

华夏中证 800 指数增强型证券投资基金
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：上海银行股份有限公司

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。

基金托管人上海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 信息披露方式	6
2.5 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	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
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	14
§6 中期报告财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	18
§7 投资组合报告	36
7.1 期末基金资产组合情况	36
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	37
7.3 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	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	76
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	78
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	79
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	79
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	79
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	79
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	79
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	79
7.12 本报告期投资基金情况	79
7.13 投资组合报告附注	79

§8 基金份额持有人信息	80
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	80
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	81
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	81
§9 开放式基金份额变动	81
§10 重大事件揭示	81
10.1 基金份额持有人大会决议	82
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	82
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	82
10.4 基金投资策略的改变	82
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	82
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	82
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	82
10.8 其他重大事件	83
§11 影响投资者决策的其他重要信息	83
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	84
§12 备查文件目录	84
12.1 备查文件目录	84
12.2 存放地点	84
12.3 查阅方式	84

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华夏中证 800 指数增强型证券投资基金	
基金简称	华夏中证 800 指数增强	
基金主代码	017985	
交易代码	017985	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2023 年 3 月 30 日	
基金管理人	华夏基金管理有限公司	
基金托管人	上海银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	22,646,201.67 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华夏中证 800 指数增强 A	华夏中证 800 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	017985	017986
报告期末下属分级基金的份额总额	12,577,267.15 份	10,068,934.52 份

2.2 基金产品说明

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日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，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，衍生品投资策略，资产支持证券投资策略，可转换债券、可交换债券投资策略，融资、转融通证券出借业务投资策略等。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率×95%+人民币活期存款税后利率×5%。
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。本基金还将通过港股通渠道投资于香港证券市场，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还将面临汇率风险、香港市场风险等特殊投资风险。

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	上海银行股份有限公司
信息披露	姓名	李彬	周直毅

负责人	联系电话	400-818-6666	021-68475608
	电子邮箱	service@ChinaAMC.com	custody@bosc.cn
客户服务电话		400-818-6666	95594
传真		010-63136700	021-68476901
注册地址		北京市顺义区安庆大街甲3号院	上海市黄浦区中山南路688号
办公地址		北京市朝阳区北辰西路6号院北辰中心C座5层	中国（上海）自由贸易试验区银城中路168号37层
邮政编码		100101	200120
法定代表人		邹迎光	顾建忠

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	华夏基金管理有限公司	北京市朝阳区北辰西路 6 号院北辰中心 C 座 5 层

§3 主要财务指标和基金净值表现

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）	
	华夏中证 800 指数增强 A	华夏中证 800 指数增强 C
本期已实现收益	2,333,028.06	2,170,175.04
本期利润	2,402,023.13	2,123,066.03
加权平均基金份额本期利润	0.1545	0.1447
本期加权平均净值利润率	12.35%	11.71%
本期基金份额净值增长率	10.45%	10.23%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2026年6月30日）	
	华夏中证 800 指数增强 A	华夏中证 800 指数增强 C
期末可供分配利润	3,952,394.30	2,992,694.62

期末可供分配基金份额利润	0.3142	0.2972
期末基金资产净值	16,529,661.45	13,061,629.14
期末基金份额净值	1.3142	1.2972
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2026年6月30日）	
	华夏中证 800 指数增强 A	华夏中证 800 指数增强 C
基金份额累计净值增长率	31.42%	29.72%

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

华夏中证 800 指数增强 A：

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	10.76%	1.17%	13.02%	1.27%	-2.26%	-0.10%
过去六个月	10.45%	1.12%	10.59%	1.18%	-0.14%	-0.06%
过去一年	29.08%	0.96%	31.40%	1.04%	-2.32%	-0.08%
过去三年	38.63%	1.11%	33.43%	1.12%	5.20%	-0.01%
自基金合同生效起至今	31.42%	1.09%	28.23%	1.10%	3.19%	-0.01%

华夏中证 800 指数增强 C：

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	10.65%	1.17%	13.02%	1.27%	-2.37%	-0.10%
过去六个月	10.23%	1.12%	10.59%	1.18%	-0.36%	-0.06%
过去一年	28.58%	0.96%	31.40%	1.04%	-2.82%	-0.08%
过去三年	36.98%	1.11%	33.43%	1.12%	3.55%	-0.01%
自基金合同生效起至今	29.72%	1.09%	28.23%	1.10%	1.49%	-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

华夏中证 800 指数增强型证券投资基金

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

(2023 年 3 月 30 日至 2026 年 6 月 30 日)

华夏中证 800 指数增强 A:



华夏中证 800 指数增强 C:



§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		
陈国峰	本基金的基金经理	2023-03-30	-	11 年	硕士。曾任世坤投资咨询有限公司（WorldQuant）中国区研究总监等。2020 年加入华夏基金管理有限公司。历任数量投资部研究员、投资经理助理、华夏网购精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理（2022 年 9 月 26 日至 2023 年 11 月 16 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。

