65	99.34
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	466,058,056.23	0.47
8	其他各项资产	189,978,967.23	0.19
9	合计	99,453,909,798.11	100.00

注：①股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值。

②报告期末,本基金参与转融通证券出借业务借出股票的公允价值为 93,748,896.40 元,占本基金期末资产净值的 0.09%。

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	1,249,960,045.64	1.26
B	采矿业	6,019,303,826.59	6.07
C	制造业	51,451,275,364.33	51.86
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,637,476,680.78	4.67
E	建筑业	2,211,035,195.67	2.23
F	批发和零售业	254,358,904.47	0.26
G	交通运输、仓储和邮政业	3,703,413,322.24	3.73
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,460,802,280.36	4.50
J	金融业	22,055,335,569.13	22.23
K	房地产业	909,609,549.89	0.92
L	租赁和商务服务业	793,825,353.13	0.80
M	科学研究和技术服务业	783,656,551.19	0.79
N	水利、环境和公共设施管理业	20,077.68	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	267,792,720.24	0.27
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	98,797,865,441.34	99.57

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	600519	贵州茅台	3,491,869	5,123,933,651.91	5.16
2	300750	宁德时代	14,689,941	2,644,630,078.23	2.67
3	601318	中国平安	59,892,553	2,477,155,992.08	2.50
4	600036	招商银行	68,875,867	2,354,865,892.73	2.37
5	600900	长江电力	68,066,022	1,968,469,356.24	1.98
6	000333	美的集团	27,170,123	1,752,472,933.50	1.77
7	601899	紫金矿业	91,647,542	1,610,247,312.94	1.62
8	601166	兴业银行	80,913,970	1,425,704,151.40	1.44
9	000858	五粮液	10,808,321	1,383,897,420.84	1.39
10	002594	比亚迪	5,046,145	1,262,797,786.25	1.27
11	601328	交通银行	152,871,022	1,141,946,534.34	1.15

12	601398	工商银行	195,022,539	1,111,628,472.30	1.12
13	002475	立讯精密	27,949,744	1,098,704,436.64	1.11
14	600030	中信证券	54,312,195	990,111,314.85	1.00
15	000651	格力电器	25,057,981	982,774,014.82	0.99
16	300760	迈瑞医疗	3,370,945	980,641,609.95	0.99
17	600276	恒瑞医药	24,842,652	955,448,395.92	0.96
18	600887	伊利股份	35,429,796	915,505,928.64	0.92
19	600309	万华化学	10,473,126	846,856,968.36	0.85
20	000725	京东方 A	205,626,500	841,012,385.00	0.85
21	601088	中国神华	18,351,368	814,250,198.16	0.82
22	601288	农业银行	177,638,375	774,503,315.00	0.78
23	300059	东方财富	70,265,867	742,007,555.52	0.75
24	601816	京沪高铁	136,628,529	733,695,200.73	0.74
25	300308	中际旭创	4,998,030	689,128,376.40	0.69
26	002714	牧原股份	15,203,845	662,887,642.00	0.67
27	601857	中国石油	63,073,802	650,921,636.64	0.66
28	002415	海康威视	20,770,643	642,020,575.13	0.65
29	601668	中国建筑	115,809,942	614,950,792.02	0.62
30	600919	江苏银行	81,589,473	606,209,784.39	0.61
31	601138	工业富联	22,100,221	605,546,055.40	0.61
32	600690	海尔智家	21,063,023	597,768,592.74	0.60
33	300498	温氏股份	29,620,202	587,072,403.64	0.59
34	000568	泸州老窖	4,088,189	586,614,239.61	0.59
35	600809	山西汾酒	2,717,478	573,061,760.64	0.58
36	002371	北方华创	1,778,914	569,056,799.46	0.57
37	601985	中国核电	52,530,207	559,972,006.62	0.56
38	600406	国电南瑞	22,341,300	557,638,848.00	0.56
39	601225	陕西煤业	21,576,229	556,019,421.33	0.56
40	603259	药明康德	14,056,565	550,876,782.35	0.56
41	601919	中远海控	35,508,784	550,031,064.16	0.55
42	000001	平安银行	53,994,877	548,048,001.55	0.55
43	600031	三一重工	33,054,568	545,400,372.00	0.55
44	601988	中国银行	117,274,852	541,809,816.24	0.55
45	600941	中国移动	5,030,332	540,760,690.00	0.55
46	600000	浦发银行	65,329,201	537,659,324.23	0.54
47	300124	汇川技术	10,420,744	534,584,167.20	0.54
48	601728	中国电信	86,382,221	531,250,659.15	0.54
49	601601	中国太保	19,038,524	530,413,278.64	0.53
50	000792	盐湖股份	30,231,182	527,534,125.90	0.53
51	600028	中国石化	81,257,566	513,547,817.12	0.52
52	601766	中国中车	67,678,001	508,261,787.51	0.51
53	600150	中国船舶	12,441,085	506,476,570.35	0.51
54	688981	中芯国际	10,981,421	506,243,508.10	0.51

