

华夏标普 500 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）

2026 年中期报告

2026 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：招商银行股份有限公司

送出日期：二〇二六年八月三十一日

§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。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 8 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 境外投资顾问和境外资产托管人	6
2.5 信息披露方式	6
2.6 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	14
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	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
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	16
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	16
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	16
§6 中期报告财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表	16
6.2 利润表	18
6.3 净资产变动表	19
6.4 报表附注	21
§7 投资组合报告	38
7.1 期末基金资产组合情况	38
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布	39
7.3 期末按行业分类的权益投资组合	39
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细	39
7.5 报告期内权益投资组合的重大变动	95
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合	97
7.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细	97
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	97
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细	97
7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细	97
7.11 投资组合报告附注	98
§8 基金份额持有人信息	98

8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	98
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	99
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	99
§9	开放式基金份额变动	99
§10	重大事件揭示	99
10.1	基金份额持有人大会决议	99
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	99
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	99
10.4	基金投资策略的改变	99
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	99
10.6	管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	100
10.7	基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	100
10.8	其他重大事件	101
§11	影响投资者决策的其他重要信息	102
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	102
§12	备查文件目录	102
12.1	备查文件目录	102
12.2	存放地点	102
12.3	查阅方式	102

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华夏标普 500 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）
基金简称	华夏标普 500ETF（QDII）
场内简称	标普 500ETF 华夏
基金主代码	159655
交易代码	159655
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2022 年 10 月 12 日
基金管理人	华夏基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	2,125,143,045.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2022 年 10 月 25 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的最小化，本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。
投资策略	主要投资策略包括完全复制策略，替代性策略，衍生品投资策略，债券投资策略，资产支持证券投资策略，融资及证券出借业务投资策略，境外市场基金投资策略等。
业绩比较基准	经估值汇率调整后的标普 500 指数收益率
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。本基金主要投资境外证券市场，除了需要承担与国内证券投资基金类似的市场波动风险之外，本基金还面临汇率风险等海外市场投资所面临的特别投资风险。

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	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李彬	张姗
	联系电话	400-818-6666	400-61-95555
	电子邮箱	service@ChinaAMC.com	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		400-818-6666	400-61-95555

传真	010-63136700	0755-83195201
注册地址	北京市顺义区安庆大街甲3号院	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
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	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
邮政编码	100101	518040
法定代表人	邹迎光	缪建民

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外资产托管人
名称	英文	Citibank N.A.
	中文	花旗银行
注册地址		701 East 60th Street North, Sioux Falls, SD57104, USA
办公地址		香港中环花园道三号冠君大厦 40 楼
邮政编码		-

2.5 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.ChinaAMC.com
基金中期报告置备地点	基金管理人和/或基金托管人的住所/办公地址

2.6 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	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（2026 年 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	14,366,335.72
本期利润	238,439,872.42
加权平均基金份额本期利润	0.1153
本期加权平均净值利润率	6.56%
本期基金份额净值增长率	6.51%

3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2026年6月30日）
期末可供分配利润	286,147,479.79
期末可供分配基金份额利润	0.1346
期末基金资产净值	3,937,315,090.05
期末基金份额净值	1.8527
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2026年6月30日）
基金份额累计净值增长率	85.27%

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
过去三个月	13.12%	0.85%	12.84%	0.84%	0.28%	0.01%
过去六个月	6.51%	0.92%	6.29%	0.91%	0.22%	0.01%
过去一年	14.76%	0.80%	14.44%	0.79%	0.32%	0.01%
过去三年	58.35%	0.96%	57.47%	0.96%	0.88%	0.00%
自基金合同生效起至今	85.27%	1.00%	97.31%	1.01%	-12.04%	-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

华夏标普 500 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）
 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
 （2022 年 10 月 12 日至 2026 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、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、首批公募 REITs 指数基金管理人，境内首家承诺“碳中和”具体目标和路径的公募基金公司，香港子公司是首批 RQFII 基金管理人。华夏基金是业务领域最广泛的基金管理公司之一。

华夏基金是境内 ETF 基金资产管理规模最大的基金管理公司之一，在 ETF 基金管理方面积累了丰富的经验，形成了覆盖宽基指数、港股（QDII）指数、港股（港股通）指数、行业主题指数、策略指数、跨境指数、固收指数、商品指数等较为完整的产品线。

华夏基金以深入的投资研究为基础，尽力捕捉市场机会，为投资人谋求良好的回报。根据银河证券基金研究中心《中国基金业绩评价报告》，截至 2026 年 6 月 30 日，华夏基金旗下多只产品近 1 年同类排名靠前（基金排名不作为产品未来表现的保证）：

主动权益产品：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)(A 类)排名第 1/25；在低碳环保行业股票型基金(A 类)中，华夏节能环保股票(A 类)排名第 1/10；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(A 类)排名第 2/64；在低碳环保偏股型基金(A 类)中，华夏低碳经济一年持有混合(A 类)排名第 3/32；在债券型 FOF(A 类)中，华夏聚源优选六个月持有债券（FOF）(A 类)排名第 3/24；在养老目标日期 FOF(2045)(A 类)中，华夏养老 2045 三年持有混合（FOF）(A 类)排名第 3/18；在养老目标日期 FOF(2050)(A 类)中，华夏养老 2050 五年持有混合（FOF）(A 类)排名第 3/15；在 QDII 混合基金(A 类)中，华夏移动互联混合（QDII）排名第 3/56、华夏新时代混合（QDII）排名第 5/56、华夏全球科技先锋混合（QDII）排名第 7/56；在偏股型基金(股票上限 80%)(A 类)中，华夏成长混合排名第 13/149；在医药医疗健康行业偏股型基金(A 类)中，华夏乐享健康混合(A 类)排名第 15/89；在偏股型基金(股票上限 95%)(A 类)中，华夏线上经济主题精选混合排名第 25/220；在标准股票型基金(A 类)中，华夏创新前沿股票(A 类)排名第 43/354、华夏领先股票排名第 49/354、华夏经济转型股票排名第 57/354、华夏潜龙精选股票排名第 66/354；在灵活配置型基金(基准股票比例 30%-60%)(A 类)中，华夏磐晟混合（LOF）排名第 35/397、华夏新锦程混合(A 类)排名第 62/397、华夏稳增混合排名第 79/397；在灵活配置型基金(基准股票比例 60%-100%)(A 类)中，华夏高端制造混合(A 类)排名第 36/478；在偏股型基金(股票上下限 60%-95%)(A 类)中，华夏先进制造龙头混合(A 类)排名第 23/1941、华夏科技创新混合(A 类)排名第 78/1941、华夏成长先锋一年持有混合(A 类)排名第 116/1941、华夏核心科技 6 个月定开混合(A 类)排名第 191/1941、华夏产业升级混合(A 类)排名第 212/1941、华夏国企创新混合发起式（A 类）排名第 249/1941、华夏成长机会一年持有混合排名第 268/1941、华夏创业板两年定开混合排名第 276/1941、华夏盛世混合排名第 292/1941、华夏创新驱动混合(A 类)排名第 365/1941、华夏科技前沿 6 个月定开混合(A 类)排名第 372/1941、华夏行业景气混合(A 类)排名第 374/1941。

固收与固收+产品：在可转换债券型基金(A 类)中，华夏可转债增强债券 A 排名第 1/38；在普通债券型基金(可投转债)(A 类)中，华夏双债债券 A 排名第 1/280、华夏聚利债券 A 排名第 4/280、华夏债券 AB 排名第 74/280；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 A 排名第 2/307、华夏兴源稳健一年持有混合 A 排名第 17/307、华夏永顺一年持有混合 A 排名第 31/307；在短期纯债债券型基金(A 类)中，华夏安益短债债券 A 排名第 7/133、华夏 30 天滚动短债债券发起式 A 排名第 8/133；在利率债纯债债券型基金(A 类)中，华夏鼎昭利率债债券 A 排名第 7/98；在普通

债券型基金(二级)(A 类)中, 华夏鼎沛债券 A 排名第 10/540、华夏鼎清债券 A 排名第 12/540、华夏鼎利债券 A 排名第 47/540; 在普通偏债型基金(股票上限高于 30%)(A 类)中, 华夏永鑫六个月持有混合 A 排名第 17/245、华夏永泓一年持有混合 A 排名第 28/245; 在长期纯债债券型基金(A 类)中, 华夏鼎富债券 A 排名第 61/1041、华夏鼎航债券 A 排名第 67/1041、华夏鼎信债券 A 排名第 115/1041、华夏纯债债券 A 排名第 234/1041、华夏鼎茂债券 A 排名第 268/1041; 在标准偏债型基金(股票上下限 10%-30%)(A 类)中, 华夏稳进增益一年持有混合 A 排名第 11/71。

在客户服务方面, 2026 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) 华夏基金管家客户端优化基金详情展示, 增强信息可读性, 从客户投资需求出发, 进一步提升使用体验; (2) 与国贸期货、新华信通等代销机构合作, 拓展更加丰富的客户理财渠道; (3) 开展“未来, 我们继续一起走过”、“选择难度大? 给你支个招”、“当前科技股的三国博弈”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、投委会成员	2022-10-12	-	18 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基金经理(2020 年 12 月 8 日至 2022 年 1 月 13

					日期间)、华夏中证浙江国资创新发展交易型开放式指数证券投资基金基金经理 (2020 年 12 月 8 日至 2022 年 1 月 13 日期间)、华夏中证浙江国资创新发展交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理 (2020 年 12 月 8 日至 2022 年 1 月 13 日期间)、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)、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)、华夏中证云计算与大数据主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2021 年 8 月 24 日至 2025 年 6 月 3 日期间)、华夏沪深 300ESG 基准交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2022 年 2 月 24 日至 2025 年 6 月 3 日期间)、华夏中证云计算与大数据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（2023 年 11 月 14 日至 2025 年 6 月 3 日期间)、华夏沪深 300ESG 基准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（2024
--	--	--	--	--	--

					年 4 月 9 日至 2025 年 6 月 3 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。

4.2 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 45 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标普 500 指数，标普 500 指数被广泛认为是唯一衡量美国大盘股市场的最好指标，该指数成份股包括了美国 500 家顶尖上市公司，占美国股市总市值约 80%。标普 500 指数以美元计价，本基金以人民币计价，业绩比较基准为经估值汇率调整后的标普 500 指数收益率。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。

2026 年上半年，全球经济在地缘冲突扰动和 AI 基建加速两条主线影响下呈现 K 型分化。油价先扬后抑、上半年中枢较去年四季度整体上移，叠加地缘风险溢价，推高全球通胀压力并影响传统

经济复苏；AI Agent 驱动下 AI 产业链投资构建增长核心动能。主要经济体受供给冲击和需求韧性差异表现分化，货币政策由前期宽松转向“按兵不动+紧缩预期”并明显分化。美国国内方面，AI 投资热潮对冲居民消费增速放缓，经济增长和就业市场具备较强韧性，能源冲击导致通胀压力阶段性升温，市场对美联储的政策预期由年初降息 2 次转为年中的加息 2 次。

市场方面，2026 年上半年美股市场波动较大，先是受中东海峡危机影响深蹲调整，而后在 AI 硬件盈利超预期上修带动下重回上行趋势、并创历史新高。汇率方面，美元指数在石油美元体系强化和美联储鹰派表态下保持宽幅震荡上升趋势。人民币汇率在强劲出口及企业结汇支撑下具备较强韧性，人民币兑美元整体保持升值趋势、并创下近三年新高。

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，经深圳证券交易所同意，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中信证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、广发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 2026 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.8527 元，本报告期份额净值增长率为 6.51%，同期经估值汇率调整的业绩比较基准增长率 6.29%。本基金本报告期跟踪偏离度为+0.22%，与业绩比较基准产生偏离的主要原因为日常运作费用、指数结构调整、申购赎回、成份股分红等产生的差异。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2026 年下半年，人工智能技术革命预计仍将成为全球宏观面的重要线索，AI 资本开支维持高强度带来的 K 型分化、中等偏高通胀水平和实际利率抬升环境可能延续，能源冲击带来的通胀上行风险存疑，主要经济体货币政策偏向稳健。美国国内方面，AI 资本开支上行期延续、居民消费保持韧性、地产销售延续磨底，整体经济维持修复趋势，就业好转与通胀温和，美联储货币政策保持谨慎。

市场方面，2026 年下半年大型科技龙头 IPO 相继落地，美股或仍以科技为主线，但需注意节奏与仓位，盈利逐步兑现与政策利率稳健对美股整体仍有支撑。汇率方面，考虑到美联储加息预期高位回落和国内出口高景气支撑，人民币汇率在双向波动过程中保持韧性，人民币兑美元稳中偏强。

本基金将会根据基金合同要求，在紧密跟踪标的指数的基础上，做好相关投资工作。

珍惜基金份额持有人的每一份投资和每一份信任，本基金将继续奉行华夏基金管理有限公司“为信任奉献回报”的经营理念，规范运作，审慎投资，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求长期、稳定的回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末进行利润分配，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

