

华夏沪深 300 指数增强型证券投资基金

2026 年第 2 季度报告

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：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二六年七月二十一日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 7 月 17 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华夏沪深 300 指数增强		
基金主代码	001015		
交易代码	001015		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2015 年 2 月 10 日		
报告期末基金份额总额	1,604,207,187.60 份		
投资目标	通过量化方法进行积极的投资组合管理与风险控制，力争在控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的年跟踪误差不超过 7.75%的基础上，追求获得超越标的指数的回报。		
投资策略	主要投资策略包括股票投资策略、债券投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略等。在股票投资策略上，本基金为指数增强型基金，以沪深 300 指数为标的指数，基金股票投资方面将主要采用指数增强量化投资策略，在严格控制跟踪误差的基础上，力求获得超越标的指数的超额收益。		
业绩比较基准	本基金业绩比较基准=95%×沪深 300 指数收益率+1.5%（指年收益率，评价时按期间折算）。		
风险收益特征	本基金为股票指数增强型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种，其预期风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。		
基金管理人	华夏基金管理有限公司		
基金托管人	中国农业银行股份有限公司		
下属分级基金的基金简称	华夏沪深 300 指数增强 A	华夏沪深 300 指数增强 C	华夏沪深 300 指数增强 Y
下属分级基金的交易代码	001015	001016	022954
报告期末下属分级基金的份额总额	982,904,291.19 份	609,318,715.88 份	11,984,180.53 份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期 (2026 年 4 月 1 日-2026 年 6 月 30 日)		
	华夏沪深 300 指数增强 A	华夏沪深 300 指数增强 C	华夏沪深 300 指数增强 Y
1.本期已实现收益	83,193,234.71	45,321,934.02	978,906.47

2.本期利润	357,904,813.55	202,549,062.31	3,997,440.73
3.加权平均基金份额本期利润	0.3467	0.3256	0.3480
4.期末基金资产净值	2,421,481,791.23	1,417,711,523.35	29,808,109.61
5.期末基金份额净值	2.464	2.327	2.487

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本基金自 2024 年 12 月 13 日增加 Y 类基金份额类别。

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

华夏沪深 300 指数增强 A：

阶段	净值增长率 ①	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	15.90%	1.23%	11.71%	1.19%	4.19%	0.04%
过去六个月	11.75%	1.10%	8.00%	1.07%	3.75%	0.03%
过去一年	30.23%	0.96%	26.83%	0.97%	3.40%	-0.01%
过去三年	46.23%	1.08%	33.10%	1.06%	13.13%	0.02%
过去五年	13.71%	1.10%	3.95%	1.06%	9.76%	0.04%
过去七年	74.88%	1.16%	40.34%	1.11%	34.54%	0.05%
过去十年	129.42%	1.13%	71.66%	1.09%	57.76%	0.04%
自基金合同生 效起至今	146.40%	1.32%	65.39%	1.27%	81.01%	0.05%

华夏沪深 300 指数增强 C：

阶段	净值增长率 ①	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	15.77%	1.23%	11.71%	1.19%	4.06%	0.04%
过去六个月	11.45%	1.10%	8.00%	1.07%	3.45%	0.03%
过去一年	29.57%	0.96%	26.83%	0.97%	2.74%	-0.01%
过去三年	44.09%	1.08%	33.10%	1.06%	10.99%	0.02%

过去五年	10.86%	1.10%	3.95%	1.06%	6.91%	0.04%
过去七年	68.87%	1.16%	40.34%	1.11%	28.53%	0.05%
过去十年	118.29%	1.13%	71.66%	1.09%	46.63%	0.04%
自基金合同生效起至今	132.70%	1.32%	65.39%	1.27%	67.31%	0.05%

华夏沪深 300 指数增强 Y:

阶段	净值增长率 ①	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	16.05%	1.23%	11.71%	1.19%	4.34%	0.04%
过去六个月	12.03%	1.10%	8.00%	1.07%	4.03%	0.03%
过去一年	31.03%	0.96%	26.83%	0.97%	4.20%	-0.01%
自新增份额类 别以来至今	35.83%	0.95%	27.83%	0.96%	8.00%	-0.01%

注：本基金自 2024 年 12 月 13 日增加 Y 类基金份额类别。

3.2.2 自基金合同生效以来基金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 指数增强型证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2015 年 2 月 10 日至 2026 年 6 月 30 日)

华夏沪深 300 指数增强 A:



华夏沪深 300 指数增强 C:



华夏沪深 300 指数增强 Y:



注：本基金自 2024 年 12 月 13 日增加 Y 类基金份额类别。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		