55	300274	阳光电源	8,082,112	501,333,407.36	0.51
56	600050	中国联通	106,169,900	498,998,530.00	0.50
57	000063	中兴通讯	17,738,382	496,142,544.54	0.50
58	000338	潍柴动力	30,197,633	490,409,559.92	0.49
59	002352	顺丰控股	13,609,411	485,719,878.59	0.49
60	601169	北京银行	82,349,997	480,923,982.48	0.48
61	601012	隆基绿能	33,731,109	472,910,148.18	0.48
62	603501	韦尔股份	4,744,400	471,451,028.00	0.48
63	600837	海通证券	53,727,770	459,909,711.20	0.46
64	000100	TCL 科技	104,504,873	451,461,051.36	0.46
65	600016	民生银行	118,393,853	448,712,702.87	0.45
66	002230	科大讯飞	10,282,641	441,639,430.95	0.45
67	600660	福耀玻璃	8,917,316	427,139,436.40	0.43
68	002142	宁波银行	18,370,631	405,256,119.86	0.41
69	601229	上海银行	55,340,500	401,772,030.00	0.40
70	600089	特变电工	28,110,087	389,886,906.69	0.39
71	600938	中国海油	11,647,900	384,380,700.00	0.39
72	601390	中国中铁	57,158,209	372,671,522.68	0.38
73	000625	长安汽车	27,627,102	371,031,979.86	0.37
74	688041	海光信息	5,179,162	364,198,671.84	0.37
75	600104	上汽集团	25,764,336	357,093,696.96	0.36
76	603986	兆易创新	3,706,342	354,400,422.04	0.36
77	601688	华泰证券	28,432,166	352,274,536.74	0.36
78	600048	保利发展	39,961,122	350,059,428.72	0.35
79	601006	大秦铁路	48,870,111	349,909,994.76	0.35
80	600436	片仔癀	1,687,547	349,609,111.99	0.35
81	600905	三峡能源	79,624,463	347,162,658.68	0.35
82	002027	分众传媒	56,252,810	340,892,028.60	0.34
83	601211	国泰君安	25,072,862	339,737,280.10	0.34
84	601888	中国中免	5,436,397	339,720,448.53	0.34
85	688012	中微公司	2,399,056	338,890,650.56	0.34
86	603019	中科曙光	8,149,694	338,212,301.00	0.34
87	601600	中国铝业	44,112,046	336,574,910.98	0.34
88	603993	洛阳钼业	39,319,018	334,211,653.00	0.34
89	601818	光大银行	103,288,682	327,425,121.94	0.33
90	600019	宝钢股份	49,228,497	327,369,505.05	0.33
91	603288	海天味业	9,281,155	319,921,412.85	0.32
92	600585	海螺水泥	13,344,187	314,789,371.33	0.32
93	601658	邮储银行	61,771,879	313,183,426.53	0.32
94	601989	中国重工	63,441,164	312,764,938.52	0.32
95	600886	国投电力	16,581,400	302,444,736.00	0.30
96	601009	南京银行	28,768,208	298,901,681.12	0.30
97	600795	国电电力	49,614,585	297,191,364.15	0.30