托管人声明：

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本中期报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§6 中期报告财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华夏标普 500 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	58,147,524.07	55,941,327.69
结算备付金		28,980,820.88	24,143,450.38
存出保证金		8,410,931.43	7,544,874.00
交易性金融资产	6.4.7.2	3,845,102,260.56	3,415,492,305.46
其中：股票投资		3,845,102,260.56	3,415,492,305.46
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	-	-
应收清算款		2,972.42	3,521.23
应收股利		1,562,381.45	1,566,069.16
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		3,942,206,890.81	3,504,691,547.92
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		1,853,484.63	1,719,129.09
应付赎回款		-	-

应付管理人报酬		1,915,669.78	1,791,099.66
应付托管费		478,917.45	447,774.91
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		187,035.07	95,572.85
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	456,693.83	559,494.97
负债合计		4,891,800.76	4,613,071.48
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	2,125,143,045.00	2,012,143,045.00
未分配利润	6.4.7.8	1,812,172,045.05	1,487,935,431.44
净资产合计		3,937,315,090.05	3,500,078,476.44
负债和净资产总计		3,942,206,890.81	3,504,691,547.92

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.8527 元，基金份额总额 2,125,143,045.00 份。

6.2 利润表

会计主体：华夏标普 500 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		252,067,233.44	220,038,831.42
1.利息收入		249,052.87	117,163.39
其中：存款利息收入	6.4.7.9	249,052.87	117,163.39
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		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		29,895,905.49	31,027,469.72

其中：股票投资收益	6.4.7.10	-1,172,857.42	18,146,572.57
基金投资收益	6.4.7.11	-	-
债券投资收益	6.4.7.12	-	-
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	5,605,437.63	-370,105.27
股利收益	6.4.7.16	25,463,325.28	13,251,002.42
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	224,073,536.70	191,992,502.52
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-2,168,838.94	-3,377,575.23
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	17,577.32	279,271.02
减：二、营业总支出		13,627,361.02	8,060,248.78
1.管理人报酬		10,804,749.80	6,313,300.79
2.托管费		2,701,187.48	1,578,325.23
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		20,039.47	64.57
8.其他费用	6.4.7.21	101,384.27	168,558.19
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		238,439,872.42	211,978,582.64
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		238,439,872.42	211,978,582.64
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		238,439,872.42	211,978,582.64

6.3 净资产变动表

会计主体：华夏标普 500 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 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	2,012,143,045.00	1,487,935,431.44	3,500,078,476.44
二、本期期初净资产	2,012,143,045.00	1,487,935,431.44	3,500,078,476.44
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	113,000,000.00	324,236,613.61	437,236,613.61
（一）、综合收益总额	-	238,439,872.42	238,439,872.42
（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）	113,000,000.00	85,796,741.19	198,796,741.19
其中：1.基金申购款	113,000,000.00	85,796,741.19	198,796,741.19
2.基金赎回款	-	-	-
（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	2,125,143,045.00	1,812,172,045.05	3,937,315,090.05
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	399,143,045.00	223,164,949.73	622,307,994.73
二、本期期初净资产	399,143,045.00	223,164,949.73	622,307,994.73
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	1,612,000,000.00	1,012,549,445.36	2,624,549,445.36
（一）、综合收益总额	-	211,978,582.64	211,978,582.64
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	1,612,000,000.00	800,570,862.72	2,412,570,862.72
其中：1.基金申购款	1,852,000,000.00	932,325,968.48	2,784,325,968.48
2.基金赎回款	-240,000,000.00	-131,755,105.76	-371,755,105.76
（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	2,011,143,045.00	1,235,714,395.09	3,246,857,440.09

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：邹迎光，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

华夏标普 500 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）（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[2022]472 号文《关于准予华夏标普 500 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）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》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《华夏标普 500 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）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 2022 年 8 月 30 日至 2022 年 9 月 30 日共募集 205,113,000.00 元（不含认购资金利息），业经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）安永华明（2022）验字第 60739337_A56 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华夏标普 500 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金合同》于 2022 年 10 月 12 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 205,143,045.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 30,045.00 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，基金托管人为招商银行股份有限公司，境外资产托管人为花旗银行。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和本基金基金合同的有关规定，本基金标的指数为标普 500 指数。本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。此外，为更好地实现投资目标，本基金可参与其他境外市场投资工具和境内市场投资工具投资。

境外市场投资工具包括已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的公募基金(包括交易型开放式基金(ETF))；已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券市场挂牌交易的普通股、优先股、全球存托凭证和美国存托凭证、房地产信托凭证；政府债券、公司债券、可转换债券、住房按揭支持证券、资产支持证券以及经中国证监会认可的国际金融组织发行的证券；银行存款、可转让存单、银行承兑汇票、银行票据、商业票据、回购协议、短期政府债券等货币市场工具；与固定收益、股权、信用、商品指数、基金等标的物挂钩的结构性投资产品；远期合约、互换及经中国证监会认可的境外交易所上市交易的权证、期权、期货等金融衍生产品；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，但须符合中国证监会相关规定。

境内市场投资工具包括银行存款、货币市场工具（含同业存单）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。

通常情况下，本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%。

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”)、中国证监会颁布的《公开募集证券投资基金信息披露内容与格式准则第 2 号——定期报告的内容与格式》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的《公开募集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》编制,同时在信息披露方面也参考了中国证监会、中国基金业协会发布的基金行业实务操作的其他有关规定。

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[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]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[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》、中华人民共和国主席令第四十一号《中华人民共和国增值税法》、中华人民共和国国务院令 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》

及财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税交易，资管产品管理人为纳税人。自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3% 的规定征收率计算缴纳增值税。

(2) 自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，对公募证券投资基金（封闭式证券投资基金、开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入免征增值税；对证券投资基金从证券市场中取得的买卖股票、债券的差价收入，暂不征收企业所得税。

(3) 存款利息收入不征收增值税。

(4) 自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，金融同业往来利息收入免征增值税。

(5) 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 2026 年 6 月 30 日
活期存款	58,147,524.07
等于：本金	58,146,396.17
加：应计利息	1,127.90
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	58,147,524.07

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	3,155,383,909.72	-	3,845,102,260.56	689,718,350.84
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	3,155,383,909.72	-	3,845,102,260.56	689,718,350.84

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 2026 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	91,212,210.21	-	-	-
其中：股指期货	91,212,210.21	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	91,212,210.21	-	-	-

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
ESU6	S&P500 EMINI FUT Sep26	36	92,179,983.83	967,773.62
合计	-	-	-	967,773.62
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	967,773.62
净额	-	-	-	-

注：衍生金融资产项下的利率/权益/其他衍生工具为国债/股指/商品期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指/商品/国债期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指/商品/国债期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 0。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 其他资产

无。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 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	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	141,780.45
应退替代款	314,913.38
合计	456,693.83

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,012,143,045.00	2,012,143,045.00
本期申购	113,000,000.00	113,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	2,125,143,045.00	2,125,143,045.00

注：申购含红利再投（如有）、转换入份额（如有），赎回含转换出份额（如有）。

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	257,221,350.07	1,230,714,081.37	1,487,935,431.44
本期期初	257,221,350.07	1,230,714,081.37	1,487,935,431.44
本期利润	14,366,335.72	224,073,536.70	238,439,872.42
本期基金份额交易产生的变动数	14,559,794.00	71,236,947.19	85,796,741.19
其中：基金申购款	14,559,794.00	71,236,947.19	85,796,741.19
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	286,147,479.79	1,526,024,565.26	1,812,172,045.05

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	66,402.83
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	182,650.04
其他	-
合计	249,052.87

6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	40,156,598.76
减：卖出股票成本总额	41,300,383.62
减：交易费用	29,072.56
买卖股票差价收入	-1,172,857.42

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 2026年1月1日至2026年6月30日
股指期货投资收益	5,605,437.63

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资产生的股利收益	25,463,325.28
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	25,463,325.28

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
1.交易性金融资产	222,446,466.73
——股票投资	222,446,466.73
——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	1,627,069.97
——权证投资	-
——期货投资	1,627,069.97
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	224,073,536.70

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	17,577.32
合计	17,577.32

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 2026年1月1日至2026年6月30日
审计费用	27,273.08
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	14,603.82
其他	-
合计	101,384.27

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、关联关系

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
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	基金托管人
花旗银行	基金境外资产托管人
华夏标普 500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金 (QDII) (“华夏标普 500ETF 发起式联接 (QDII) ”)	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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

无。

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 债券交易

无。

6.4.10.1.4 债券回购交易

无。

6.4.10.1.5 基金交易

无。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月 30日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	10,804,749.80	6,313,300.79
其中：应支付销售机构的客户维护费	294,199.43	68,480.83
应支付基金管理人的净管理费	10,510,550.37	6,244,819.96

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 0.60%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

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

③客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用按照代销机构所代销基金的份额保有量作为基数进行计算，从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30 日	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	2,701,187.48	1,578,325.23

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 0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

②基金托管费计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×年费率/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

无。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 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
华夏标普 500ETF 发起式联接（QDII）	238,544,499.00	11.22%	341,175,016.00	16.96%
中信证券	4,392,366.00	0.21%	1,034,766.00	0.05%

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金相关的费用按基金合同及相关法律文件有关规定支付。

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 2026年1月1日至2026年6月30日		上年度可比期间 2025年1月1日至2025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
招商银行活期存款	19,361,034.37	65,258.16	77,189,205.73	29,694.73
花旗银行活期存款	38,786,489.70	1,144.67	2,499,799.48	667.45

注：本基金的活期银行存款分别由基金托管人招商银行和基金境外资产托管人花旗银行保管，按适用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

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

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（2026 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

无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

6.4.13.3 流动性风险

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

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

在资产端，本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股，如需对组合进行调整时，由于投资标的的流动性较好，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。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2026年6月30日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
货币资金	38,711,295.76	-	-	38,711,295.76

交易性金融资产	3,845,102,260.56	-	-	3,845,102,260.56
衍生金融资产	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-
应收股利	1,562,381.45	-	-	1,562,381.45
应收申购款	-	-	-	-
其他资产	37,015,712.31	-	-	37,015,712.31
资产合计	3,922,391,650.08	-	-	3,922,391,650.08
以外币计价的负债				
应付在途资金	-	-	-	-
应付清算款	1,853,484.63	-	-	1,853,484.63
应付换汇款	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-
应付赎回费	-	-	-	-
负债合计	1,853,484.63	-	-	1,853,484.63
项目	上年度末 2025年12月31日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
货币资金	21,735,702.82	-	-	21,735,702.82
交易性金融资产	3,415,492,305.46	-	-	3,415,492,305.46
衍生金融资产	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-
应收股利	1,566,069.16	-	-	1,566,069.16
应收申购款	-	-	-	-
其他资产	31,312,284.38	-	-	31,312,284.38
资产合计	3,470,106,361.82	-	-	3,470,106,361.82
以外币计价的负债				

应付在途资金	-	-	-	-
应付清算款	1,719,129.09	-	-	1,719,129.09
应付换汇款	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-
应付赎回费	-	-	-	-
负债合计	1,719,129.09	-	-	1,719,129.09

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
	所有外币相对人民币升值 5%	196,026,908.27	173,419,361.64
	所有外币相对人民币贬值 5%	-196,026,908.27	-173,419,361.64

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 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 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	3,845,102,260.56	97.66	3,415,492,305.46	97.58
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	3,845,102,260.56	97.66	3,415,492,305.46	97.58

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	除标普 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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
	-5%	-213,180,165.30	-175,243,180.70
	+5%	213,180,165.30	175,243,180.70

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 2026 年 6 月 30 日
第一层次	3,845,102,260.56
第二层次	-
第三层次	-
合计	3,845,102,260.56

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券等投资，若出现交易不活跃（包括重大事项停牌、境内证券涨跌停等导致的交易不活跃）和非公开发行等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。

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 2026 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	3,845,102,260.56	97.54
	其中：普通股	3,777,415,804.29	95.82
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托	67,686,456.27	1.72
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	87,128,344.95	2.21
8	其他各项资产	9,976,285.30	0.25

9	合计	3,942,206,890.81	100.00
---	----	------------------	--------

注：股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值。

7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家（地区）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
美国	3,845,102,260.56	97.66
合计	3,845,102,260.56	97.66

7.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
信息技术	1,472,163,511.82	37.39
金融	455,230,943.93	11.56
通信服务	374,810,502.06	9.52
非必需消费品	360,483,680.35	9.16
保健	344,052,240.01	8.74
工业	319,481,984.50	8.11
必需消费品	176,857,903.11	4.49
能源	115,330,536.46	2.93
公用事业	85,021,043.94	2.16
材料	70,920,301.95	1.80
房地产	70,749,612.43	1.80
合计	3,845,102,260.56	97.66

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

7.4.1 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	公司名称（中文）	证券代码	所在证券市场	所属国家（地区）	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	NVIDIA CORP	英伟达	NVDA	纳斯达克	美国	214,416.00	291,071,993.88	7.39