袁英杰	本基金的基金 经理、投委 会成员	2021-09-27	-	20 年	硕士。曾任兴业证券股份有限公司研究员，上海申银万国证券研究所有限公司分析师，申万菱信基金管理有限公司高级数量研究员、基金经理助理、申万菱信中证军工指数分级证券投资基金基金经理、申万菱信中证环保产业指数分级证券投资基金基金经理、申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金基金经理、申万菱信中小板指数证券投资基金（LOF）基金经理、申万菱信深证成指分级证券投资基金基金经理、申万菱信中证申万电子行业投资指数分级证券投资基金基金经理、申万菱信中证申万传媒行业投资指数分级证券投资基金基金经理、申万菱信中证申万医药生物指数分级证券投资基金基金经
-----	------------------------	------------	---	------	---

				理、申万菱信 中证申万新兴 健康产业主题 投资指数证券 投资基金 (LOF) 基金 经理、申万菱 信沪深 300 指 数增强型证券 投资基金基金 经理、申万菱 信中证 500 指 数优选增强型 证券投资基金 基金经理、申 万菱信臻选 6 个月定期开放 混合型证券投 资基金基金经 理、申万菱信 智选一年期定 期开放混合型 证券投资基金 基金经理、申 万菱信中证 500 指数增强 型证券投资基金 基金经理、 申万菱信价值 优利混合型证 券投资基金基 金经理、申万 菱信价值优先 混合型证券投 资基金基金经 理、申万菱信 量化小盘股票 型证券投资基金 (LOF) 基 金经理、申万 菱信量化对冲 策略灵活配置 混合型发起式 证券投资基金 基金经理。
--	--	--	--	---

					2020 年 5 月加入华夏基金管理有限公司。曾任投资经理。
--	--	--	--	--	--------------------------------

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。

4.1.1 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
袁英杰	公募基金	3	4,643,948,659.34	2021-09-27
	私募资产管理计划	1	94,344,219.47	2022-09-07
	其他组合	-	-	-
	合计	4	4,738,292,878.81	

注：报告期内，袁英杰管理的 1 个私募资产管理计划已于 2026 年 6 月 29 日终止。

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 公平交易专项说明

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，本公司严格执行了《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 20 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 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，业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率 $\times$ 95%+1.5%（指年收益率，评价时应按期间折算）。本基金股票投资方面主要采用指数增强量化投资策略，在严格控制跟踪误差的基础上，力求获得超越标的指数的超额收益。

二季度，A 股市场震荡上涨，科技主题行情明显。行业方面，电子、通信、建筑材料等科技成长相关行业表现较好，而农林牧渔、石油石化、美容护理等行业表现较差。市场风格方面，成长、动量等因子表现较好，估值、反转等因子表现较差，期间量化策略表现较好。

基金投资运作方面，报告期内本基金以多因子量化投资策略为主，本基金净值表现领先业绩基准，并有效地控制本基金的跟踪误差。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2026 年 6 月 30 日，华夏沪深 300 指数增强 A 基金份额净值为 2.464 元，本报告期份额净值增长率为 15.90%；华夏沪深 300 指数增强 C 基金份额净值为 2.327 元，本报告期份额净值增长率为 15.77%；华夏沪深 300 指数增强 Y 基金份额净值为 2.487 元，本报告期份额净值增长率为 16.05%，同期业绩比较基准增长率为 11.71%。本基金本报告期 A 类份额跟踪偏离度为+4.19%，C 类份额跟踪偏离度为+4.06%，Y 类份额跟踪偏离度为+4.34%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	3,622,105,394.80	93.12
	其中：股票	3,622,105,394.80	93.12
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	247,103,533.62	6.35
8	其他各项资产	20,529,795.16	0.53
9	合计	3,889,738,723.58	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

5.2.1.1 指数投资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	17,225,824.00	0.45
B	采矿业	144,476,688.30	3.73
C	制造业	2,202,112,467.64	56.92
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	79,493,602.46	2.05
E	建筑业	28,432,425.00	0.73
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	71,941,866.04	1.86
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	196,734,045.20	5.08
J	金融业	785,606,794.89	20.31
K	房地产业	9,882,601.36	0.26
L	租赁和商务服务业	10,095,756.00	0.26
M	科学研究和技术服务业	58,183,523.00	1.50
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-

Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	3,604,185,593.89	93.16

5.2.1.2 积极投资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	-	-
B	采矿业	36,149.82	0.00
C	制造业	17,026,434.15	0.44
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	850,291.44	0.02
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	1,583.46	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	5,342.04	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	17,919,800.91	0.46

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
----	------	------	-------	---------	--------------