98	688008	澜起科技	5,087,069	290,776,864.04	0.29
99	688111	金山办公	1,276,926	290,500,665.00	0.29
100	601628	中国人寿	9,268,465	287,785,838.25	0.29
101	600999	招商证券	20,652,600	287,277,666.00	0.29
102	600438	通威股份	15,031,284	287,247,837.24	0.29
103	000938	紫光股份	12,727,654	284,463,066.90	0.29
104	000425	徐工机械	39,449,550	282,064,282.50	0.28
105	601939	建设银行	37,360,088	276,464,651.20	0.28
106	600547	山东黄金	10,049,041	275,142,742.58	0.28
107	300014	亿纬锂能	6,824,838	272,447,532.96	0.27
108	600893	航发动力	7,406,539	270,709,000.45	0.27
109	002304	洋河股份	3,350,752	270,539,716.48	0.27
110	002179	中航光电	7,069,970	269,012,358.50	0.27
111	601669	中国电建	47,920,780	267,877,160.20	0.27
112	300015	爱尔眼科	25,948,907	267,792,720.24	0.27
113	000002	万科 A	37,875,990	262,480,610.70	0.26
114	002241	歌尔股份	13,302,087	259,523,717.37	0.26
115	600926	杭州银行	19,797,774	258,360,950.70	0.26
116	000538	云南白药	4,971,463	254,290,332.45	0.26
117	600584	长电科技	7,972,611	252,811,494.81	0.25
118	600760	中航沈飞	6,132,460	245,911,646.00	0.25
119	600111	北方稀土	14,086,751	242,292,117.20	0.24
120	600489	中金黄金	16,176,460	239,411,608.00	0.24
121	002050	三花智控	12,459,624	237,729,625.92	0.24
122	600011	华能国际	24,476,669	235,465,555.78	0.24
123	601916	浙商银行	83,923,600	231,629,136.00	0.23
124	002252	上海莱士	29,587,302	231,372,701.64	0.23
125	688256	寒武纪	1,151,285	228,725,790.95	0.23
126	600015	华夏银行	35,429,062	226,745,996.80	0.23
127	600009	上海机场	6,917,250	223,081,312.50	0.22
128	600958	东方证券	29,092,751	221,104,907.60	0.22
129	600426	华鲁恒升	8,275,188	220,451,008.32	0.22
130	601186	中国铁建	25,594,377	219,343,810.89	0.22
131	002311	海大集团	4,638,268	218,230,509.40	0.22
132	300408	三环集团	7,455,492	217,625,811.48	0.22
133	000166	申万宏源	50,159,143	216,185,906.33	0.22
134	601901	方正证券	27,482,600	212,440,498.00	0.21
135	000157	中联重科	27,637,108	212,252,989.44	0.21
136	600989	宝丰能源	12,240,573	212,129,130.09	0.21
137	000977	浪潮信息	5,736,245	208,627,230.65	0.21
138	600674	川投能源	10,858,285	203,592,843.75	0.21
139	003816	中国广核	43,766,000	202,636,580.00	0.20
140	300433	蓝思科技	11,095,651	202,495,630.75	0.20