		公司		达克 证券 交易 所				
2	APPLE INC	苹果公 司	AAPL	纳斯 达克 证券 交易 所	美国	130,022.00	255,254,369.18	6.48
3	ALPHABET INC	谷歌公 司	GOOGL	纳斯 达克 证券 交易 所	美国	51,909.00	125,857,355.29	3.20
			GOOG	纳斯 达克 证券 交易 所	美国	41,841.00	100,299,880.56	2.55
4	MICROSOFT CORP	微软公 司	MSFT	纳斯 达克 证券 交易 所	美国	65,761.00	166,424,926.29	4.23
5	AMAZON.COM INC	亚马逊 公司	AMZN	纳斯 达克 证券 交易 所	美国	86,658.00	140,127,522.45	3.56
6	BROADCOM INC	博通股 份有限 公司	AVGO	纳斯 达克 证券 交易 所	美国	41,914.00	107,419,080.09	2.73
7	MICRON TECHNOLOGY INC	美光科 技股份 有限公 司	MU	纳斯 达克 证券 交易 所	美国	9,983.00	78,179,673.28	1.99
8	META PLATFORMS INC	-	META	纳斯 达克 证券 交易 所	美国	19,441.00	74,296,522.78	1.89

9	TESLA INC	特斯拉公司	TSLA	纳斯达克证券交易所	美国	24,923.00	71,119,293.33	1.81
10	ELI LILLY & CO	礼来	LLY	美国纽约证券交易所	美国	7,003.00	56,987,142.44	1.45
11	ADVANCED MICRO DEVICES INC	-	AMD	纳斯达克证券交易所	美国	14,435.00	56,890,989.52	1.44
12	BERKSHIRE HATHAWAY INC	伯克希尔哈撒韦公司	BRK/B	美国纽约证券交易所	美国	16,230.00	55,099,161.35	1.40
13	JPMORGAN CHASE & CO	摩根大通	JPM	美国纽约证券交易所	美国	23,721.00	52,678,894.30	1.34
14	INTEL CORP	英特尔公司	INTC	纳斯达克证券交易所	美国	41,824.00	39,620,700.60	1.01
15	JOHNSON & JOHNSON	强生	JNJ	美国纽约证券交易所	美国	21,310.00	36,718,397.20	0.93
16	APPLIED MATERIALS INC	应用材料公司	AMAT	纳斯达克证券交易所	美国	7,026.00	34,463,889.53	0.88
17	VISA INC	维萨公司	V	美国纽约证券交易所	美国	14,693.00	34,200,809.48	0.87

18	EXXON MOBIL CORP	埃克森美孚石油公司	XOM	美国 纽约 证券 交易 所	美国	36,694.00	34,036,504.57	0.86
19	LAM RESEARCH CORP	泛林集团	LRCX	纳斯 达克 证券 交易 所	美国	11,071.00	32,547,936.08	0.83
20	WALMART INC	沃尔玛股份有限公司	WMT	纳斯 达克 证券 交易 所	美国	38,810.00	29,822,087.96	0.76
21	CATERPILLAR INC	卡特彼勒公司	CAT	美国 纽约 证券 交易 所	美国	4,077.00	29,455,566.88	0.75
22	CISCO SYSTEMS INC	思科公司	CSCO	纳斯 达克 证券 交易 所	美国	34,967.00	27,865,460.01	0.71
23	ABBVIE INC	艾伯维股份有限公司	ABBV	美国 纽约 证券 交易 所	美国	15,641.00	26,703,121.96	0.68
24	COSTCO WHOLESALE CORP	开市客公司	COST	纳斯 达克 证券 交易 所	美国	3,928.00	24,929,822.73	0.63
25	MASTERCARD INC	万事达股份有限公司	MA	美国 纽约 证券 交易 所	美国	7,143.00	24,889,920.65	0.63
26	KLA CORP	科磊公司	KLAC	纳斯 达克 证券 交易 所	美国	11,564.00	23,670,947.09	0.60

27	GENERAL ELECTRIC CO	通用电气公司	GE	美国 纽约 证券 交易 所	美国	9,236.00	23,418,535.46	0.59
28	UNITEDHEALTH GROUP INC	联合健康集团	UNH	美国 纽约 证券 交易 所	美国	8,039.00	22,668,707.71	0.58
29	BANK OF AMERICA CORP	美国银行公司	BAC	美国 纽约 证券 交易 所	美国	57,798.00	22,343,597.66	0.57
30	HOME DEPOT INC/THE	家得宝	HD	美国 纽约 证券 交易 所	美国	8,817.00	21,096,942.52	0.54
31	PROCTER & GAMBLE CO/THE	宝洁	PG	美国 纽约 证券 交易 所	美国	20,614.00	20,508,437.36	0.52
32	SANDISK CORP	闪迪公司/特拉华州	SNDK	纳斯 达克 证券 交易 所	美国	1,311.00	20,223,644.87	0.51
33	MERCK & CO INC	默克	MRK	美国 纽约 证券 交易 所	美国	21,864.00	19,061,215.58	0.48
34	GE VERNOVA INC	-	GEV	美国 纽约 证券 交易 所	美国	2,379.00	18,962,622.82	0.48
35	COCA-COLA CO/THE	可口可乐	KO	美国 纽约 证券 交易 所	美国	34,280.00	18,901,180.08	0.48

36	CHEVRON CORP	雪佛龙	CVX	美国 纽约 证券 交易 所	美国	16,573.00	18,637,974.59	0.47
37	NETFLIX INC	奈飞公 司	NFLX	纳斯 达克 证券 交易 所	美国	37,277.00	18,057,474.58	0.46
38	GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE	高盛	GS	美国 纽约 证券 交易 所	美国	2,612.00	17,922,603.07	0.46
39	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC	菲利普 莫里斯 国际股 份有限 公司	PM	美国 纽约 证券 交易 所	美国	13,797.00	16,934,215.60	0.43
40	PALO ALTO NETWORKS INC	派拓网 络公司	PANW	纳斯 达克 证券 交易 所	美国	7,179.00	16,609,694.71	0.42
41	TEXAS INSTRUMENTS INC	德州仪 器公司	TXN	纳斯 达克 证券 交易 所	美国	8,057.00	16,293,315.91	0.41
42	PALANTIR TECHNOLOGIES INC	-	PLTR	纳斯 达克 证券 交易 所	美国	20,326.00	16,088,996.82	0.41
43	INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP	国际商 业机器 公司	IBM	美国 纽约 证券 交易 所	美国	8,320.00	15,873,472.12	0.40
44	MARVELL TECHNOLOGY INC	美满电 子科技 公司	MRVL	纳斯 达克 证券 交易 所	美国	7,751.00	15,665,040.00	0.40

45	WELLS FARGO & CO	富国集团 公司	WFC	美国 纽约 证券 交易 所	美国	27,091.00	15,189,140.23	0.39
46	MORGAN STANLEY	摩根士 丹利	MS	美国 纽约 证券 交易 所	美国	10,612.00	15,050,276.71	0.38
47	ORACLE CORP	甲骨文 股份有 限公司	ORCL	美国 纽约 证券 交易 所	美国	15,022.00	14,935,901.03	0.38
48	LINDE PLC	林德公 司	LIN	纳斯 达克 证券 交易 所	美国	4,093.00	14,410,423.32	0.37
49	CITIGROUP INC	花旗集 团	C	美国 纽约 证券 交易 所	美国	15,099.00	14,337,385.60	0.36
50	WESTERN DIGITAL CORP	西部数 据公司	WDC	纳斯 达克 证券 交易 所	美国	3,051.00	13,221,190.71	0.34
51	AMPHENOL CORP	安费诺 公司	APH	美国 纽约 证券 交易 所	美国	10,891.00	13,028,282.95	0.33
52	SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS PLC	-	STX	纳斯 达克 证券 交易 所	美国	1,985.00	12,995,879.36	0.33
53	CORNING INC	康宁公 司	GLW	美国 纽约 证券 交易 所	美国	6,933.00	12,014,645.20	0.31

54	AMGEN INC	安进公司	AMGN	纳斯达克 证券交易 所	美国	4,778.00	11,738,605.40	0.30
55	QUALCOMM INC	高通公司	QCOM	纳斯达克 证券交易 所	美国	9,331.00	11,698,347.06	0.30
56	CROWDSTRIKE HOLDINGS INC	-	CRWD	纳斯达克 证券交易 所	美国	2,253.00	11,664,960.06	0.30
57	ANALOG DEVICES INC	亚德诺 半导体公 司	ADI	纳斯 达克 证 券 交 易 所	美国	4,322.00	11,646,060.62	0.30
58	MCDONALD'S CORP	麦当劳	MCD	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	6,290.00	11,535,345.45	0.29
59	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	-	TMO	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	3,290.00	11,190,859.07	0.28
60	PEPSICO INC	百事公 司	PEP	纳斯 达克 证 券 交 易 所	美国	12,100.00	11,115,317.73	0.28
61	NEXTERA ENERGY INC	新纪元 能源公 司	NEE	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	18,461.00	10,993,074.41	0.28
62	AMERICAN EXPRESS CO	美国运 通	AXP	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	4,712.00	10,813,366.77	0.27

63	VERIZON COMMUNICATIONS INC	-	VZ	美国 纽约 证券 交易 所	美国	36,965.00	10,618,408.06	0.27
64	ARISTA NETWORKS INC	-	ANET	美国 纽约 证券 交易 所	美国	9,141.00	10,535,467.41	0.27
65	BOEING CO/THE	波音	BA	美国 纽约 证券 交易 所	美国	6,979.00	10,249,643.55	0.26
66	TJX COS INC/THE	-	TJX	美国 纽约 证券 交易 所	美国	9,789.00	10,061,640.78	0.26
67	WALT DISNEY CO/THE	华特迪 士尼公 司	DIS	美国 纽约 证券 交易 所	美国	15,373.00	10,038,693.91	0.25
68	EATON CORP PLC	伊顿公 共有限 公司	ETN	美国 纽约 证券 交易 所	美国	3,437.00	9,936,405.29	0.25
69	UNION PACIFIC CORP	联合太 平洋	UNP	美国 纽约 证券 交易 所	美国	5,256.00	9,699,338.30	0.25
70	WELLTOWER INC	沃尔塔 公司	WELL	美国 纽约 证券 交易 所	美国	6,249.00	9,622,697.40	0.24
71	DEERE & CO	迪尔	DE	美国 纽约 证券 交易 所	美国	2,224.00	9,571,232.83	0.24

72	ABBOTT LABORATORIES	雅培制药有限公司	ABT	美国 纽约 证券 交易 所	美国	15,420.00	9,492,945.67	0.24
73	GILEAD SCIENCES INC	吉利德科学公司	GILD	纳斯 达克 证券 交易 所	美国	10,991.00	9,420,976.65	0.24
74	CHARLES SCHWAB CORP/THE	嘉信理财	SCHW	美国 纽约 证券 交易 所	美国	14,472.00	9,059,556.15	0.23
75	UBER TECHNOLOGIES INC	优步技术股份有限公司	UBER	美国 纽约 证券 交易 所	美国	18,020.00	8,822,042.75	0.22
76	AT&T INC	美国电话电报公司	T	美国 纽约 证券 交易 所	美国	61,511.00	8,638,552.56	0.22
77	INTUITIVE SURGICAL INC	直觉外科手术公司	ISRG	纳斯 达克 证券 交易 所	美国	3,135.00	8,458,417.97	0.21
78	BLACKROCK INC	贝莱德股份有限公司	BLK	美国 纽约 证券 交易 所	美国	1,278.00	8,337,293.48	0.21
79	APPLOVIN CORP	-	APP	纳斯 达克 证券 交易 所	美国	2,382.00	8,326,466.64	0.21
80	BOOKING HOLDINGS INC	缤客控股公司	BKNG	纳斯 达克 证券 交易 所	美国	6,860.00	8,295,587.26	0.21

81	PFIZER INC	辉瑞制 药公司	PFE	美国 纽约 证券 交易 所	美国	50,455.00	8,242,871.70	0.21
82	CVS HEALTH CORP	-	CVS	美国 纽约 证券 交易 所	美国	11,295.00	7,927,469.45	0.20
83	VERTIV HOLDINGS CO	维谛技 术控股 公司	VRT	美国 纽约 证券 交易 所	美国	3,400.00	7,723,393.39	0.20
84	SALESFORCE INC	-	CRM	美国 纽约 证券 交易 所	美国	7,242.00	7,697,230.45	0.20
85	PROGRESSIVE CORP/THE	前进保 险公司	PGR	美国 纽约 证券 交易 所	美国	5,173.00	7,666,768.93	0.19
86	CONOCOPHILLIPS	康菲石 油	COP	美国 纽约 证券 交易 所	美国	10,785.00	7,606,839.75	0.19
87	PROLOGIS INC	安博	PLD	美国 纽约 证券 交易 所	美国	8,254.00	7,586,220.16	0.19
88	VERTEX PHARMACEUTICALS INC	福泰制 药公司	VRTX	纳斯 达克 证券 交易 所	美国	2,247.00	7,572,535.35	0.19
89	CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	第一资 本金融	COF	美国 纽约 证券 交易 所	美国	5,509.00	7,498,335.10	0.19

90	DELL TECHNOLOGIES INC	戴尔科技公司	DELL	美国 纽约 证券 交易 所	美国	2,561.00	7,496,662.59	0.19
91	LOWE'S COS INC	劳氏	LOW	美国 纽约 证券 交易 所	美国	4,958.00	7,416,743.62	0.19
92	S&P GLOBAL INC	标普全球	SPGI	美国 纽约 证券 交易 所	美国	2,684.00	7,416,040.88	0.19
93	PARKER-HANNIFIN CORP	派克汉尼汾公司	PH	美国 纽约 证券 交易 所	美国	1,116.00	7,405,837.54	0.19
94	CHUBB LTD	邱博保险集团	CB	美国 纽约 证券 交易 所	美国	3,193.00	7,381,419.44	0.19
95	ALTRIA GROUP INC	高特利	MO	美国 纽约 证券 交易 所	美国	14,783.00	7,216,244.21	0.18
96	DANAHER CORP	丹纳赫	DHR	美国 纽约 证券 交易 所	美国	5,576.00	7,205,929.26	0.18
97	BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	百时美施贵宝公司	BMJ	美国 纽约 证券 交易 所	美国	18,078.00	7,067,104.01	0.18
98	STARBUCKS CORP	星巴克公司	SBUX	纳斯 达克 证券 交易 所	美国	10,089.00	6,994,784.97	0.18