1	300308	中际旭创	156,470	198,716,900.00	5.14
2	300750	宁德时代	381,192	149,812,267.92	3.87
3	300502	新易盛	199,620	121,169,340.00	3.13
4	600519	贵州茅台	95,201	112,859,833.49	2.92
5	601318	中国平安	1,854,864	88,551,207.36	2.29
6	603986	兆易创新	105,000	85,575,000.00	2.21
7	688256	寒武纪	52,200	83,287,710.00	2.15
8	600036	招商银行	2,287,336	81,200,428.00	2.10
9	002371	北方华创	81,829	72,382,660.24	1.87
10	601899	紫金矿业	2,765,395	69,522,030.30	1.80

5.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	688795	摩尔线程	10,828.00	7,329,906.32	0.19
2	688802	沐曦股份	3,994.00	3,070,946.66	0.08
3	688783	西安奕材	44,370.00	2,547,725.40	0.07
4	001248	华润新能源	84,104.00	850,291.44	0.02
5	688765	禾元生物	16,470.00	799,783.20	0.02

5.4 报告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。

5.5 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量	合约市值 (元)	公允价值变动 (元)	风险说明
IF2607	沪深 300 股指期货 IF2607 合约	8	11,812,800.00	321,660.00	买入股指期货合约的目的是进行更有效地流动性管理, 实现投资目标。
IF2609	沪深 300 股指期货 IF2609 合约	7	10,184,580.00	218,700.00	买入股指期货合约的目的是进行更有效地流动性管理, 实现投资目标。
IF2612	沪深 300 股指期货 IF2612 合约	4	5,713,680.00	116,940.00	买入股指期货合约的目的是进行更有效地流动性管理, 实现投资目标。
公允价值变动总额合计 (元)					657,300.00
股指期货投资本期收益 (元)					1,282,125.65
股指期货投资本期公允价值变动 (元)					1,523,940.00

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金为指数增强型基金, 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, 投资于标的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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无国债期货投资。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	3,853,109.39
2	应收证券清算款	5,371,299.97
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	11,305,385.80
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	20,529,795.16

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	688795	摩尔线程	7,329,906.32	0.19	新发流通受限
2	688802	沐曦股份	3,070,946.66	0.08	新发流通受限
3	688783	西安奕材	2,547,725.40	0.07	新发流通受限
4	001248	华润新能源	850,291.44	0.02	新发流通受限
5	688765	禾元生物	799,783.20	0.02	新发流通受限

5.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华夏沪深 300 指数增强 A	华夏沪深 300 指数增强 C	华夏沪深 300 指数增强 Y
----	-----------------	-----------------	-----------------

报告期期初基金份额总额	1,073,141,469.77	659,213,163.52	11,394,168.27
报告期期间基金总申购份额	137,169,792.90	60,343,449.03	2,814,279.64
减：报告期期间基金总赎回份额	227,406,971.48	110,237,896.67	2,224,267.38
报告期期间基金拆分变动份额	-	-	-
报告期期末基金份额总额	982,904,291.19	609,318,715.88	11,984,180.53

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

1、报告期内披露的主要事项

2026 年 4 月 3 日发布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。

2026 年 4 月 15 日发布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。

2026 年 4 月 16 日发布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。

2026 年 4 月 18 日发布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。

2026 年 6 月 4 日发布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。

2026 年 6 月 18 日发布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。

2026 年 6 月 26 日发布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。

2、其他相关信息

华夏基金管理有限公司成立于 1998 年 4 月 9 日，是经中国证监会批准成立的首批全国性基金管理公司之一。公司总部设在北京，在北京、上海、深圳、成都、南京、杭州、广州、青岛、武汉及沈阳设有分公司，在香港、深圳、上海、北京设有子公司。公司是首批全国社保基金管理人、首批企业年金基金管理人、境内首批 QDII 基金管理人、境内首只 ETF 基金管理人、境内首只沪港通 ETF

基金管理人、首批内地与香港基金互认基金管理人、首批基本养老保险基金投资管理人资格、首家加入联合国责任投资原则组织的公募基金公司、首批公募 FOF 基金管理人、首批公募养老目标基金管理人、首批个人养老金基金管理人、境内首批中日互通 ETF 基金管理人、首批商品期货 ETF 基金管理人、首批纳入互联互通 ETF 基金管理人、首批北交所主题基金管理人以及特定客户资产管理人、保险资金投资管理人、公募 REITs 管理人、首批浮动管理费基金管理人、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。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准基金募集的文件；
- 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。

9.2 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。

9.3 查阅方式

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

华夏基金管理有限公司

二〇二六年七月二十一日