141	000776	广发证券	16,459,814	200,315,936.38	0.20
142	688271	联影医疗	1,822,090	199,883,273.00	0.20
143	002049	紫光国微	3,777,042	198,672,409.20	0.20
144	002001	新和成	10,311,281	197,976,595.20	0.20
145	601377	兴业证券	38,429,303	194,452,273.18	0.20
146	601111	中国国航	25,903,232	191,165,852.16	0.19
147	688036	传音控股	2,496,472	191,079,966.88	0.19
148	600115	中国东航	47,601,528	190,882,127.28	0.19
149	000596	古井贡酒	903,364	190,673,039.48	0.19
150	300122	智飞生物	6,655,976	186,567,007.28	0.19
151	000768	中航西飞	7,737,707	185,937,099.21	0.19
152	002460	赣锋锂业	6,283,567	180,024,194.55	0.18
153	001979	招商蛇口	20,174,259	177,331,736.61	0.18
154	601800	中国交建	19,807,064	177,075,152.16	0.18
155	600010	包钢股份	126,303,425	176,824,795.00	0.18
156	600029	南方航空	29,997,444	176,684,945.16	0.18
157	601633	长城汽车	6,919,851	175,072,230.30	0.18
158	600188	兖矿能源	7,658,814	174,084,842.22	0.18
159	002601	龙佰集团	9,291,599	172,544,993.43	0.17
160	002466	天齐锂业	5,755,473	172,146,197.43	0.17
161	002236	大华股份	11,006,581	170,161,742.26	0.17
162	002648	卫星化学	9,370,394	168,479,684.12	0.17
163	601117	中国化学	20,402,718	168,118,396.32	0.17
164	000786	北新建材	5,643,460	167,385,023.60	0.17
165	603799	华友钴业	7,554,372	167,178,252.36	0.17
166	000661	长春高新	1,808,551	165,970,725.27	0.17
167	600346	恒力石化	11,753,026	163,954,712.70	0.17
168	002493	荣盛石化	16,901,656	163,269,996.96	0.16
169	000983	山西焦煤	15,790,500	162,800,055.00	0.16
170	300782	卓胜微	2,087,808	162,306,193.92	0.16
171	603369	今世缘	3,486,844	161,092,192.80	0.16
172	600372	中航机载	13,453,759	161,041,495.23	0.16
173	601838	成都银行	10,601,015	161,029,417.85	0.16
174	600161	天坛生物	6,597,710	160,984,124.00	0.16
175	600023	浙能电力	22,375,600	159,090,516.00	0.16
176	601788	光大证券	10,877,564	159,029,985.68	0.16
177	688223	晶科能源	22,266,288	158,090,644.80	0.16
178	600196	复星医药	7,072,024	156,574,611.36	0.16
179	000807	云铝股份	11,581,900	156,471,469.00	0.16
180	002129	TCL 中环	17,996,216	155,667,268.40	0.16
181	300418	昆仑万维	4,805,200	154,919,648.00	0.16
182	600845	宝信软件	4,816,776	153,799,657.68	0.16
183	002938	鹏鼎控股	3,864,800	153,664,448.00	0.15