99	STRYKER CORP	史赛克公司	SYK	美国 纽约 证券 交易 所	美国	3,054.00	6,523,441.67	0.17
100	TRANE TECHNOLOGIES PLC	特灵科技公共有限公司	TT	美国 纽约 证券 交易 所	美国	1,957.00	6,521,262.21	0.17
101	QUANTA SERVICES INC	-	PWR	美国 纽约 证券 交易 所	美国	1,328.00	6,487,427.91	0.16
102	SOUTHERN CO/THE	南方公司	SO	美国 纽约 证券 交易 所	美国	9,980.00	6,480,458.06	0.16
103	HOWMET AEROSPACE INC	-	HWM	美国 纽约 证券 交易 所	美国	3,542.00	6,460,893.73	0.16
104	CADENCE DESIGN SYSTEMS INC	铿腾电子科技有限公司	CDNS	纳斯 达克 证券 交易 所	美国	2,442.00	6,218,207.55	0.16
105	EQUINIX INC	-	EQIX	纳斯 达克 证券 交易 所	美国	873.00	6,173,938.90	0.16
106	SERVICENOW INC	-	NOW	美国 纽约 证券 交易 所	美国	9,130.00	6,149,649.91	0.16
107	MEDTRONIC PLC	美敦力	MDT	美国 纽约 证券 交易 所	美国	11,366.00	6,032,520.81	0.15

108	NEWMONT CORP	纽蒙黄金公司	NEM	美国 纽约 证券 交易 所	美国	9,451.00	5,988,836.91	0.15
109	BANK OF NEW YORK MELLON CORP/THE	纽约梅 隆银行	BNY	美国 纽约 证券 交易 所	美国	6,076.00	5,961,203.37	0.15
110	PNC FINANCIAL SERVICES GROUP INC/THE	-	PNC	美国 纽约 证券 交易 所	美国	3,555.00	5,938,554.94	0.15
111	DUKE ENERGY CORP	杜克能 源公司	DUK	美国 纽约 证券 交易 所	美国	6,901.00	5,926,454.65	0.15
112	CUMMINS INC	康明斯	CMI	美国 纽约 证券 交易 所	美国	1,222.00	5,912,980.91	0.15
113	FORTINET INC	飞塔信 息	FTNT	纳斯 达克 证券 交易 所	美国	5,513.00	5,745,840.95	0.15
114	US BANCORP	美国合 众银行	USB	美国 纽约 证券 交易 所	美国	13,742.00	5,631,248.98	0.14
115	WILLIAMS COS INC/THE	威廉姆 斯公司	WMB	美国 纽约 证券 交易 所	美国	10,827.00	5,460,702.80	0.14
116	MCKESSON CORP	-	MCK	美国 纽约 证券 交易 所	美国	1,064.00	5,454,455.76	0.14

117	FREEMPORT-MCMORAN INC	自由港迈克墨伦股份有限公司	FCX	美国纽约证券交易所	美国	12,726.00	5,429,894.11	0.14
118	GENERAL DYNAMICS CORP	通用动力	GD	美国纽约证券交易所	美国	2,247.00	5,400,307.86	0.14
119	AUTOMATIC DATA PROCESSING INC	自动数据处理公司	ADP	纳斯达克证券交易所	美国	3,539.00	5,377,116.87	0.14
120	JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	江森自控国际有限公司	JCI	美国纽约证券交易所	美国	5,401.00	5,353,921.08	0.14
121	CSX CORP	-	CSX	纳斯达克证券交易所	美国	16,449.00	5,304,264.37	0.13
122	COMCAST CORP	康卡斯特公司	CMCSA	纳斯达克证券交易所	美国	31,540.00	5,253,285.84	0.13
123	BLACKSTONE INC	黑石集团股份有限公司	BX	美国纽约证券交易所	美国	6,576.00	5,249,831.99	0.13
124	DATADOG INC	数据狗	DDOG	纳斯达克证券交易所	美国	2,929.00	5,173,821.98	0.13
125	SYNOPSYS INC	新思科技公司	SNPS	纳斯达克证券交易所	美国	1,696.00	5,132,709.81	0.13

126	3M CO	-	MMM	美国 纽约 证券 交易 所	美国	4,617.00	5,071,674.75	0.13
127	ELEVANCE HEALTH INC	-	ELV	美国 纽约 证券 交易 所	美国	1,922.00	5,042,885.33	0.13
128	ADOBE INC	奥多比 公司	ADBE	纳斯 达克 证券 交易 所	美国	3,578.00	4,976,848.40	0.13
129	WASTE MANAGEMENT INC	废品管 理	WM	美国 纽约 证券 交易 所	美国	3,271.00	4,946,175.14	0.13
130	MARRIOTT INTERNATIONAL INC/MD	万豪国 际集团	MAR	纳斯 达克 证券 交易 所	美国	1,938.00	4,872,651.10	0.12
131	MARSH & MCLENNAN COS INC	-	MRSH	美国 纽约 证券 交易 所	美国	4,265.00	4,822,745.20	0.12
132	UNITED PARCEL SERVICE INC	联合包 裹服务 股份有 限公司	UPS	美国 纽约 证券 交易 所	美国	6,609.00	4,820,166.75	0.12
133	EMERSON ELECTRIC CO	艾默生 电气	EMR	美国 纽约 证券 交易 所	美国	4,958.00	4,815,215.43	0.12
134	CME GROUP INC	芝加哥 商业交 易所	CME	纳斯 达克 证券 交易 所	美国	3,208.00	4,806,293.40	0.12

135	CONSTELLATION ENERGY CORP	美国联合能源公司	CEG	纳斯达克证券交易所	美国	2,830.00	4,768,737.53	0.12
136	ROBINHOOD MARKETS INC	罗宾汉市场股份公司	HOOD	纳斯达克证券交易所	美国	7,004.00	4,765,169.02	0.12
137	ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	皇家加勒比国际游轮有限公司	RCL	美国纽约证券交易所	美国	2,208.00	4,756,655.29	0.12
138	SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	宣伟公司	SHW	美国纽约证券交易所	美国	2,031.00	4,744,495.29	0.12
139	T-MOBILE US INC	-	TMUS	纳斯达克证券交易所	美国	4,120.00	4,688,412.44	0.12
140	VALERO ENERGY CORP	-	VLO	美国纽约证券交易所	美国	2,629.00	4,645,325.17	0.12
141	COHERENT CORP	相干公司	COHR	美国纽约证券交易所	美国	1,732.00	4,635,319.93	0.12
142	ACCENTURE PLC	埃森哲公司	ACN	美国纽约证券交易所	美国	5,435.00	4,588,570.38	0.12
143	O'REILLY AUTOMOTIVE INC	奥莱利汽车公司	ORLY	纳斯达克证券交易所	美国	7,336.00	4,583,419.86	0.12

144	AMERICAN TOWER CORP	美国发射塔公司	AMT	美国纽约证券交易所	美国	4,124.00	4,576,570.50	0.12
145	TERADYNE INC	泰瑞达	TER	纳斯达克证券交易所	美国	1,386.00	4,549,700.90	0.12
146	HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	希尔顿全球控股股份有限公司	HLT	美国纽约证券交易所	美国	2,015.00	4,517,641.83	0.11
147	MARATHON PETROLEUM CORP	马拉松石油公司	MPC	美国纽约证券交易所	美国	2,584.00	4,482,188.61	0.11
148	TRANSDIGM GROUP INC	-	TDG	美国纽约证券交易所	美国	495.00	4,473,426.56	0.11
149	AMERICAN ELECTRIC POWER CO INC	美国电力公司	AEP	纳斯达克证券交易所	美国	4,817.00	4,471,078.92	0.11
150	MONDELEZ INTERNATIONAL INC	亿滋国际公司	MDLZ	纳斯达克证券交易所	美国	11,364.00	4,459,409.51	0.11
151	COLGATE-PALMOLIVE CO	高露洁棕榄	CL	美国纽约证券交易所	美国	7,084.00	4,406,268.97	0.11
152	CIGNA GROUP/THE	信诺集团	CI	美国纽约证券交易所	美国	2,342.00	4,380,361.95	0.11

153	SIMON PROPERTY GROUP INC	西蒙房地产集团公司	SPG	美国纽约证券交易所	美国	2,871.00	4,356,321.68	0.11
154	INTUIT INC	财捷集团	INTU	纳斯达克证券交易所	美国	2,448.00	4,334,807.02	0.11
155	CRH PLC	-	CRH	美国纽约证券交易所	美国	5,915.00	4,293,943.97	0.11
156	UNITED RENTALS INC	联合租赁公司	URI	美国纽约证券交易所	美国	555.00	4,265,781.17	0.11
157	NXP SEMICONDUCTORS NV	恩智浦半导体公司	NXPI	纳斯达克证券交易所	美国	2,235.00	4,261,358.36	0.11
158	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	霍尼韦尔国际公司	HON	纳斯达克证券交易所	美国	2,805.00	4,260,933.99	0.11
159	AON PLC	怡安公共有限公司	AON	美国纽约证券交易所	美国	1,891.00	4,255,413.37	0.11
160	ILLINOIS TOOL WORKS INC	伊利诺伊工具股份有限公司	ITW	美国纽约证券交易所	美国	2,318.00	4,253,538.61	0.11
161	NORFOLK SOUTHERN CORP	诺福克南方	NSC	美国纽约证券交易所	美国	1,988.00	4,243,059.68	0.11

162	ECOLAB INC	艺康集团	ECL	美国 纽约 证券 交易 所	美国	2,242.00	4,237,894.64	0.11
163	TRAVELERS COS INC/THE	旅行家集团	TRV	美国 纽约 证券 交易 所	美国	1,882.00	4,215,113.78	0.11
164	HONEYWELL AEROSPACE INC	-	HONA	纳斯 达克 证券 交易 所	美国	2,805.00	4,207,267.91	0.11
165	DOORDASH INC	-	DASH	纳斯 达克 证券 交易 所	美国	3,350.00	4,194,011.68	0.11
166	COMFORT SYSTEMS USA INC	美国舒 适系统 公司	FIX	美国 纽约 证券 交易 所	美国	311.00	4,181,873.87	0.11
167	INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	-	ICE	美国 纽约 证券 交易 所	美国	5,006.00	4,181,210.41	0.11
168	SLB LTD	斯伦贝 谢有限 公司	SLB	美国 纽约 证券 交易 所	美国	13,235.00	4,174,469.95	0.11
169	GENERAL MOTORS CO	通用汽 车公司	GM	美国 纽约 证券 交易 所	美国	7,982.00	4,174,180.99	0.11
170	CIENA CORP	-	CIEN	美国 纽约 证券 交易 所	美国	1,252.00	4,166,911.81	0.11

171	EOG RESOURCES INC	-	EOG	美国 纽约 证券 交易 所	美国	4,715.00	4,149,922.27	0.11
172	MOTOROLA SOLUTIONS INC	摩托罗 拉解决 方案股 份有限 公司	MSI	美国 纽约 证券 交易 所	美国	1,470.00	4,141,776.46	0.11
173	FEDEX CORP	联邦快 递	FDX	美国 纽约 证券 交易 所	美国	1,943.00	4,127,768.43	0.10
174	MONSTER BEVERAGE CORP	怪兽饮 料公司	MNST	纳斯 达克 证券 交易 所	美国	6,320.00	4,121,437.20	0.10
175	ROSS STORES INC	罗斯百 货股份 有限公 司	ROST	纳斯 达克 证券 交易 所	美国	2,852.00	4,118,518.51	0.10
176	MOODY'S CORP	穆迪	MCO	美国 纽约 证券 交易 所	美国	1,330.00	4,086,871.53	0.10
177	MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	芯源系 统有限 公司	MPWR	纳斯 达克 证券 交易 所	美国	435.00	4,079,700.32	0.10
178	PHILLIPS 66	菲利浦 66	PSX	美国 纽约 证券 交易 所	美国	3,549.00	4,070,418.10	0.10
179	LUMENTUM HOLDINGS INC	-	LITE	纳斯 达克 证券 交易 所	美国	689.00	4,011,019.06	0.10