4.2 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中证 800 指数，业绩比较基准为：中证 800 指数收益率 $\times$ 95%+银行活期存款利率(税后) $\times$ 5%。中证 800 指数由中证 500 和沪深 300 指数成份股组成，综合反映中国 A 股市场大中小市值公司的股票价格表现。作为指数增强型基金，本基金股票投资方面主要采用指数增强量化投资策略，在跟踪误差控制在目标范围内的基础上，力求获得超越标的指数的超额收益。

2026 年上半年，我国国内生产总值（GDP）同比增长 4.7%，落在年初政府工作报告提出的全年增长 4.5%-5% 的目标区间之内。分季度看，一季度 GDP 同比增长 5.0%，二季度增长 4.3%。经济结构调整优化，中国权益资产在流动性改善和风险偏好提升助力下震荡上行。2026 年上半年 A 股市场整体上来看，主要宽基指数上涨，结构性行情明显。行业间分化较大：通信、电子等行业表现较好，而消费者服务、综合金融等行业表现较差。宽基指数也有所分化，其中中证 800 指数上涨 11.12%，沪深 300 指数上涨 7.55%，中证 500 指数上涨 20.97%，中证 1000 指数上涨 15.99%。整体上看，报告期内本基金持仓继续保持均衡，量化策略表现基本正常。

基金投资运作方面，报告期内本基金以多层次、多驱动、高度分散化的量化投资策略为主，投资策略完全基于计算机模型，全流程高度自动化。投资策略基于多维度海量数据，开发大量有预测能力的信号，在控制基金与标的指数跟踪误差较低的基础上，力争获取更高的超额收益。同时，本基金秉承尽职尽责的态度，认真应对投资者日常申购、赎回等工作。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2026 年 6 月 30 日，华夏中证 800 指数增强 A 基金份额净值为 1.3142 元，本报告期份额净值增长率为 10.45%；华夏中证 800 指数增强 C 基金份额净值为 1.2972 元，本报告期份额净值增长率为 10.23%，同期业绩比较基准增长率为 10.59%。本基金本报告期 A 类份额跟踪偏离度为-0.14%，C 类份额跟踪偏离度为-0.36%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，积极因素仍然较多。政策方面，国内资本市场制度改革持续推进；经济增长方面，经济新旧动能持续平稳转换，AI 快速发展带动经济转型升级。总体来看，我国经济长期向好的支撑条件和基本趋势没有改变，经济高质量发展大势没有改变，有基础有条件保持经济稳定向好运行，

中国资产配置吸引力在增强。下半年预计行业或者风格板块仍会呈现轮动特征，我们将继续均衡配置。

基金投资运作方面，下半年本基金会在量化投资和研究的各个层次持续迭代、持续更新，提升主动量化策略能力。不断开发更多的策略与组合，在不同维度、不同频段持续优化，适应不断变化的市场环境，努力提高超额收益的稳定性。具体来讲，数据、因子、模型均进行持续开发和迭代，不断完善策略，丰富超额收益来源。

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

本基金自 2026 年 1 月 6 日至 2026 年 6 月 30 日出现基金资产净值低于五千万元的情形。本报告期内，自 2026 年 4 月 9 日起至 2026 年 6 月 30 日，由本基金管理人承担本基金的固定费用。基金管理人已向中国证监会进行报告并提出解决方案。基金管理人已于 2026 年 8 月 17 日发布《华夏基金管理有限公司关于以通讯方式召开华夏中证 800 指数增强型证券投资基金基金份额持有人大会的公告》，审议《关于华夏中证 800 指数增强型证券投资基金持续运作的议案》。

§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，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同以及托管协议的有关约定，诚实、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

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

本报告期，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金的利润分配情况符合有关法律法规和基金合同的相关约定。

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，认为复核内容真实、准确、完整，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：华夏中证 800 指数增强型证券投资基金

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	2,431,634.65	8,032,349.98
结算备付金		890,117.35	383,575.69
存出保证金		171,410.40	492,825.60
交易性金融资产	6.4.7.2	26,214,403.53	48,832,630.45
其中：股票投资		26,213,403.48	48,832,195.44
基金投资		-	-
债券投资		1,000.05	435.01
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		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		56,051.53	24,242.30

递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		29,763,617.46	57,765,624.02
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		-	-
应付赎回款		90,030.06	1,158,547.70
应付管理人报酬		20,034.02	26,176.01
应付托管费		3,756.39	4,908.02
应付销售服务费		4,592.43	6,357.35
应付投资顾问费		-	-
应交税费		1,662.71	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	52,251.26	103,745.58
负债合计		172,326.87	1,299,734.66
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	22,646,201.67	47,729,428.48
未分配利润	6.4.7.8	6,945,088.92	8,736,460.88
净资产合计		29,591,290.59	56,465,889.36
负债和净资产总计		29,763,617.46	57,765,624.02

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，华夏中证 800 指数增强 A 基金份额净值 1.3142 元，华夏中证 800 指数增强 C 基金份额净值 1.2972 元；华夏中证 800 指数增强基金份额总额 22,646,201.67 份（其中 A 类 12,577,267.15 份，C 类 10,068,934.52 份）。