184	601021	春秋航空	2,724,456	153,468,606.48	0.15
185	601872	招商轮船	18,126,500	153,168,925.00	0.15
186	601868	中国能建	72,172,600	153,005,912.00	0.15
187	601360	三六零	19,888,801	152,745,991.68	0.15
188	300661	圣邦股份	1,841,512	152,440,363.36	0.15
189	600233	圆通速递	9,581,500	149,950,475.00	0.15
190	600570	恒生电子	8,436,239	148,983,980.74	0.15
191	600219	南山铝业	39,090,050	148,933,090.50	0.15
192	600176	中国巨石	13,356,691	147,591,435.55	0.15
193	002180	纳思达	5,520,700	145,856,894.00	0.15
194	600085	同仁堂	3,810,376	145,594,466.96	0.15
195	601995	中金公司	4,887,738	144,725,922.18	0.15
196	600600	青岛啤酒	1,979,705	144,063,132.85	0.15
197	300896	爱美客	835,823	143,845,138.30	0.14
198	600741	华域汽车	8,773,267	143,706,113.46	0.14
199	605499	东鹏饮料	663,319	143,111,074.25	0.14
200	300347	泰格医药	2,890,377	140,472,322.20	0.14
201	603392	万泰生物	2,123,170	139,874,439.60	0.14
202	002736	国信证券	16,040,282	139,390,050.58	0.14
203	601336	新华保险	4,630,719	139,060,491.57	0.14
204	601100	恒立液压	2,984,455	139,015,913.90	0.14
205	601066	中信建投	7,220,932	138,930,731.68	0.14
206	601689	拓普集团	2,590,600	138,882,066.00	0.14
207	600183	生益科技	6,574,294	138,454,631.64	0.14
208	002271	东方雨虹	11,217,120	138,419,260.80	0.14
209	000895	双汇发展	5,785,453	137,520,217.81	0.14
210	600745	闻泰科技	4,848,992	136,984,024.00	0.14
211	600362	江西铜业	5,775,669	136,767,841.92	0.14
212	000963	华东医药	4,888,787	135,957,166.47	0.14
213	002920	德赛西威	1,554,050	135,342,214.50	0.14
214	001965	招商公路	11,390,300	135,088,958.00	0.14
215	600027	华电国际	18,936,900	131,422,086.00	0.13
216	601881	中国银河	12,090,991	131,308,162.26	0.13
217	601898	中煤能源	10,177,700	127,017,696.00	0.13
218	688126	沪硅产业	9,169,918	126,636,567.58	0.13
219	002459	晶澳科技	11,056,932	123,837,638.40	0.12
220	300033	同花顺	1,188,613	123,259,168.10	0.12
221	601618	中国中冶	39,733,400	123,173,540.00	0.12
222	000999	华润三九	2,860,430	121,797,109.40	0.12
223	600026	中远海能	7,733,300	120,716,813.00	0.12
224	601699	潞安环能	6,653,800	120,633,394.00	0.12
225	002916	深南电路	1,133,868	119,929,218.36	0.12
226	600515	海南机场	38,133,049	119,737,773.86	0.12

227	300832	新产业	1,757,400	118,519,056.00	0.12
228	601607	上海医药	6,195,800	118,401,738.00	0.12
229	000301	东方盛虹	14,717,886	117,301,551.42	0.12
230	601878	浙商证券	10,798,400	115,758,848.00	0.12
231	000876	新希望	12,643,711	115,563,518.54	0.12
232	600039	四川路桥	14,552,460	114,818,909.40	0.12
233	601998	中信银行	17,096,178	114,544,392.60	0.12
234	600332	白云山	3,905,320	114,543,035.60	0.12
235	600588	用友网络	11,417,980	114,179,800.00	0.12
236	600875	东方电气	6,180,300	114,026,535.00	0.11
237	601877	正泰电器	5,979,370	113,966,792.20	0.11
238	002074	国轩高科	5,939,884	113,748,778.60	0.11
239	600415	小商品城	15,257,800	113,212,876.00	0.11
240	002555	三七互娱	8,641,832	112,775,907.60	0.11
241	002709	天赐材料	6,403,900	112,452,484.00	0.11
242	688396	华润微	2,965,605	111,032,251.20	0.11
243	600025	华能水电	10,009,752	107,905,126.56	0.11
244	600803	新奥股份	5,178,025	107,702,920.00	0.11
245	000408	藏格矿业	4,387,938	105,617,667.66	0.11
246	300316	晶盛机电	3,639,200	104,554,216.00	0.11
247	300223	北京君正	1,883,538	104,423,346.72	0.11
248	300628	亿联网络	2,814,418	103,486,149.86	0.10
249	002812	恩捷股份	3,262,876	103,270,025.40	0.10
250	688599	天合光能	6,063,739	102,598,463.88	0.10
251	300142	沃森生物	8,933,860	101,667,326.80	0.10
252	300450	先导智能	6,099,992	101,442,866.96	0.10
253	605117	德业股份	1,331,240	98,964,381.60	0.10
254	600460	士兰微	5,559,096	97,339,770.96	0.10
255	002007	华兰生物	6,105,340	96,403,318.60	0.10
256	601238	广汽集团	12,331,960	95,449,370.40	0.10
257	300496	中科创达	2,054,279	93,654,579.61	0.09
258	603260	合盛硅业	1,980,383	92,503,689.93	0.09
259	301269	华大九天	1,200,329	92,485,349.45	0.09
260	300759	康龙化成	4,968,108	92,307,446.64	0.09
261	300751	迈为股份	771,521	92,181,329.08	0.09
262	601319	中国人保	17,779,800	91,565,970.00	0.09
263	300999	金龙鱼	3,316,600	90,709,010.00	0.09
264	000733	振华科技	2,164,417	89,888,238.01	0.09
265	600018	上港集团	15,544,839	89,849,169.42	0.09
266	601799	星宇股份	789,540	88,460,061.60	0.09
267	600918	中泰证券	15,508,030	87,930,530.10	0.09
268	002821	凯莱英	1,322,818	87,041,424.40	0.09
269	300413	芒果超媒	4,156,221	86,865,018.90	0.09