180	WARNER BROS DISCOVERY INC	华纳兄弟探索股份有限公司	WBD	纳斯达克证券交易所	美国	21,940.00	3,968,392.45	0.10
181	AIR PRODUCTS AND CHEMICALS INC	空气产品公司	APD	美国纽约证券交易所	美国	1,971.00	3,920,476.11	0.10
182	KKR & CO INC	-	KKR	美国纽约证券交易所	美国	6,120.00	3,810,810.23	0.10
183	BOSTON SCIENTIFIC CORP	波士顿科学	BSX	美国纽约证券交易所	美国	13,158.00	3,810,062.85	0.10
184	PACCAR INC	帕卡公司	PCAR	纳斯达克证券交易所	美国	4,659.00	3,796,871.34	0.10
185	KINDER MORGAN INC	特拉华州金德摩根公司	KMI	美国纽约证券交易所	美国	17,332.00	3,759,318.86	0.10
186	REGENERON PHARMACEUTICALS INC	再生元制药股份有限公司	REGN	纳斯达克证券交易所	美国	885.00	3,743,910.31	0.10
187	TRUIST FINANCIAL CORP	-	TFC	美国纽约证券交易所	美国	11,029.00	3,727,843.80	0.09
188	ALLSTATE CORP/THE	好事达保险公司	ALL	美国纽约证券交易所	美国	2,279.00	3,678,998.66	0.09

189	DELTA AIR LINES INC	达美航空有限公司	DAL	美国 纽约 证券 交易 所	美国	5,785.00	3,675,998.82	0.09
190	SEMPRA	-	SRE	美国 纽约 证券 交易 所	美国	5,787.00	3,639,970.89	0.09
191	HCA HEALTHCARE INC	-	HCA	美国 纽约 证券 交易 所	美国	1,375.00	3,637,161.97	0.09
192	DOMINION ENERGY INC	-	D	美国 纽约 证券 交易 所	美国	7,786.00	3,607,358.95	0.09
193	KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	是德科技公司	KEYS	美国 纽约 证券 交易 所	美国	1,518.00	3,605,325.77	0.09
194	HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO	慧与公司	HPE	美国 纽约 证券 交易 所	美国	11,746.00	3,594,849.15	0.09
195	AIRBNB INC	爱彼迎股份有限公司	ABNB	纳斯 达克 证券 交易 所	美国	3,700.00	3,592,189.22	0.09
196	FLEX LTD	伟创力国际有限公司	FLEX	纳斯 达克 证券 交易 所	美国	3,255.00	3,579,080.54	0.09
197	TARGET CORP	塔吉特公司	TGT	美国 纽约 证券 交易 所	美国	4,021.00	3,563,102.77	0.09

198	DIGITAL REALTY TRUST INC	数字房地 产信托有 限公司	DLR	美国 纽约证 券交易 所	美国	2,924.00	3,562,486.13	0.09
199	WW GRAINGER INC	固安捷 股份有 限公司	GWV	美国 纽约证 券交易 所	美国	385.00	3,553,409.01	0.09
200	ARTHUR J GALLAGHER & CO	亚瑟加 拉格尔 有限公 司	AJG	美国 纽约证 券交易 所	美国	2,274.00	3,541,795.17	0.09
201	TE CONNECTIVITY PLC	-	TEL	美国 纽约证 券交易 所	美国	2,584.00	3,534,454.75	0.09
202	CINTAS CORP	信达思 公司	CTAS	纳斯 达克 证券 交易 所	美国	3,011.00	3,474,416.27	0.09
203	REALTY INCOME CORP	-	O	美国 纽约证 券交易 所	美国	8,255.00	3,470,134.70	0.09
204	TARGA RESOURCES CORP	-	TRGP	美国 纽约证 券交易 所	美国	1,900.00	3,456,472.08	0.09
205	CARRIER GLOBAL CORP	开利全 球公司	CARR	美国 纽约证 券交易 所	美国	6,912.00	3,439,708.93	0.09
206	CORTEVA INC	科迪华 公司	CTVA	美国 纽约证 券交易 所	美国	5,921.00	3,402,084.06	0.09

207	CARDINAL HEALTH INC	嘉德诺健康集团	CAH	美国 纽约 证券 交易 所	美国	2,073.00	3,341,107.62	0.08
208	AMETEK INC	阿美特克股份有限公司	AME	美国 纽约 证券 交易 所	美国	2,029.00	3,330,485.68	0.08
209	FASTENAL CO	法思诺公司	FAST	纳斯 达克 证券 交易 所	美国	10,163.00	3,311,710.45	0.08
210	ROCKWELL AUTOMATION INC	罗克韦尔自动化	ROK	美国 纽约 证券 交易 所	美国	985.00	3,308,487.21	0.08
211	BAKER HUGHES CO	贝克休斯公司	BKR	纳斯 达克 证券 交易 所	美国	8,782.00	3,306,772.08	0.08
212	CENCORA INC	-	COR	美国 纽约 证券 交易 所	美国	1,722.00	3,306,029.59	0.08
213	ONEOK INC	-	OKE	美国 纽约 证券 交易 所	美国	5,577.00	3,289,562.39	0.08
214	APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	阿波罗全球管理股份有限公司	APO	美国 纽约 证券 交易 所	美国	4,083.00	3,277,318.74	0.08
215	FORD MOTOR CO	福特汽车	F	美国 纽约 证券 交易 所	美国	34,648.00	3,267,464.05	0.08

216	L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	-	LHX	美国 纽约 证券 交易 所	美国	1,649.00	3,251,016.45	0.08
217	AFLAC INC	家庭人 寿保险 公司	AFL	美国 纽约 证券 交易 所	美国	4,055.00	3,225,682.04	0.08
218	AUTOZONE INC	-	AZO	美国 纽约 证券 交易 所	美国	146.00	3,165,696.82	0.08
219	ENTERGY CORP	-	ETR	美国 纽约 证券 交易 所	美国	4,054.00	3,159,151.13	0.08
220	EDWARDS LIFESCIENCES CORP	爱德华 生命科 学公司	EW	美国 纽约 证券 交易 所	美国	5,097.00	3,128,160.76	0.08
221	FIFTH THIRD BANCORP	五三银 行	FITB	美国 纽约 证券 交易 所	美国	8,023.00	3,068,334.29	0.08
222	NUCOR CORP	纽柯公 司	NUE	美国 纽约 证券 交易 所	美国	2,016.00	3,046,674.71	0.08
223	PUBLIC STORAGE	公共存 储	PSA	美国 纽约 证券 交易 所	美国	1,399.00	3,021,244.30	0.08
224	VISTRA CORP	-	VST	美国 纽约 证券 交易 所	美国	2,806.00	3,019,888.01	0.08

225	XCEL ENERGY INC	-	XEL	纳斯达克 证券 交易 所	美国	5,526.00	3,010,539.10	0.08
226	EBAY INC	-	EBAY	纳斯达克 证券 交易 所	美国	3,931.00	2,980,357.92	0.08
227	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	微芯科 技股份 有限公 司	MCHP	纳斯达克 证券 交易 所	美国	4,790.00	2,963,795.26	0.08
228	NIKE INC	耐克公 司	NKE	美国 纽约 证券 交易 所	美国	10,619.00	2,957,431.06	0.08
229	EXELON CORP	爱克斯 龙公司	EXC	纳斯 达克 证券 交易 所	美国	9,058.00	2,864,985.53	0.07
230	HUMANA INC	-	HUM	美国 纽约 证券 交易 所	美国	1,063.00	2,864,720.25	0.07
231	DEVON ENERGY CORP	戴文能 源	DVN	美国 纽约 证券 交易 所	美国	10,207.00	2,861,384.86	0.07
232	CARVANA CO	-	CVNA	美国 纽约 证券 交易 所	美国	6,341.00	2,831,610.26	0.07
233	STATE STREET CORP	道富集 团	STT	美国 纽约 证券 交易 所	美国	2,450.00	2,819,095.44	0.07

234	ELECTRONIC ARTS INC	艺电公司	EA	纳斯达克 证券交易 所	美国	1,994.00	2,773,841.20	0.07
235	WESTINGHOUSE AIR BRAKE TECHNOLOGIES CORP	西屋制 动公司	WAB	美国 纽约 证券交 易所	美国	1,502.00	2,747,310.00	0.07
236	METLIFE INC	大都会 集团	MET	美国 纽约 证券交 易所	美国	4,785.00	2,746,764.87	0.07
237	AXON ENTERPRISE INC	-	AXON	纳斯 达克 证券交 易所	美国	714.00	2,715,669.40	0.07
238	KEURIG DR PEPPER INC	克里格 胡椒博 士	KDP	纳斯 达克 证券交 易所	美国	12,045.00	2,674,672.77	0.07
239	UNITED AIRLINES HOLDINGS INC	美国联 合航空 控股股 份有限 公司	UAL	纳斯 达克 证券交 易所	美国	2,873.00	2,650,699.20	0.07
240	YUM! BRANDS INC	百胜餐 饮集团	YUM	美国 纽约 证券交 易所	美国	2,440.00	2,646,351.21	0.07
241	CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	-	CMG	美国 纽约 证券交 易所	美国	11,356.00	2,619,522.59	0.07
242	TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE INC	-	TTWO	纳斯 达克 证券交 易所	美国	1,541.00	2,613,519.53	0.07

243	VENTAS INC	-	VTR	美国 纽约 证券 交易 所	美国	4,304.00	2,593,003.33	0.07
244	DR HORTON INC	霍顿房 屋公司	DHI	美国 纽约 证券 交易 所	美国	2,335.00	2,580,313.61	0.07
245	REPUBLIC SERVICES INC	公共服 务公司	RSG	美国 纽约 证券 交易 所	美国	1,770.00	2,558,785.03	0.06
246	BECTON DICKINSON & CO	碧迪	BDX	美国 纽约 证券 交易 所	美国	2,439.00	2,504,117.36	0.06
247	IDEXX LABORATORIES INC	爱德士 股份有 限公司	IDXX	纳斯 达克 证券 交易 所	美国	698.00	2,492,999.26	0.06
248	AMERIPRISE FINANCIAL INC	阿默普 莱斯金 融公司	AMP	美国 纽约 证券 交易 所	美国	796.00	2,477,515.95	0.06
249	AUTODESK INC	欧特克 公司	ADSK	纳斯 达克 证券 交易 所	美国	1,869.00	2,465,290.41	0.06
250	CONSOLIDATED EDISON INC	联合爱 迪生	ED	美国 纽约 证券 交易 所	美国	3,262.00	2,448,356.84	0.06
251	MSCI INC	-	MSCI	美国 纽约 证券 交易 所	美国	644.00	2,446,936.85	0.06

252	BLOCK INC	-	XYZ	美国 纽约 证券 交易 所	美国	4,738.00	2,443,017.04	0.06
253	JABIL INC	捷普集团	JBL	美国 纽约 证券 交易 所	美国	934.00	2,442,679.98	0.06
254	PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GROUP INC	公共服 务企业 集团	PEG	美国 纽约 证券 交易 所	美国	4,411.00	2,428,829.02	0.06
255	SYSCO CORP	-	SY Y	美国 纽约 证券 交易 所	美国	4,233.00	2,400,316.34	0.06
256	OLD DOMINION FREIGHT LINE INC	奥多明 尼昂货 运	ODFL	纳斯 达克 证券 交易 所	美国	1,620.00	2,380,626.77	0.06
257	AMERICAN INTERNATIONAL GROUP INC	美国国 际集团	AIG	美国 纽约 证券 交易 所	美国	4,694.00	2,373,515.40	0.06
258	CBRE GROUP INC	世邦魏 理仕	CBRE	美国 纽约 证券 交易 所	美国	2,592.00	2,368,580.76	0.06
259	GARMIN LTD	佳明有 限公司	GRMN	美国 纽约 证券 交易 所	美国	1,451.00	2,338,417.28	0.06
260	INTERACTIVE BROKERS GROUP INC	盈透证 券集团 股份有 限公司	IBKR	纳斯 达克 证券 交易 所	美国	3,944.00	2,329,022.24	0.06

261	VULCAN MATERIALS CO	-	VMC	美国 纽约 证券 交易 所	美国	1,149.00	2,299,718.15	0.06
262	PAYPAL HOLDINGS INC	贝宝	PYPL	纳斯 达克 证券 交易 所	美国	7,809.00	2,287,683.33	0.06
263	WEC ENERGY GROUP INC	-	WEC	美国 纽约 证券 交易 所	美国	2,884.00	2,284,779.97	0.06
264	IRON MOUNTAIN INC	美国铁 山公司	IRM	美国 纽约 证券 交易 所	美国	2,634.00	2,257,206.81	0.06
265	AGILENT TECHNOLOGIES INC	安捷伦	A	美国 纽约 证券 交易 所	美国	2,502.00	2,254,765.21	0.06
266	PRUDENTIAL FINANCIAL INC	保德信 金融集 团	PRU	美国 纽约 证券 交易 所	美国	3,072.00	2,249,475.33	0.06
267	ON SEMICONDUCTOR CORP	安森美 半导体	ON	纳斯 达克 证券 交易 所	美国	3,469.00	2,225,039.60	0.06
268	PG&E CORP	太平洋 煤气电 力	PCG	美国 纽约 证券 交易 所	美国	19,496.00	2,224,791.69	0.06
269	EMCOR GROUP INC	埃姆科 集团公 司	EME	美国 纽约 证券 交易 所	美国	393.00	2,212,716.10	0.06