6.2 利润表

会计主体：华夏中证 800 指数增强型证券投资基金

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		4,768,155.65	3,410,296.19
1.利息收入		8,750.17	5,434.58
其中：存款利息收入	6.4.7.9	8,750.17	5,434.58
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）		4,697,469.05	3,793,828.81
其中：股票投资收益	6.4.7.1 0	4,265,441.10	2,773,153.44
基金投资收益	6.4.7.1 1	-	-
债券投资收益	6.4.7.1 2	987.55	1,850.73
资产支持证券投资收益	6.4.7.1 3	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.1 4	-	-
衍生工具收益	6.4.7.1 5	176,489.18	238,895.07
股利收益	6.4.7.1 6	254,551.22	779,929.57
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.1 7	21,886.06	-393,112.00
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.1 8	40,050.37	4,144.80
减：二、营业总支出		243,066.49	440,091.58
1.管理人报酬		150,220.02	268,337.63
2.托管费		28,166.24	50,313.38
3.销售服务费		36,339.72	68,963.86

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	6.4.7.2 0	-	-
7.税金及附加		635.84	860.23
8.其他费用	6.4.7.2 1	27,704.67	51,616.48
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		4,525,089.16	2,970,204.61
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		4,525,089.16	2,970,204.61
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		4,525,089.16	2,970,204.61

6.3 净资产变动表

会计主体：华夏中证 800 指数增强型证券投资基金

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	47,729,428.48	8,736,460.88	56,465,889.36
二、本期期初净资产	47,729,428.48	8,736,460.88	56,465,889.36
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-25,083,226.81	-1,791,371.96	-26,874,598.77
（一）、综合收益总额	-	4,525,089.16	4,525,089.16
（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）	-25,083,226.81	-6,316,461.12	-31,399,687.93
其中：1.基金申购款	21,132,655.03	4,733,058.25	25,865,713.28
2.基金赎回款	-46,215,881.84	-11,049,519.37	-57,265,401.21
（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	22,646,201.67	6,945,088.92	29,591,290.59
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	79,524,480.82	-2,533,535.60	76,990,945.22
二、本期期初净资产	79,524,480.82	-2,533,535.60	76,990,945.22
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-26,754,277.00	3,239,866.80	-23,514,410.20
（一）、综合收益总额	-	2,970,204.61	2,970,204.61
（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）	-26,754,277.00	269,662.19	-26,484,614.81
其中：1.基金申购款	5,508,466.02	-190,321.12	5,318,144.90
2.基金赎回款	-32,262,743.02	459,983.31	-31,802,759.71
（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	52,770,203.82	706,331.20	53,476,535.02

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

华夏中证 800 指数增强型证券投资基金（以下简称“本基金”）已获中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2023]257 号文《关于准予华夏中证 800 指数增强型证券投资基金注册的批复》，由华夏基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《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》、《华夏中证 800 指数增强型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。本基金为契约型开放式，存续期限为不定期。本基金自 2023 年 3 月 15 日至 2023 年 3 月 27 日共募集 239,256,168.07 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（2023）验字第 60739337_A17 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华夏中证 800 指数增强型证券投资基金基金合同》于 2023 年 3 月 30 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 239,308,115.94 份

基金份额，其中认购资金利息折合 51,947.87 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，基金托管人为上海银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和本基金基金合同的有关规定，本基金的标的指数为中证 800 指数。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（含科创板、创业板、存托凭证及其他中国证监会注册或核准上市的股票）、港股通标的股票、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、地方政府债券、可转换债券、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、衍生品（包括股指期货、股票期权、国债期货）、资产支持证券、货币市场工具（含同业存单、债券回购等）、银行存款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。本基金可根据法律法规的规定参与融资、转融通证券出借业务。

本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产的 80%，港股通标的股票的投资比例为股票资产的 0%-50%，投资于标的指数成份股及其备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

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	411,538.30
等于：本金	411,423.04
加：应计利息	115.26
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	2,020,096.35
等于：本金	2,020,052.80
加：应计利息	43.55
合计	2,431,634.65

注：其他存款为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

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		24,754,378.10	-	26,213,403.48	1,459,025.38
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	1,000.00	0.05	1,000.05	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	1,000.00	0.05	1,000.05	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		24,755,378.10	0.05	26,214,403.53	1,459,025.38

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	1,371,600.00	-	-	-

其中：股指期货	1,371,600.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	1,371,600.00	-	-	-

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
IF2612	沪深 300 期货 IF2612 合约	1	1,428,420.00	56,820.00
合计	-	-	-	56,820.00
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	56,820.00
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

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	8.70
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	50,528.16
其他	1,714.40
合计	52,251.26

6.4.7.7 实收基金

华夏中证 800 指数增强 A

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	22,839,939.02	22,839,939.02
本期申购	10,748,593.21	10,748,593.21
本期赎回（以“-”号填列）	-21,011,265.08	-21,011,265.08
本期末	12,577,267.15	12,577,267.15

华夏中证 800 指数增强 C

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	24,889,489.46	24,889,489.46
本期申购	10,384,061.82	10,384,061.82
本期赎回（以“-”号填列）	-25,204,616.76	-25,204,616.76
本期末	10,068,934.52	10,068,934.52