270	688009	中国通号	14,394,642	86,367,852.00	0.09
271	603806	福斯特	5,807,876	85,375,777.20	0.09
272	601865	福莱特	4,223,905	84,900,490.50	0.09
273	603659	璞泰来	5,948,834	84,057,024.42	0.08
274	603195	公牛集团	1,071,765	82,654,516.80	0.08
275	600132	重庆啤酒	1,337,512	81,186,978.40	0.08
276	300919	中伟股份	2,607,497	80,806,332.03	0.08
277	600061	国投资本	14,286,551	80,719,013.15	0.08
278	000617	中油资本	14,076,300	77,701,176.00	0.08
279	601059	信达证券	5,417,749	76,986,213.29	0.08
280	000708	中信特钢	5,619,784	76,260,468.88	0.08
281	688303	大全能源	3,596,801	73,338,772.39	0.07
282	300454	深信服	1,412,619	71,379,638.07	0.07
283	688187	时代电气	1,440,768	71,145,123.84	0.07
284	002603	以岭药业	4,637,400	71,091,342.00	0.07
285	002410	广联达	7,411,815	71,005,187.70	0.07
286	002841	视源股份	2,345,736	69,269,584.08	0.07
287	300442	润泽科技	2,873,200	68,813,140.00	0.07
288	603899	晨光股份	2,062,275	64,507,962.00	0.07
289	688363	华熙生物	1,064,918	60,242,411.26	0.06
290	601808	中海油服	3,292,718	56,634,749.60	0.06
291	600732	爱旭股份	6,105,440	55,254,232.00	0.06
292	603833	欧派家居	1,010,054	54,098,492.24	0.05
293	300979	华利集团	838,532	51,024,672.20	0.05
294	601236	红塔证券	7,861,637	50,471,709.54	0.05
295	601698	中国卫通	3,522,554	49,632,785.86	0.05
296	300957	贝泰妮	936,528	45,253,032.96	0.05
297	688082	盛美上海	481,642	40,703,565.42	0.04
298	000800	一汽解放	5,165,900	40,448,997.00	0.04
299	603296	华勤技术	505,131	27,898,385.13	0.03
300	001289	龙源电力	835,996	14,420,931.00	0.01
301	688717	艾罗能源	11,303	531,467.06	0.00
302	301589	诺瓦星云	1,244	233,884.44	0.00
303	688692	达梦数据	175	30,612.75	0.00
304	603285	键邦股份	1,287	24,002.55	0.00
305	603350	安乃达	1,051	21,608.56	0.00
306	601033	永兴股份	1,258	20,077.68	0.00
307	301536	星辰科技	481	15,521.87	0.00
308	688584	上海合晶	866	13,760.74	0.00
309	301538	骏鼎达	150	13,686.00	0.00
310	301565	中仑新材	711	13,494.78	0.00
311	603341	龙旗科技	298	11,172.02	0.00
312	688691	灿芯股份	247	10,499.97	0.00