270	ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO		ADM	美国 纽约 证券 交易 所	美国	4,267.00	2,211,738.86	0.06
271	WATERS CORP	沃特世 公司	WAT	美国 纽约 证券 交易 所	美国	869.00	2,211,134.77	0.06
272	CARNIVAL CORP LTD	嘉年华 公司	CCL	美国 纽约 证券 交易 所	美国	11,388.00	2,207,372.08	0.06
273	KENVUE INC	科赴股 份有限 公司	KVUE	美国 纽约 证券 交易 所	美国	16,997.00	2,203,691.56	0.06
274	KIMBERLY-CLARK CORP	金佰利	KMB	纳斯 达克 证券 交易 所	美国	2,939.00	2,188,774.89	0.06
275	HARTFORD INSURANCE GROUP INC/THE	哈特福 德保险 集团股 份有限 公司	HIG	美国 纽约 证券 交易 所	美国	2,427.00	2,182,071.87	0.06
276	HUNTINGTON BANCSHARES INC/OH	俄亥俄 州亨廷 顿银行 控股公 司	HBAN	纳斯 达克 证券 交易 所	美国	17,945.00	2,158,589.42	0.05
277	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	西方石 油	OXY	美国 纽约 证券 交易 所	美国	6,428.00	2,118,174.90	0.05
278	NASDAQ INC	纳斯达 克股份 有限公 司	NDAQ	纳斯 达克 证券 交易 所	美国	3,955.00	2,114,953.22	0.05

279	M&T BANK CORP	-	MTB	美国 纽约 证券 交易 所	美国	1,296.00	2,092,753.38	0.05
280	MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	-	MLM	美国 纽约 证券 交易 所	美国	532.00	2,081,514.45	0.05
281	QNTITY ELECTRONICS INC	启诺迪 电子股 份有限 公司	Q	美国 纽约 证券 交易 所	美国	1,853.00	2,053,080.82	0.05
282	ROPER TECHNOLOGIES INC	儒博技 术公司	ROP	纳斯 达克 证券 交易 所	美国	893.00	2,050,155.61	0.05
283	DIAMONDBACK ENERGY INC	戴蒙德 巴克能 源	FANG	纳斯 达克 证券 交易 所	美国	1,718.00	2,048,851.43	0.05
284	ARCH CAPITAL GROUP LTD	阿契资 本集团	ACGL	纳斯 达克 证券 交易 所	美国	3,081.00	2,028,849.50	0.05
285	EQT CORP	-	EQT	美国 纽约 证券 交易 所	美国	5,537.00	1,997,372.34	0.05
286	CROWN CASTLE INC	冠城股 份有限 公司	CCI	美国 纽约 证券 交易 所	美国	3,864.00	1,985,285.27	0.05
287	COINBASE GLOBAL INC	-	COIN	纳斯 达克 证券 交易 所	美国	1,969.00	1,952,905.50	0.05

288	IQVIA HOLDINGS INC	艾昆纬	IQV	美国 纽约 证券 交易 所	美国	1,478.00	1,937,511.81	0.05
289	NORTHERN TRUST CORP	北美信 托	NTRS	纳斯 达克 证券 交易 所	美国	1,638.00	1,931,885.83	0.05
290	BIOGEN INC	渤健公 司	BIIB	纳斯 达克 证券 交易 所	美国	1,307.00	1,915,877.80	0.05
291	PAYCHEX INC	沛齐公 司	PAYX	纳斯 达克 证券 交易 所	美国	2,855.00	1,904,627.27	0.05
292	DTE ENERGY CO	-	DTE	美国 纽约 证券 交易 所	美国	1,842.00	1,904,175.36	0.05
293	KROGER CO/THE	克罗格 公司	KR	美国 纽约 证券 交易 所	美国	5,022.00	1,892,004.78	0.05
294	AMEREN CORP	-	AEE	美国 纽约 证券 交易 所	美国	2,450.00	1,878,953.71	0.05
295	STEEL DYNAMICS INC	-	STLD	纳斯 达克 证券 交易 所	美国	1,200.00	1,868,125.64	0.05
296	TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	-	TDY	美国 纽约 证券 交易 所	美国	410.00	1,855,079.05	0.05

297	NRG ENERGY INC	-	NRG	美国 纽约 证券 交易 所	美国	1,868.00	1,851,083.52	0.05
298	EXTRA SPACE STORAGE INC	-	EXR	美国 纽约 证券 交易 所	美国	1,870.00	1,843,423.28	0.05
299	NETAPP INC	美国网 域存储 技术有 限公司	NTAP	纳斯 达克 证券 交易 所	美国	1,747.00	1,834,296.23	0.05
300	DOVER CORP	都福	DOV	美国 纽约 证券 交易 所	美国	1,192.00	1,813,780.17	0.05
301	ZOETIS INC	硕腾股 份有限 公司	ZTS	美国 纽约 证券 交易 所	美国	3,711.00	1,809,239.30	0.05
302	CENTENE CORP	-	CNC	美国 纽约 证券 交易 所	美国	4,153.00	1,808,619.27	0.05
303	CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	公民金 融集团 股份有 限公司	CFG	美国 纽约 证券 交易 所	美国	3,744.00	1,779,859.84	0.05
304	TAPESTRY INC	-	TPR	美国 纽约 证券 交易 所	美国	1,789.00	1,776,682.93	0.05
305	CASEY'S GENERAL STORES INC	凯西杂 货公司	CASY	纳斯 达克 证券 交易 所	美国	327.00	1,763,266.65	0.04

306	EXPEDIA GROUP INC	亿客行 集团股份 有限公司	EXPE	纳斯 达克 证券 交易 所	美国	1,014.00	1,760,322.11	0.04
307	INGERSOLL RAND INC	英格索 兰股份 有限公司	IR	美国 纽约 证券 交易 所	美国	3,153.00	1,753,891.42	0.04
308	GE HEALTHCARE TECHNOLOGIES INC	-	GEHC	纳斯 达克 证券 交易 所	美国	4,027.00	1,748,828.83	0.04
309	VICI PROPERTIES INC	-	VICI	美国 纽约 证券 交易 所	美国	9,675.00	1,742,743.00	0.04
310	LIVE NATION ENTERTAINMENT INC	-	LYV	美国 纽约 证券 交易 所	美国	1,401.00	1,740,476.02	0.04
311	CENTERPOINT ENERGY INC	中点能 源	CNP	美国 纽约 证券 交易 所	美国	5,791.00	1,730,289.30	0.04
312	ATMOS ENERGY CORP	-	ATO	美国 纽约 证券 交易 所	美国	1,478.00	1,727,435.87	0.04
313	EDISON INTERNATIONAL	爱迪生 国际	EIX	美国 纽约 证券 交易 所	美国	3,406.00	1,720,391.12	0.04
314	CINCINNATI FINANCIAL CORP	辛辛那 提金融	CINF	纳斯 达克 证券 交易 所	美国	1,369.00	1,719,576.71	0.04

315	HALLIBURTON CO	哈利伯顿	HAL	美国 纽约 证券 交易 所	美国	7,395.00	1,703,318.27	0.04
316	RESMED INC	瑞思迈 股份有 限公司	RMD	美国 纽约 证券 交易 所	美国	1,284.00	1,697,657.75	0.04
317	XYLEM INC/NY	赛莱默 公司	XYL	美国 纽约 证券 交易 所	美国	2,104.00	1,687,399.05	0.04
318	FAIR ISAAC CORP	费埃哲 公司	FICO	美国 纽约 证券 交易 所	美国	205.00	1,661,726.91	0.04
319	HUBBELL INC	哈贝尔 公司	HUBB	美国 纽约 证券 交易 所	美国	468.00	1,661,236.39	0.04
320	OTIS WORLDWIDE CORP	奥的斯 电梯公 司	OTIS	美国 纽约 证券 交易 所	美国	3,397.00	1,650,161.37	0.04
321	WILLIAMS-SONOMA INC	-	WSM	美国 纽约 证券 交易 所	美国	1,042.00	1,647,888.56	0.04
322	PPL CORP	-	PPL	美国 纽约 证券 交易 所	美国	6,660.00	1,642,466.39	0.04
323	EVERSOURCE ENERGY	-	ES	美国 纽约 证券 交易 所	美国	3,329.00	1,632,261.35	0.04

324	PPG INDUSTRIES INC	-	PPG	美国 纽约 证券 交易 所	美国	1,973.00	1,623,565.93	0.04
325	VEEVA SYSTEMS INC	-	VEEV	美国 纽约 证券 交易 所	美国	1,329.00	1,600,176.09	0.04
326	RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	-	RJF	美国 纽约 证券 交易 所	美国	1,535.00	1,583,271.97	0.04
327	AVALONBAY COMMUNITIES INC	-	AVB	美国 纽约 证券 交易 所	美国	1,230.00	1,574,605.79	0.04
328	FISERV INC	-	FISV	纳斯 达克 证券 交易 所	美国	4,721.00	1,571,053.08	0.04
329	PULTEGROUP INC	-	PHM	美国 纽约 证券 交易 所	美国	1,686.00	1,569,499.50	0.04
330	HERSHEY CO/THE	好时公 司	HSY	美国 纽约 证券 交易 所	美国	1,312.00	1,561,726.77	0.04
331	DEXCOM INC	德康医 疗	DXCM	纳斯 达克 证券 交易 所	美国	3,416.00	1,560,893.63	0.04
332	METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL INC	梅特勒 -托利 多国际 股份有 限公	MTD	美国 纽约 证券 交易 所	美国	179.00	1,551,440.72	0.04

333	REGIONS FINANCIAL CORP	-	RF	美国 纽约 证券 交易 所	美国	7,555.00	1,547,958.30	0.04
334	AMERICAN WATER WORKS CO INC	美国自 来水股 份有限 公司	AWK	美国 纽约 证券 交易 所	美国	1,729.00	1,543,486.10	0.04
335	SYNCHRONY FINANCIAL	同步金 融公司	SYF	美国 纽约 证券 交易 所	美国	2,978.00	1,536,532.53	0.04
336	CBOE GLOBAL MARKETS INC	-	CBOE	芝加 哥期 权交 易所	美国	926.00	1,524,561.41	0.04
337	TEXAS PACIFIC LAND CORP	德克萨 斯州太 平洋土 地公司	TPL	美国 纽约 证券 交易 所	美国	513.00	1,523,183.48	0.04
338	DOLLAR GENERAL CORP	达乐公 司	DG	美国 纽约 证券 交易 所	美国	1,950.00	1,522,879.40	0.04
339	FIRST SOLAR INC	福思第 一太阳 能公司	FSLR	纳斯 达克 证券 交易 所	美国	951.00	1,522,427.96	0.04
340	WEST PHARMACEUTICAL SERVICES INC	西氏医 药服务 公司	WST	美国 纽约 证券 交易 所	美国	625.00	1,522,272.19	0.04
341	SOUTHWEST AIRLINES CO	西南航 空	LUV	美国 纽约 证券 交易 所	美国	4,327.00	1,509,512.85	0.04

342	COPART INC	科帕特公司	CPRT	纳斯达克 证券交易 所	美国	7,846.00	1,500,587.16	0.04
343	WORKDAY INC	-	WDAY	纳斯达克 证券交易 所	美国	1,803.00	1,497,496.96	0.04
344	FIRSTENERGY CORP	第一能源	FE	美国纽约 证券交易 所	美国	4,609.00	1,486,564.41	0.04
345	MODERNA INC	莫德纳公司	MRNA	纳斯达克 证券交易 所	美国	3,126.00	1,485,220.54	0.04
346	WILLIS TOWERS WATSON PLC	韦莱韬 睿惠悦公 共有限公 司	WTW	纳斯达克 证券交易 所	美国	836.00	1,482,449.34	0.04
347	T ROWE PRICE GROUP INC	普徠仕	TROW	纳斯达克 证券交易 所	美国	1,897.00	1,463,212.64	0.04
348	SMURFIT WESTROCK PLC	斯墨菲特·韦 斯特罗克集 团	SW	美国纽约 证券交易 所	美国	4,643.00	1,457,210.05	0.04
349	CMS ENERGY CORP	-	CMS	美国纽约 证券交易 所	美国	2,735.00	1,419,503.97	0.04
350	DARDEN RESTAURANTS INC	达登餐 饮公司	DRI	美国纽约 证券交易 所	美国	1,014.00	1,417,242.29	0.04

351	VERISK ANALYTICS INC	威瑞斯 克分析 公司	VRSK	纳斯 达克 证券 交易 所	美国	1,160.00	1,412,904.69	0.04
352	ARES MANAGEMENT CORP	阿瑞斯 管理公 司	ARES	美国 纽约 证券 交易 所	美国	1,867.00	1,409,926.09	0.04
353	QUEST DIAGNOSTICS INC	-	DGX	美国 纽约 证券 交易 所	美国	980.00	1,409,215.28	0.04
354	F5 INC	-	FFIV	纳斯 达克 证券 交易 所	美国	499.00	1,408,218.23	0.04
355	EQUITY RESIDENTIAL	公寓物 业权益 信托	EQR	美国 纽约 证券 交易 所	美国	3,018.00	1,390,908.93	0.04
356	LABCORP HOLDINGS INC	-	LH	美国 纽约 证券 交易 所	美国	726.00	1,379,153.16	0.04
357	CHURCH & DWIGHT CO INC	切迟杜 威股份 有限公司	CHD	美国 纽约 证券 交易 所	美国	2,098.00	1,378,978.39	0.04
358	NISOURCE INC	-	NI	美国 纽约 证券 交易 所	美国	4,244.00	1,369,127.03	0.03
359	CH ROBINSON WORLDWIDE INC	罗宾逊 全球物 流有限 公司	CHRW	纳斯 达克 证券 交易 所	美国	1,043.00	1,332,737.82	0.03