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

华夏中证 800 指数增强 A

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	4,743,537.65	-407,128.61	4,336,409.04

本期期初	4,743,537.65	-407,128.61	4,336,409.04
本期利润	2,333,028.06	68,995.07	2,402,023.13
本期基金份额交易产生的变动数	-2,652,742.15	-133,295.72	-2,786,037.87
其中：基金申购款	3,100,684.10	-699,153.56	2,401,530.54
基金赎回款	-5,753,426.25	565,857.84	-5,187,568.41
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,423,823.56	-471,429.26	3,952,394.30

华夏中证 800 指数增强 C

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	4,841,933.43	-441,881.59	4,400,051.84
本期期初	4,841,933.43	-441,881.59	4,400,051.84
本期利润	2,170,175.04	-47,109.01	2,123,066.03
本期基金份额交易产生的变动数	-3,644,744.84	114,321.59	-3,530,423.25
其中：基金申购款	2,856,563.38	-525,035.67	2,331,527.71
基金赎回款	-6,501,308.22	639,357.26	-5,861,950.96
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,367,363.63	-374,669.01	2,992,694.62

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	3,182.56
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	668.05
结算备付金利息收入	4,898.64
其他	0.92
合计	8,750.17

注：其他存款利息收入为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金产生的利息收入。

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	141,212,681.95
减：卖出股票成本总额	136,836,985.67
减：交易费用	110,255.18
买卖股票差价收入	4,265,441.10

6.4.7.11 基金投资收益

无。

6.4.7.12 债券投资收益

6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	0.16
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	987.39
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	987.55

6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	2,287.51
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,300.00
减：应计利息总额	0.12
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	987.39

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	176,489.18

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	254,551.22
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	254,551.22

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	23,446.06
——股票投资	23,581.06
——债券投资	-135.00
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-1,560.00
——权证投资	-
——期货投资	-1,560.00
3.其他	-

减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	21,886.06

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	40,050.37
合计	40,050.37

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	6,148.52
信息披露费	21,479.64
证券出借违约金	-
银行费用	76.51
合计	27,704.67

注：本基金固定费用为其他费用项目中“审计费”、“信息披露费”、“银行间账户维护费”、“银行间咨询服务费”、“持有人大会费”等费用。自 2026 年 4 月 9 日起至 2026 年 6 月 30 日，本基金的固定费用由本基金管理人承担，共计 23,399.36 元（该金额未经审计，包括预估金额，实际金额以年度报告披露为准）。

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
上海银行股份有限公司（“上海银行”）	基金托管人
中信证券股份有限公司（“中信证券”）	基金管理人的股东
上海华夏财富投资管理有限公司（“华夏财富”）	基金管理人的子公司
中信证券（山东）有限责任公司（“中信证券（山东）”）	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

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	150,220.02	268,337.63

其中：应支付销售机构的客户维护费	11,757.66	8,455.44
应支付基金管理人的净管理费	138,462.36	259,882.19

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 0.80% 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	28,166.24	50,313.38

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

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期2026年1月1日至2026年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华夏中证 800 指数增强 A	华夏中证 800 指数增强 C	合计
华夏基金管理有限公司	-	1,062.32	1,062.32
中信证券	-	45.19	45.19
中信证券（山东）	-	32.58	32.58
华夏财富	-	0.55	0.55
合计	-	1,140.64	1,140.64
获得销售服务费的各关联方名称	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销售服务费		
	华夏中证 800 指数增强 A	华夏中证 800 指数增强 C	合计

华夏基金管理有限公司	-	336.72	336.72
中信证券	-	189.35	189.35
中信证券（山东）	-	-	-
华夏财富	-	-	-
合计	-	526.07	526.07

注：①支付基金销售机构的基金销售服务费按 C 类基金份额前一日基金资产净值 0.40% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给基金管理人，再由基金管理人计算并支付给各基金销售机构。

②基金销售服务费计算公式为：C 类日基金销售服务费 = 前一日 C 类基金资产净值 × 年费率 / 当年天数。

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

无。

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
上海银行活期存款	411,538.30	3,182.56	2,186,891.24	2,749.63

注：本基金的活期银行存款由基金托管人上海银行保管，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 2026 年 1 月 1 日至 2026 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	001248	华润新能源	新股发行	1,000	10,110.00
上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 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	-	-	-	-	-

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金固定费用为其他费用项目中“审计费”、“信息披露费”、“银行间账户维护费”、“银行间咨询服务费”、“持有人大会费”等费用。自 2026 年 4 月 9 日起至 2026 年 6 月 30 日，本基金的固定费用由本基金管理人承担，共计 23,399.36 元（该金额未经审计，包括预估金额，实际金额以年度报告披露为准）。

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

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	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
001248	华润新能源	2026-06-25	1 个月内(含)	新发流通受限	10.11	10.11	1,000	10,110.00	10,110.00	-
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113704	春风转债	2026-06-10	1 个月内(含)	新发流通受限	100.00	100.01	10	1,000.00	1,000.05	期末估值单价为含息价格