313	301566	达利凯普	576	9,774.72	0.00
314	301392	汇成真空	219	9,123.54	0.00
315	301591	肯特股份	219	8,098.62	0.00
316	301587	中瑞股份	306	7,729.56	0.00
317	001389	广合科技	222	7,672.32	0.00
318	301539	宏鑫科技	361	7,155.02	0.00
319	688695	中创股份	186	5,868.30	0.00
320	688530	欧莱新材	344	5,538.40	0.00
321	301588	美新科技	257	5,461.25	0.00
322	301502	华阳智能	138	5,220.54	0.00
323	603325	博隆技术	66	4,491.96	0.00
324	603381	永臻股份	178	4,473.14	0.00
325	001359	平安电工	184	3,790.40	0.00
326	603312	西典新能	130	3,296.80	0.00
327	603082	北自科技	107	3,155.43	0.00
328	001379	腾达科技	213	2,871.24	0.00
329	603375	盛景微	72	2,800.80	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	1,817,969,064.12	4.82
2	000333	美的集团	1,219,312,762.75	3.24
3	000858	五粮液	1,206,136,312.71	3.20
4	002594	比亚迪	873,800,784.31	2.32
5	300760	迈瑞医疗	703,713,979.83	1.87
6	002371	北方华创	700,967,755.71	1.86
7	300059	东方财富	690,323,303.77	1.83
8	000651	格力电器	664,757,012.88	1.76
9	000725	京东方 A	600,197,431.60	1.59
10	002475	立讯精密	597,061,292.97	1.58
11	300124	汇川技术	522,904,488.04	1.39
12	002415	海康威视	512,549,168.10	1.36
13	600519	贵州茅台	512,129,190.73	1.36
14	000568	泸州老窖	464,091,459.08	1.23
15	300498	温氏股份	441,807,117.24	1.17
16	002714	牧原股份	430,087,587.12	1.14
17	002352	顺丰控股	420,314,753.68	1.12
18	000001	平安银行	407,176,069.31	1.08
19	300274	阳光电源	399,126,364.16	1.06
20	600900	长江电力	366,639,214.01	0.97

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	428,862,313.68	1.14
2	002371	北方华创	378,383,438.31	1.00
3	000858	五粮液	355,283,107.80	0.94
4	002594	比亚迪	303,218,657.42	0.80
5	000333	美的集团	249,821,770.02	0.66
6	600436	片仔癀	209,861,386.10	0.56
7	300124	汇川技术	183,433,611.16	0.49
8	600919	江苏银行	165,857,206.00	0.44
9	601998	中信银行	163,469,234.99	0.43
10	600028	中国石化	159,023,760.00	0.42
11	000661	长春高新	149,316,643.25	0.40
12	002920	德赛西威	141,925,447.49	0.38
13	300059	东方财富	140,738,554.95	0.37
14	002142	宁波银行	138,852,597.96	0.37
15	000725	京东方 A	133,588,309.00	0.35
16	002202	金风科技	123,185,238.78	0.33
17	000651	格力电器	122,389,605.83	0.32
18	300760	迈瑞医疗	117,729,177.32	0.31
19	002352	顺丰控股	112,633,377.63	0.30
20	300782	卓胜微	107,395,772.30	0.29

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	32,455,313,119.40
卖出股票收入（成交）总额	10,984,174,084.83

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

本基金本报告期末未持有债券。

#### 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

本基金本报告期末未持有债券。

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 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，招商银行股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责、处罚的情况。本基金为指数型基金，采取完全复制策略，招商银行系标的指数成份股，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。

7.12.2 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。

7.12.3 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	54,257,558.69
2	应收清算款	135,540,721.84
3	应收股利	139,695.08
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	40,991.62
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	189,978,967.23