360	DOLLAR TREE INC	美元树公司	DLTR	纳斯达克 证券交易 所	美国	1,603.00	1,315,398.20	0.03
361	EXPAND ENERGY CORP	-	EXE	纳斯达克 证券交易 所	美国	2,118.00	1,310,361.18	0.03
362	CORPAY INC	-	CPAY	美国 纽约证 券交易 所	美国	579.00	1,309,159.71	0.03
363	VERALTO CORP	-	VLTO	美国 纽约证 券交易 所	美国	2,174.00	1,307,985.93	0.03
364	JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	-	JBHT	纳斯 达克 证券 交易 所	美国	659.00	1,294,037.33	0.03
365	EXPEDITORS INTERNATIONAL OF WASHINGTON INC	华盛顿 康捷国 际物流 公司	EXPD	美国 纽约证 券交易 所	美国	1,158.00	1,280,444.38	0.03
366	KEYCORP	-	KEY	美国 纽约证 券交易 所	美国	8,159.00	1,275,926.65	0.03
367	PRINCIPAL FINANCIAL GROUP INC	信安金 融	PFG	纳斯 达克 证券 交易 所	美国	1,740.00	1,272,346.13	0.03
368	PACKAGING CORP OF AMERICA	美国包 装公司	PKG	美国 纽约证 券交易 所	美国	784.00	1,267,422.76	0.03

369	SNAP-ON INC	实耐宝	SNA	美国 纽约 证券 交易 所	美国	459.00	1,253,108.01	0.03
370	OMNICOM GROUP INC	-	OMC	美国 纽约 证券 交易 所	美国	2,523.00	1,246,652.49	0.03
371	W R BERKLEY CORP	-	WRB	美国 纽约 证券 交易 所	美国	2,604.00	1,246,042.08	0.03
372	STERIS PLC	思泰瑞 医疗公 共有限 公司	STE	美国 纽约 证券 交易 所	美国	868.00	1,240,035.36	0.03
373	VERISIGN INC	威瑞信 股份有 限公司	VRSN	纳斯 达克 证券 交易 所	美国	725.00	1,237,363.89	0.03
374	INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCES INC	国际香 料	IFF	美国 纽约 证券 交易 所	美国	2,260.00	1,214,677.88	0.03
375	INTERNATIONAL PAPER CO	国际纸 业	IP	美国 纽约 证券 交易 所	美国	4,688.00	1,211,798.54	0.03
376	KRAFT HEINZ CO/THE	卡夫亨 氏公司	KHC	纳斯 达克 证券 交易 所	美国	7,558.00	1,211,168.67	0.03
377	FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES INC	繁德信 息技术 有限公 司	FIS	美国 纽约 证券 交易 所	美国	4,576.00	1,207,063.50	0.03

378	HP INC	惠普	HPQ	美国 纽约 证券 交易 所	美国	8,096.00	1,205,105.23	0.03
379	AMCOR PLC	安姆科 公共有 限公司	AMCR	美国 纽约 证券 交易 所	美国	4,093.00	1,203,784.35	0.03
380	EVERGY INC	-	EVERG	纳斯 达克 证券 交易 所	美国	2,041.00	1,196,810.43	0.03
381	DOW INC	陶氏公 司	DOW	美国 纽约 证券 交易 所	美国	6,380.00	1,184,280.61	0.03
382	ALLIANT ENERGY CORP	-	LNT	纳斯 达克 证券 交易 所	美国	2,286.00	1,183,209.61	0.03
383	ULTA BEAUTY INC	-	ULTA	纳斯 达克 证券 交易 所	美国	386.00	1,181,034.09	0.03
384	ESTEE LAUDER COS INC/THE	雅诗兰 黛	EL	美国 纽约 证券 交易 所	美国	2,189.00	1,172,507.81	0.03
385	LENNAR CORP	莱纳公 司	LEN	美国 纽约 证券 交易 所	美国	1,905.00	1,169,535.52	0.03
386	CONSTELLATION BRANDS INC	星座品 牌股份 有限公 司	STZ	美国 纽约 证券 交易 所	美国	1,235.00	1,165,415.29	0.03

387	LOEWS CORP	罗斯公司	L	美国 纽约 证券 交易 所	美国	1,494.00	1,147,501.43	0.03
388	INCYTE CORP	因赛特公司	INCY	纳斯 达克 证券 交易 所	美国	1,486.00	1,142,869.11	0.03
389	EQUIFAX INC	-	EFX	美国 纽约 证券 交易 所	美国	1,054.00	1,134,984.98	0.03
390	ESSEX PROPERTY TRUST INC	埃塞克斯 房地 产信 托公 司	ESS	美国 纽约 证券 交易 所	美国	569.00	1,125,648.35	0.03
391	SBA COMMUNICATIONS CORP	-	SBAC	纳斯 达克 证券 交易 所	美国	939.00	1,124,164.10	0.03
392	BROWN & BROWN INC	-	BRO	美国 纽约 证券 交易 所	美国	2,581.00	1,123,317.47	0.03
393	FORTIVE CORP	福迪威公司	FTV	美国 纽约 证券 交易 所	美国	2,699.00	1,118,641.32	0.03
394	GENERAL MILLS INC	通用磨坊	GIS	美国 纽约 证券 交易 所	美国	4,724.00	1,115,339.23	0.03
395	DUPONT DE NEMOURS INC	杜邦公司	DD	美国 纽约 证券 交易 所	美国	1,210.00	1,113,501.99	0.03

396	VIATRIS INC	晖致	VTRS	纳斯达克 证券 交易 所	美国	10,309.00	1,110,669.60	0.03
397	NVR INC	-	NVR	美国 纽约 证券 交易 所	美国	24.00	1,109,412.30	0.03
398	COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORP	高知特 科技解 决方案 公司	CTSH	纳斯 达克 证 券 交 易 所	美国	4,195.00	1,102,293.66	0.03
399	LENNOX INTERNATIONAL INC	雷诺士 国际有 限公司	LII	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	280.00	1,088,410.20	0.03
400	CDW CORP/DE	-	CDW	纳斯 达克 证 券 交 易 所	美国	1,131.00	1,079,168.62	0.03
401	WEYERHAEUSER CO	惠好	WY	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	6,383.00	1,036,732.80	0.03
402	GENERAC HOLDINGS INC	-	GNRC	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	521.00	1,035,002.68	0.03
403	AKAMAI TECHNOLOGIES INC	阿卡迈 技术公 司	AKAM	纳斯 达克 证 券 交 易 所	美国	1,287.00	1,032,168.52	0.03
404	KIMCO REALTY CORP	-	KIM	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	5,970.00	1,026,762.84	0.03

405	FOX CORP	福克斯公司	FOXA	纳斯达克 证券交易 所	美国	1,766.00	624,951.23	0.02
			FOX	纳斯达克 证券交易 所	美国	1,231.00	391,194.54	0.01
406	GLOBAL PAYMENTS INC	环汇有限公司	GPN	美国 纽约证 券交易 所	美国	2,058.00	1,013,119.07	0.03
407	IDEX CORP	艺达思集团	IEX	美国 纽约证 券交易 所	美国	655.00	1,008,531.19	0.03
408	ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	捷迈邦美控股股份有限公司	ZBH	美国 纽约证 券交易 所	美国	1,713.00	1,000,524.94	0.03
409	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	-	CF	美国 纽约证 券交易 所	美国	1,360.00	998,906.36	0.03
410	BALL CORP	波尔	BALL	美国 纽约证 券交易 所	美国	2,357.00	997,842.55	0.03
411	TRACTOR SUPPLY CO	拖拉机供应公司	TSCO	纳斯 达克 证券 交易 所	美国	4,643.00	995,728.70	0.03
412	INVITATION HOMES INC	邀请家园公司	INVH	美国 纽约证 券交易 所	美国	4,838.00	991,595.25	0.03

413	SUPER MICRO COMPUTER INC	超微电脑	SMCI	纳斯达克证券交易所	美国	4,982.00	991,365.12	0.03
414	MASCO CORP	马斯可	MAS	美国纽约证券交易所	美国	1,786.00	985,969.81	0.03
415	FEDEX FREIGHT HOLDING CO INC	联邦快递货运控股股份有限公司	FDXF	美国纽约证券交易所	美国	962.00	985,530.04	0.03
416	GENUINE PARTS CO	原配部件	GPC	美国纽约证券交易所	美国	1,218.00	974,930.21	0.02
417	MID-AMERICA APARTMENT COMMUNITIES INC	-	MAA	美国纽约证券交易所	美国	1,030.00	970,917.58	0.02
418	TYSON FOODS INC	泰森食品公司	TSN	美国纽约证券交易所	美国	2,498.00	970,254.74	0.02
419	NORDSON CORP	诺信公司	NDSN	纳斯达克证券交易所	美国	469.00	959,956.61	0.02
420	TEXTRON INC	德事隆	TXT	美国纽约证券交易所	美国	1,539.00	957,784.62	0.02
421	ALBEMARLE CORP	雅保公司	ALB	美国纽约证券交易所	美国	1,044.00	956,419.92	0.02

422	BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS INC	布罗德里奇金融解决方案股份有	BR	美国纽约证券交易所	美国	1,024.00	951,436.57	0.02
423	RALPH LAUREN CORP	拉夫劳伦	RL	美国纽约证券交易所	美国	342.00	931,391.22	0.02
424	HOST HOTELS & RESORTS INC	-	HST	纳斯达克证券交易所	美国	5,639.00	907,092.33	0.02
425	JACOBS SOLUTIONS INC	嘉科解决方案股份有限公司	J	美国纽约证券交易所	美国	1,045.00	893,315.12	0.02
426	BEST BUY CO INC	百思买	BBY	美国纽约证券交易所	美国	1,735.00	893,191.64	0.02
427	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	-	DOC	美国纽约证券交易所	美国	6,103.00	886,084.19	0.02
428	STANLEY BLACK & DECKER INC	史丹利百得公司	SWK	美国纽约证券交易所	美国	1,376.00	878,654.62	0.02
429	BUNGE GLOBAL SA	-	BG	美国纽约证券交易所	美国	1,202.00	870,379.84	0.02
430	EVEREST GROUP LTD	-	EG	美国纽约证券交易所	美国	350.00	848,269.43	0.02

431	DECKERS OUTDOOR CORP	德克斯 户外用 品公司	DECK	美国 纽约 证券 交易 所	美国	1,257.00	846,756.69	0.02
432	COOPER COS INC/THE	库柏股 份有限 公司	COO	纳斯 达克 证券 交易 所	美国	1,727.00	840,213.99	0.02
433	GLOBE LIFE INC	-	GL	美国 纽约 证券 交易 所	美国	687.00	832,818.81	0.02
434	ECHOSTAR CORP	回声星 通信公 司	ECHO	纳斯 达克 证券 交易 所	美国	1,206.00	830,483.86	0.02
435	LAS VEGAS SANDS CORP	拉斯维 加斯金 沙公司	LVS	美国 纽约 证券 交易 所	美国	2,640.00	827,312.79	0.02
436	GEN DIGITAL INC	-	GEN	纳斯 达克 证券 交易 所	美国	4,879.00	823,898.21	0.02
437	LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	利安德 巴塞尔 工业公 司	LYB	美国 纽约 证券 交易 所	美国	2,286.00	816,568.17	0.02
438	ASSURANT INC	安信龙 集团	AIZ	美国 纽约 证券 交易 所	美国	439.00	799,788.54	0.02
439	REGENCY CENTERS CORP	-	REG	纳斯 达克 证券 交易 所	美国	1,459.00	789,313.21	0.02

440	PTC INC	-	PTC	纳斯达克 证券交易 所	美国	1,023.00	788,515.15	0.02
441	APTIV PLC	安波福 公共有 限公司	APTIV	美国 纽约 证券交 易所	美国	1,873.00	779,978.28	0.02
442	PINNACLE WEST CAPITAL CORP	-	PNW	美国 纽约 证券交 易所	美国	1,073.00	778,935.23	0.02
443	LEIDOS HOLDINGS INC	-	LDOS	美国 纽约 证券交 易所	美国	1,114.00	778,240.36	0.02
444	MCCORMICK & CO INC/MD	味好美 股份有 限公司/ 马里兰 州	MKC	美国 纽约 证券交 易所	美国	2,248.00	768,983.45	0.02
445	TKO GROUP HOLDINGS INC	-	TKO	美国 纽约 证券交 易所	美国	557.00	760,743.75	0.02
446	ZEBRA TECHNOLOGIES CORP	斑马技 术公司	ZBRA	纳斯 达克 证券交 易所	美国	422.00	753,728.91	0.02
447	NEWS CORP	新闻集 团	NWSA	纳斯 达克 证券交 易所	美国	3,230.00	544,123.01	0.01
			NWS	纳斯 达克 证券交 易所	美国	1,067.00	203,128.07	0.01