注：①根据中国证监会《上市公司证券发行注册管理办法》，基金参与上市公司向特定对象发行股票所获得的股票，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。

②基金还可作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

③根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

④基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的设定限售期的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

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，本基金主要投资于基金合同约定的具有良好流动性的金融工具。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开放期内投资者历史申赎、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及比例，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。

本基金为指数增强型基金，以中证 800 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。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。

本基金为指数增强型基金，主要采用指数增强量化投资策略，运用多因子分析模型构建投资组合，同时优化组合交易并严格控制组合风险。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	26,213,403.48	88.58	48,832,195.44	86.48
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	1,000.05	0.00	435.01	0.00
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	26,214,403.53	88.59	48,832,630.45	86.48

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	除中证 800 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%	-1,413,005.79	-2,216,391.49
	+5%	1,413,005.79	2,216,391.49

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	26,203,293.48
第二层次	11,110.05
第三层次	-
合计	26,214,403.53

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	26,213,403.48	88.07
	其中：股票	26,213,403.48	88.07
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,000.05	0.00
	其中：债券	1,000.05	0.00
	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	3,321,752.00	11.16
8	其他各项资产	227,461.93	0.76
9	合计	29,763,617.46	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

7.2.1.1 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	27,196.00	0.09
B	采矿业	938,935.20	3.17
C	制造业	14,713,959.77	49.72
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	495,945.00	1.68
E	建筑业	173,385.00	0.59
F	批发和零售业	79,440.54	0.27
G	交通运输、仓储和邮政业	572,660.00	1.94
H	住宿和餐饮业	16,191.00	0.05
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,283,796.38	4.34
J	金融业	3,695,856.95	12.49
K	房地产业	69,301.00	0.23

L	租赁和商务服务业	80,289.00	0.27
M	科学研究和技术服务业	150,601.00	0.51
N	水利、环境和公共设施管理业	95,681.80	0.32
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	74,539.00	0.25
R	文化、体育和娱乐业	12,023.00	0.04
S	综合	-	-
	合计	22,479,800.64	75.97

7.2.1.2 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	39,091.00	0.13
B	采矿业	92,970.00	0.31
C	制造业	2,813,928.04	9.51
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	52,801.00	0.18
E	建筑业	10,938.00	0.04
F	批发和零售业	98,470.00	0.33
G	交通运输、仓储和邮政业	31,169.00	0.11
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	338,306.40	1.14
J	金融业	45,515.00	0.15
K	房地产业	21,721.00	0.07
L	租赁和商务服务业	24,279.40	0.08
M	科学研究和技术服务业	80,846.00	0.27
N	水利、环境和公共设施管理业	62,213.00	0.21
O	居民服务、修理和其他服务业	3,100.00	0.01
P	教育	12,286.00	0.04
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	5,969.00	0.02

S	综合	-	-
	合计	3,733,602.84	12.62

7.3 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

7.3.1 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	300308	中际旭创	900	1,143,000.00	3.86
2	300750	宁德时代	1,940	762,439.40	2.58
3	300502	新易盛	928	563,296.00	1.90
4	688256	寒武纪	298	475,473.90	1.61
5	600519	贵州茅台	400	474,196.00	1.60
6	688008	澜起科技	900	278,910.00	0.94
7	000333	美的集团	3,400	256,802.00	0.87
8	600919	江苏银行	23,300	251,174.00	0.85
9	601318	中国平安	5,200	248,248.00	0.84
10	603986	兆易创新	300	244,500.00	0.83
11	002384	东山精密	800	209,880.00	0.71
12	002475	立讯精密	2,800	197,120.00	0.67
13	601899	紫金矿业	7,700	193,578.00	0.65
14	688002	睿创微纳	1,200	185,628.00	0.63
15	688012	中微公司	396	185,526.00	0.63
16	300857	协创数据	480	163,152.00	0.55
17	000338	潍柴动力	5,900	160,775.00	0.54
18	600900	长江电力	5,800	153,526.00	0.52
19	601988	中国银行	26,500	151,580.00	0.51
20	688041	海光信息	402	148,860.60	0.50
21	002487	大金重工	2,500	144,925.00	0.49
22	600183	生益科技	800	138,720.00	0.47
23	300604	长川科技	400	136,568.00	0.46
24	603799	华友钴业	2,800	135,128.00	0.46