7.12.4 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。

7.12.5 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	600900	长江电力	9,254,400.00	0.01	转融通出借证券受限

7.12.6 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		华夏沪深 300ETF 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
34,911	797,119.81	24,315,731,684.00	87.38%	719,851,048.00	2.59%	2,792,667,096.00	10.04%

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	20,937,230,572.00	75.24%
2	北京诚通金控投资有限公司	414,514,000.00	1.49%
3	大家人寿保险股份有限公司-万能产品	268,213,710.00	0.96%
4	中国平安人寿保险股份有限公司-分红-一个险分红	219,654,500.00	0.79%
5	中国平安人寿保险股份有限公司-自有资金	214,672,516.00	0.77%
6	中国人寿再保险有限责任公司	198,905,101.00	0.71%

	公司		
7	中央汇金资产管理有限责任公司	172,096,800.00	0.62%
8	中国人寿保险股份有限公司	167,690,884.00	0.60%
9	大家人寿保险股份有限公司—传统产品	106,752,400.00	0.38%
10	信泰人寿保险股份有限公司—传统产品	58,823,400.00	0.21%
11	中国工商银行股份有限公司—华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	2,792,667,096.00	10.04%

### 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	19,900.00	0.00%

### 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、基金投资和研发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（2012 年 12 月 25 日）基金份额总额	602,808,845
本报告期期初基金份额总额	10,742,649,828
本报告期基金总申购份额	20,241,000,000
减：本报告期基金总赎回份额	3,155,400,000
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	27,828,249,828

## §10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期未发生影响基金管理人经营或基金运营业务的诉讼。

本报告期无涉及基金财产、基金托管业务的诉讼。

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	
中信证券	7	18,707,930,369.22	43.07%	1,794,180.30	43.07%	-
招商证券	4	14,544,187,762.61	33.48%	1,394,841.08	33.48%	-
国泰君安证券	3	8,860,866,136.73	20.40%	849,773.76	20.40%	-
中国银河证券	4	831,125,561.36	1.91%	79,704.86	1.91%	-
中金公司	4	493,648,950.18	1.14%	47,339.45	1.14%	-

注：①为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择券商的标准，即：

- i 经营行为规范。
- ii 公司财务状况良好。
- iii 有良好的内控制度，在业内有良好的声誉。
- iv 有较强的全方位金融服务能力和水平：能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公

司和证券市场研究报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

v 建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯和服务。

②券商专用交易单元选择程序：

i 本基金管理人根据上述标准进行评估并确定选用的券商。

ii 本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议/证券经纪服务协议。

③除本表列示外，本基金还选择了财通证券、长江证券、诚通证券、东北证券、东方财富证券、东方证券、东兴证券、方正证券、广发证券、国金证券、国信证券、华安证券、山西证券、上海证券、世纪证券、新时代证券、信达证券、兴业证券、粤开证券、浙商证券、中金财富、中泰证券、中投证券、中信建投证券、中银国际证券的交易单元作为本基金交易单元，本报告期无股票交易及应付佣金。

④在上述租用的券商交易单元中，方正证券、广发证券、国金证券、国泰君安证券、中信建投证券的部分交易单元、财通证券、国信证券的交易单元为本基金本期新增的交易单元，广发证券的部分交易单元为本期剔除的交易单元。

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
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中国银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
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	中国证监会指定报刊及网站	2024-02-03
2	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024-03-21

## §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	2024-01-01 至 2024-06-30	2,893,029,852.00	18,044,200,720.00	-	20,937,230,572.00	75.24 %
华夏沪深 300ETF 联接	1	2024-01-01 至 2024-01-17	2,740,091,291.00	284,646,900.00	232,071,095.00	2,792,667,096.00	10.04 %

#### 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、中国证监会核准基金募集的文件；
- 2、《华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- 4、法律意见书；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照。

### 12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

### 12.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的住所免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

华夏基金管理有限公司

二〇二四年八月三十日