448	REVVITY INC	-	RVTY	美国 纽约 证券 交易 所	美国	988.00	745,785.35	0.02
449	AVERY DENNISON CORP	艾利丹 尼森	AVY	美国 纽约 证券 交易 所	美国	677.00	745,690.84	0.02
450	PENTAIR PLC	-	PNR	美国 纽约 证券 交易 所	美国	1,431.00	744,262.77	0.02
451	TYLER TECHNOLOGIES INC	-	TYL	美国 纽约 证券 交易 所	美国	373.00	740,104.69	0.02
452	ROLLINS INC	-	ROL	美国 纽约 证券 交易 所	美国	2,600.00	736,281.08	0.02
453	ALLEGION PLC	安朗杰 公共有 限公司	ALLE	美国 纽约 证券 交易 所	美国	761.00	725,350.50	0.02
454	J M SMUCKER CO/THE	-	SJM	美国 纽约 证券 交易 所	美国	944.00	720,513.90	0.02
455	LULULEMON ATHLETICA INC	露露乐 蒙	LULU	纳斯 达克 证券 交易 所	美国	927.00	718,104.45	0.02
456	TRIMBLE INC	天宝股 份有限 公司	TRMB	纳斯 达克 证券 交易 所	美国	2,064.00	716,684.19	0.02

457	CHARTER COMMUNICATIONS INC	特许通讯公司	CHTR	纳斯达克证券交易所	美国	740.00	713,969.57	0.02
458	UDR INC	-	UDR	美国纽约证券交易所	美国	2,617.00	708,781.06	0.02
459	INVESCO LTD	景顺有限公司	IVZ	美国纽约证券交易所	美国	3,924.00	702,564.56	0.02
460	COSTAR GROUP INC	科斯塔集团	CSGP	纳斯达克证券交易所	美国	3,615.00	694,575.40	0.02
461	CLOROX CO/THE	高乐氏公司	CLX	美国纽约证券交易所	美国	1,070.00	692,838.57	0.02
462	APA CORP	-	APA	纳斯达克证券交易所	美国	3,129.00	691,418.78	0.02
463	CAMDEN PROPERTY TRUST	-	CPT	美国纽约证券交易所	美国	890.00	691,314.09	0.02
464	SOLVENTUM CORP	索尔文图姆公司	SOLV	美国纽约证券交易所	美国	1,303.00	682,021.70	0.02
465	ALIGN TECHNOLOGY INC	-	ALGN	纳斯达克证券交易所	美国	590.00	675,121.52	0.02

466	GODADDY INC	-	GDDY	美国 纽约 证券 交易 所	美国	1,172.00	674,917.72	0.02
467	HASBRO INC	孩之宝	HAS	纳斯 达克 证券 交易 所	美国	1,190.00	666,794.91	0.02
468	BIO-TECHNE CORP	-	TECH	纳斯 达克 证券 交易 所	美国	1,386.00	664,344.35	0.02
469	BAXTER INTERNATIONAL INC	百特	BAX	美国 纽约 证券 交易 所	美国	4,572.00	661,319.41	0.02
470	CHARLES RIVER LABORATORIES INTERNATIONAL INC	查理斯 河实验 室国际 有限公司	CRL	美国 纽约 证券 交易 所	美国	426.00	655,467.78	0.02
471	INSULET CORP	-	PODD	纳斯 达克 证券 交易 所	美国	613.00	633,192.30	0.02
472	AES CORP/THE	爱伊斯 公司	AES	美国 纽约 证券 交易 所	美国	6,313.00	627,895.84	0.02
473	FRANKLIN RESOURCES INC	富兰克 林资源	BEN	美国 纽约 证券 交易 所	美国	2,714.00	612,604.93	0.02
474	SKYWORKS SOLUTIONS INC	思佳讯 解决方 案公司	SWKS	纳斯 达克 证券 交易 所	美国	1,331.00	612,245.49	0.02

475	BXP INC	波士顿 地产公 司	BXP	美国 纽约 证券 交易 所	美国	1,313.00	590,692.70	0.02
476	JACK HENRY & ASSOCIATES INC	-	JKHY	纳斯 达克 证券 交易 所	美国	629.00	587,798.63	0.01
477	FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST	联邦房 地产投 资信托 公司	FRT	美国 纽约 证券 交易 所	美国	696.00	582,885.16	0.01
478	NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDINGS LTD	挪威邮 轮控股 有限公司	NCLH	美国 纽约 证券 交易 所	美国	4,064.00	582,049.31	0.01
479	BUILDERS FIRSTSOURCE INC	-	BLDR	美国 纽约 证券 交易 所	美国	952.00	577,937.36	0.01
480	MGM RESORTS INTERNATIONAL	美高梅 国际酒 店集团	MGM	美国 纽约 证券 交易 所	美国	1,699.00	551,099.44	0.01
481	DOMINO'S PIZZA INC	达美乐 披萨公 司	DPZ	纳斯 达克 证券 交易 所	美国	271.00	544,299.00	0.01
482	GARTNER INC	-	IT	美国 纽约 证券 交易 所	美国	593.00	521,488.29	0.01
483	FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	-	FDS	美国 纽约 证券 交易 所	美国	323.00	504,195.82	0.01

484	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC	亚历山 大房地 产股份 有限公司	ARE	美国 纽约 证券 交易 所	美国	1,388.00	497,682.43	0.01
485	WYNN RESORTS LTD	永利渡 假村有 限公司	WYNN	纳斯 达克 证券 交易 所	美国	742.00	488,760.67	0.01
486	HENRY SCHEIN INC	亨利香 恩公司	HSIC	纳斯 达克 证券 交易 所	美国	857.00	485,611.71	0.01
487	UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	-	UHS	美国 纽约 证券 交易 所	美国	472.00	476,147.61	0.01
488	TRADE DESK INC/THE	-	TTD	纳斯 达克 证券 交易 所	美国	3,780.00	463,669.01	0.01
489	HORMEL FOODS CORP	荷美尔 食品有 限公司	HRL	美国 纽约 证券 交易 所	美国	2,582.00	434,786.31	0.01
490	DAVITA INC	-	DVA	美国 纽约 证券 交易 所	美国	284.00	428,674.02	0.01
491	A O SMITH CORP	-	AOS	美国 纽约 证券 交易 所	美国	991.00	421,694.13	0.01
492	MOSAIC CO/THE	-	MOS	美国 纽约 证券 交易 所	美国	2,814.00	404,550.64	0.01

493	MOLSON COORS BEVERAGE CO	莫尔森库尔斯饮料公司	TAP	美国纽约证券交易所	美国	1,420.00	375,340.25	0.01
494	ERIE INDEMNITY CO	伊利赔偿公司	ERIE	纳斯达克证券交易所	美国	225.00	365,981.37	0.01
495	BROWN-FORMAN CORP	百富门公司	BF/B	美国纽约证券交易所	美国	1,490.00	269,402.32	0.01
496	PARAMOUNT SKYDANCE CORP	-	PSKY	纳斯达克证券交易所	美国	2,792.00	186,771.31	0.00

注：所用证券代码采用当地市场代码。

7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	MARVELL TECHNOLOGY INC	MRVL	16,272,769.57	0.46
2	NVIDIA CORP	NVDA	15,055,856.68	0.43
3	ALPHABET INC	GOOGL	7,155,491.82	0.20
		GOOG	6,406,706.51	0.18
4	APPLE INC	AAPL	12,774,073.85	0.36
5	MICROSOFT CORP	MSFT	9,769,952.26	0.28
6	AMAZON.COM INC	AMZN	7,646,346.68	0.22
7	VERTIV HOLDINGS CO	VRT	6,026,075.63	0.17
8	BROADCOM INC	AVGO	5,712,603.85	0.16
9	META PLATFORMS INC	META	4,718,438.29	0.13
10	HONEYWELL AEROSPACE INC	HONA	4,195,654.82	0.12

11	TESLA INC	TSLA	3,628,045.21	0.10
12	LUMENTUM HOLDINGS INC	LITE	3,425,303.38	0.10
13	FLEX LTD	FLEX	3,249,256.87	0.09
14	COHERENT CORP	COHR	3,116,713.91	0.09
15	DEVON ENERGY CORP	DVN	2,965,010.12	0.08
16	BERKSHIRE HATHAWAY INC	BRK/B	2,832,386.20	0.08
17	JPMORGAN CHASE & CO	JPM	2,636,780.48	0.08
18	ELI LILLY & CO	LLY	2,565,677.47	0.07
19	CIENA CORP	CIEN	2,435,022.26	0.07
20	MICRON TECHNOLOGY INC	MU	2,069,588.49	0.06

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

7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	APPLE INC	AAPL	2,175,398.94	0.06
2	NVIDIA CORP	NVDA	2,026,047.63	0.06
3	DEVON ENERGY CORP	DVN	1,459,810.00	0.04
4	COTERRA ENERGY INC	CTRA	1,436,142.14	0.04
5	SALESFORCE INC	CRM	1,286,316.30	0.04
6	HOLOGIC INC	HOLX	1,000,113.16	0.03
7	JPMORGAN CHASE & CO	JPM	949,887.93	0.03
8	EXXON MOBIL CORP	XOM	777,709.95	0.02
9	MICROSOFT CORP	MSFT	705,876.16	0.02
10	CITIGROUP INC	C	677,362.37	0.02
11	BANK OF AMERICA CORP	BAC	664,780.63	0.02
12	DAYFORCE INC	DAY	661,344.98	0.02
13	VISA INC	V	652,849.36	0.02
14	ALPHABET INC	GOOGL	356,591.54	0.01
		GOOG	208,707.87	0.01
15	MASTERCARD INC	MA	473,132.94	0.01

16	CATERPILLAR INC	CAT	467,215.21	0.01
17	MATCH GROUP INC	MTCH	435,054.47	0.01
18	WELLS FARGO & CO	WFC	427,233.61	0.01
19	MOLINA HEALTHCARE INC	MOH	425,084.65	0.01
20	CONAGRA BRANDS INC	CAG	403,340.24	0.01

注：“卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	248,463,871.99
卖出收入（成交）总额	40,156,598.76

注：“买入成本”、“卖出收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

金额单位：人民币元

序号	衍生品类别	衍生品名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	股指期货	S&P500 EMINI FUT Sep26	-	-
2	-	-	-	-
3	-	-	-	-
4	-	-	-	-
5	-	-	-	-

注：期货投资采用当日无负债结算制度，公允价值变动金额为 967,773.62 元，已包含在结算备付金中。

7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

7.11 投资组合报告附注

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

7.11.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同约定的备选股票库。

7.11.3 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	8,410,931.43
2	应收清算款	2,972.42
3	应收股利	1,562,381.45
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	9,976,285.30

7.11.4 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。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.11.6 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		华夏标普 500ETF 发起式联 接（QDII）	
		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

38,101	55,776.57	833,571,623.00	39.22%	1,053,026,923.00	49.55%	238,544,499.00	11.22%
--------	-----------	----------------	--------	------------------	--------	----------------	--------

注：本章节持有人户数合计按份额级别汇总，未予以合并剔重。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	3,200.00	0.00%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2022 年 10 月 12 日）基金份额总额	205,143,045.00
本报告期期初基金份额总额	2,012,143,045.00
本报告期基金总申购份额	113,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	-
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	2,125,143,045.00

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，基金托管人无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期未发生影响基金管理人经营或公募基金运营业务的诉讼。

本报告期内，无涉及基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金所聘用的会计师事务所未发生改变。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人未受到调查或处罚。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人相关从业人员未受到调查或处罚。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的基金托管业务不涉及受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人相关从业人员没有受到监管部门调查或处罚。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
China Merchants Securities HK Co Ltd	-	147,091,024.46	52.96%	14,760.53	51.62%	-
CLSA	-	113,486,881.53	40.86%	11,360.33	39.73%	-
MERRILL LYNCH	-	17,162,525.93	6.18%	2,472.38	8.65%	-

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，本基金还选择了财通证券、长江证券、第一创业证券、东北证券、东吴证券、方正证券、光大证券、广发证券、国海证券、国金证券、国联民生证券、国泰海通证券、国信证券、华泰证券、华西证券、江海证券、金元证券、联储证券、平安证券、上海证券、申万宏源证券、西部证券、兴业证券、招商证券、中金公司、中泰证券、中信建投证券、中信证券的交易单元作为本基金交易单元，本报告期无股票交易及应付佣金。

⑤本报告期内，本基金租用的券商交易单元未发生变更。

⑥此处股票交易含股票、存托凭证及信托凭证交易，佣金指基金通过单一券商进行股票、基金等交易而合计支付该券商的佣金合计。

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
China Merchants Securities HK Co Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-
CLSA	-	-	-	-	-	-	-	-
MERRILL LYNCH	-	-	-	-	-	-	-	-

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	华夏标普 500 交易型开放式指数证券投资	中国证监会规定报刊及	2026-01-06

	基金（QDII）二级市场交易价格溢价风险提示公告	网站	
2	华夏标普 500 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）暂停申购、赎回业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-01-14
3	华夏标普 500 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）暂停申购、赎回业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-03-31
4	华夏标普 500 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）暂停申购、赎回业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-05-20
5	华夏标普 500 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）二级市场交易价格溢价风险提示公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-06-02
6	华夏标普 500 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）二级市场交易价格溢价风险提示公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-06-16
7	华夏标普 500 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）暂停申购、赎回业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-06-30

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予基金注册的文件；
- 2、基金合同；
- 3、托管协议；
- 4、法律意见书；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照。

12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

12.3 查阅方式

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

二〇二六年八月三十一日