25	601601	中国太保	4,700	134,044.00	0.45
26	002415	海康威视	3,900	133,380.00	0.45
27	002738	中矿资源	2,200	129,778.00	0.44
28	603920	世运电路	2,700	129,708.00	0.44
29	601998	中信银行	18,179	125,980.47	0.43
30	601288	农业银行	20,700	125,649.00	0.42
31	600105	永鼎股份	1,800	121,464.00	0.41
32	688981	中芯国际	758	120,385.56	0.41
33	600926	杭州银行	8,200	118,490.00	0.40
34	300408	三环集团	700	116,830.00	0.39
35	600233	圆通速递	7,400	116,550.00	0.39
36	601138	工业富联	1,600	115,440.00	0.39
37	601328	交通银行	17,600	113,168.00	0.38
38	603259	药明康德	900	112,059.00	0.38
39	601939	建设银行	11,200	107,856.00	0.36
40	600036	招商银行	3,000	106,500.00	0.36
41	600690	海尔智家	5,100	104,091.00	0.35
42	601398	工商银行	14,700	103,929.00	0.35
43	600941	中国移动	1,200	103,356.00	0.35
44	002281	光迅科技	400	102,776.00	0.35
45	000725	京东方 A	11,700	101,556.00	0.34
46	688347	华虹宏力	300	100,890.00	0.34
47	600150	中国船舶	2,962	100,085.98	0.34
48	300207	欣旺达	5,200	98,748.00	0.33
49	000166	申万宏源	22,400	98,560.00	0.33
50	300115	长盈精密	3,500	97,790.00	0.33
51	300373	扬杰科技	600	94,338.00	0.32
52	600999	招商证券	4,400	92,840.00	0.31
53	601857	中国石油	10,600	92,008.00	0.31
54	002916	深南电路	200	91,580.00	0.31

55	002460	赣锋锂业	1,400	91,560.00	0.31
56	002049	紫光国微	1,000	88,750.00	0.30
57	002371	北方华创	100	88,456.00	0.30
58	002493	荣盛石化	8,100	87,075.00	0.29
59	601009	南京银行	8,800	87,032.00	0.29
60	600050	中国联通	21,600	86,400.00	0.29
61	603296	华勤技术	1,160	86,153.20	0.29
62	688361	中科飞测	200	86,000.00	0.29
63	000623	吉林敖东	4,700	83,331.00	0.28
64	601995	中金公司	2,300	83,145.00	0.28
65	601628	中国人寿	2,300	81,305.00	0.27
66	601728	中国电信	15,500	80,445.00	0.27
67	601211	国泰海通	4,400	80,080.00	0.27
68	000975	山金国际	4,700	79,900.00	0.27
69	002273	水晶光电	2,200	78,056.00	0.26
70	003816	中国广核	19,600	76,636.00	0.26
71	600109	国金证券	8,600	75,508.00	0.26
72	603288	海天味业	2,200	72,952.00	0.25
73	603659	璞泰来	2,500	72,325.00	0.24
74	000703	恒逸石化	5,300	71,921.00	0.24
75	688778	厦钨新能	1,300	70,720.00	0.24
76	000776	广发证券	3,000	70,200.00	0.24
77	000001	平安银行	6,900	69,345.00	0.23
78	601788	光大证券	4,800	69,264.00	0.23
79	000060	中金岭南	8,900	67,373.00	0.23
80	601077	渝农商行	11,000	67,210.00	0.23
81	301606	绿联科技	1,100	67,122.00	0.23
82	300394	天孚通信	220	66,589.60	0.23
83	601088	中国神华	1,700	66,368.00	0.22
84	601665	齐鲁银行	11,200	64,624.00	0.22

85	600026	中远海能	3,600	64,584.00	0.22
86	002402	和而泰	2,500	64,575.00	0.22
87	300274	阳光电源	400	63,608.00	0.21
88	600801	华新建材	4,000	62,400.00	0.21
89	600887	伊利股份	2,600	62,296.00	0.21
90	300919	中伟新材	1,400	61,250.00	0.21
91	600016	民生银行	19,000	61,180.00	0.21
92	603290	斯达半导	400	61,176.00	0.21
93	002532	天山铝业	5,700	61,161.00	0.21
94	601916	浙商银行	22,800	59,964.00	0.20
95	688036	传音控股	1,000	58,950.00	0.20
96	688506	百利天恒	200	58,806.00	0.20
97	300661	圣邦股份	400	57,392.00	0.19
98	002130	沃尔核材	3,000	56,880.00	0.19
99	300548	长芯博创	200	55,600.00	0.19
100	688313	仕佳光子	300	55,395.00	0.19
101	301377	鼎泰高科	100	55,090.00	0.19
102	600309	万华化学	800	54,728.00	0.18
103	600522	中天科技	900	54,612.00	0.18
104	002001	新和成	1,908	54,225.36	0.18
105	000301	东方盛虹	4,500	51,525.00	0.17
106	000792	盐湖股份	1,700	51,323.00	0.17
107	688235	百济神州	200	50,922.00	0.17
108	002429	兆驰股份	4,900	50,911.00	0.17
109	300223	北京君正	200	49,780.00	0.17
110	688220	翱捷科技	400	49,728.00	0.17
111	002304	洋河股份	1,300	49,595.00	0.17
112	002266	浙富控股	9,700	49,082.00	0.17
113	600816	建元信托	20,100	49,044.00	0.17
114	600875	东方电气	1,700	48,909.00	0.17

115	688396	华润微	500	48,775.00	0.16
116	601000	唐山港	11,700	48,555.00	0.16
117	000408	藏格矿业	700	48,524.00	0.16
118	600547	山东黄金	2,100	48,489.00	0.16
119	300073	当升科技	1,000	48,040.00	0.16
120	601600	中国铝业	5,800	47,676.00	0.16
121	001389	广合科技	200	47,450.00	0.16
122	600570	恒生电子	2,200	46,618.00	0.16
123	600985	淮北矿业	3,300	46,365.00	0.16
124	601658	邮储银行	9,300	45,849.00	0.15
125	002353	杰瑞股份	300	45,750.00	0.15
126	300953	震裕科技	340	45,458.00	0.15
127	601799	星宇股份	500	45,310.00	0.15
128	002008	大族激光	300	45,033.00	0.15
129	000807	云铝股份	2,000	44,280.00	0.15
130	600460	士兰微	800	43,728.00	0.15
130	600176	中国巨石	600	43,728.00	0.15
131	688111	金山办公	200	42,610.00	0.14
132	600584	长电科技	400	41,420.00	0.14
133	601688	华泰证券	2,000	41,240.00	0.14
134	601319	中国人保	6,100	41,236.00	0.14
135	688099	晶晨股份	400	41,160.00	0.14
136	002044	美年健康	8,100	40,743.00	0.14
137	000895	双汇发展	1,800	40,320.00	0.14
138	603699	纽威股份	800	40,240.00	0.14
139	002812	恩捷股份	600	40,146.00	0.14
140	301536	星辰科技	300	38,613.00	0.13
141	601166	兴业银行	2,300	38,088.00	0.13
142	002064	华峰化学	4,000	37,960.00	0.13
143	603369	今世缘	1,600	37,936.00	0.13

144	002236	大华股份	2,300	37,927.00	0.13
145	002850	科达利	200	37,860.00	0.13
146	002736	国信证券	3,700	36,963.00	0.12
147	600498	烽火通信	500	36,800.00	0.12
148	600025	华能水电	4,100	36,449.00	0.12
149	688617	惠泰医疗	200	36,312.00	0.12
150	601456	国联民生	4,100	36,244.00	0.12
151	002966	苏州银行	5,200	36,192.00	0.12
152	605117	德业股份	340	36,101.20	0.12
153	301200	大族数控	100	36,065.00	0.12
154	300679	电连技术	600	35,994.00	0.12
155	002414	高德红外	2,700	35,802.00	0.12
156	601555	东吴证券	4,500	35,640.00	0.12
157	688475	萤石网络	1,300	35,555.00	0.12
158	600938	中国海油	1,300	35,295.00	0.12
159	603993	洛阳钼业	2,000	35,100.00	0.12
160	002050	三花智控	800	35,064.00	0.12
161	688469	芯联集成	3,300	35,013.00	0.12
162	688166	博瑞医药	1,000	35,010.00	0.12
163	688301	奕瑞科技	280	34,720.00	0.12
164	300476	胜宏科技	100	34,643.00	0.12
165	002028	思源电气	200	34,600.00	0.12
166	601225	陕西煤业	1,700	34,595.00	0.12
167	002203	海亮股份	1,500	34,275.00	0.12
168	600885	宏发股份	980	33,800.20	0.11
169	000999	华润三九	1,500	33,735.00	0.11
170	000987	越秀资本	4,300	33,626.00	0.11
171	002851	麦格米特	200	33,436.00	0.11
172	300442	润泽科技	400	33,228.00	0.11
173	002600	领益智造	1,900	32,946.00	0.11

174	300628	亿联网络	970	32,805.40	0.11
175	601877	正泰电器	1,300	32,591.00	0.11
176	300014	亿纬锂能	500	32,515.00	0.11
177	002673	西部证券	5,000	32,450.00	0.11
178	002821	凯莱英	200	32,400.00	0.11
179	601878	浙商证券	3,400	32,300.00	0.11
180	603766	隆鑫通用	2,700	32,211.00	0.11
181	000021	深科技	500	32,135.00	0.11
182	603345	安井食品	400	32,076.00	0.11
183	002594	比亚迪	400	31,880.00	0.11
184	300567	精测电子	100	31,760.00	0.11
185	601865	福莱特	3,000	31,530.00	0.11
186	688387	信科移动	1,588	31,505.92	0.11
187	603225	新凤鸣	1,600	31,440.00	0.11
188	300866	安克创新	300	31,350.00	0.11
189	601128	常熟银行	5,364	31,218.48	0.11
190	600426	华鲁恒升	1,300	31,096.00	0.11
191	300748	金力永磁	1,000	30,850.00	0.10
192	600061	国投资本	4,700	30,785.00	0.10
193	600893	航发动力	800	30,672.00	0.10
194	002463	沪电股份	200	30,560.00	0.10
195	002648	卫星化学	1,300	30,537.00	0.10
196	600763	通策医疗	900	30,492.00	0.10
197	300122	智飞生物	2,600	30,394.00	0.10
198	603308	应流股份	500	30,200.00	0.10
199	000921	海信家电	1,100	30,052.00	0.10
200	000032	深桑达 A	1,200	29,940.00	0.10
201	688188	柏楚电子	280	29,876.00	0.10
202	000858	五粮液	400	29,600.00	0.10
203	300487	蓝晓科技	500	29,425.00	0.10

204	000415	渤海租赁	7,200	29,304.00	0.10
205	300059	东方财富	1,400	28,532.00	0.10
206	688385	复旦微电	400	28,516.00	0.10
207	000883	湖北能源	6,600	28,512.00	0.10
208	600845	宝信软件	1,700	28,271.00	0.10
209	002152	广电运通	3,000	28,140.00	0.10
210	601872	招商轮船	1,600	28,112.00	0.10
211	601021	春秋航空	600	27,348.00	0.09
212	300623	捷捷微电	600	26,994.00	0.09
213	601360	三六零	3,100	26,939.00	0.09
214	600029	南方航空	5,200	26,936.00	0.09
215	600346	恒力石化	1,500	26,565.00	0.09
216	601838	成都银行	1,500	26,550.00	0.09
217	300124	汇川技术	400	26,532.00	0.09
218	600482	中国动力	800	26,240.00	0.09
219	688009	中国通号	5,500	26,180.00	0.09
219	601607	上海医药	1,700	26,180.00	0.09
220	300432	富临精工	1,300	26,117.00	0.09
221	688322	奥比中光	200	26,110.00	0.09
222	600332	白云山	1,300	26,052.00	0.09
223	601233	桐昆股份	1,200	25,980.00	0.09
224	600028	中国石化	5,800	25,868.00	0.09
225	600157	永泰能源	16,000	25,760.00	0.09
226	002065	东华软件	3,600	25,704.00	0.09
227	603129	春风动力	100	25,580.00	0.09
228	600549	厦门钨业	300	25,560.00	0.09
229	600298	安琪酵母	700	25,340.00	0.09
230	601919	中远海控	1,900	25,194.00	0.09
231	000739	普洛药业	1,500	24,990.00	0.08
232	600871	石化油服	12,300	24,969.00	0.08

233	600095	湘财股份	3,300	24,849.00	0.08
234	300570	太辰光	100	24,671.00	0.08
235	600031	三一重工	1,400	24,192.00	0.08
236	000596	古井贡酒	300	23,940.00	0.08
237	601336	新华保险	400	23,864.00	0.08
238	601608	中信重工	5,000	23,850.00	0.08
239	002142	宁波银行	800	23,752.00	0.08
240	600489	中金黄金	1,300	23,465.00	0.08
241	601766	中国中车	4,500	23,400.00	0.08
242	002939	长城证券	2,800	23,352.00	0.08
243	000967	盈峰环境	2,200	23,166.00	0.08
244	601668	中国建筑	5,300	23,002.00	0.08
245	601866	中远海发	10,300	22,763.00	0.08
246	000708	中信特钢	1,800	22,716.00	0.08
247	002756	永兴材料	400	22,656.00	0.08
247	000733	振华科技	400	22,656.00	0.08
248	603885	吉祥航空	2,200	22,638.00	0.08
249	000651	格力电器	600	22,500.00	0.08
250	603737	三棵树	920	22,172.00	0.07
251	601117	中国化学	3,000	22,050.00	0.07
252	601898	中煤能源	1,800	21,924.00	0.07
253	002352	顺丰控股	700	21,882.00	0.07
254	688578	艾力斯	200	21,840.00	0.07
255	000617	中油资本	3,300	21,747.00	0.07
256	601198	东兴证券	1,600	21,744.00	0.07
257	600015	华夏银行	3,400	21,726.00	0.07
258	601006	大秦铁路	4,700	21,667.00	0.07
259	601100	恒立液压	200	21,512.00	0.07
260	002945	华林证券	1,600	21,488.00	0.07
261	000951	中国重汽	1,100	21,461.00	0.07

262	688213	思特威	200	21,414.00	0.07
263	002432	九安医疗	300	21,204.00	0.07
264	001391	国货航	5,200	21,164.00	0.07
265	002938	鹏鼎控股	200	21,076.00	0.07
266	600988	赤峰黄金	800	21,056.00	0.07
267	600276	恒瑞医药	400	20,816.00	0.07
268	300458	全志科技	520	20,519.20	0.07
269	000893	亚钾国际	500	20,445.00	0.07
270	600348	华阳股份	2,600	19,890.00	0.07
271	600595	中孚实业	3,500	19,670.00	0.07
272	601169	北京银行	4,000	19,600.00	0.07
273	300677	英科医疗	500	19,585.00	0.07
274	300012	华测检测	1,400	19,404.00	0.07
275	600497	驰宏锌锗	1,600	19,376.00	0.07
276	601156	东航物流	1,200	19,344.00	0.07
277	002074	国轩高科	700	19,257.00	0.07
278	600970	中材国际	2,700	19,251.00	0.07
279	300454	深信服	200	19,240.00	0.07
280	000657	中钨高新	200	19,144.00	0.06
281	600562	国睿科技	900	19,098.00	0.06
282	600563	法拉电子	100	19,080.00	0.06
283	600019	宝钢股份	3,500	19,005.00	0.06
284	688122	西部超导	300	18,843.00	0.06
285	603893	瑞芯微	100	18,836.00	0.06
286	600039	四川路桥	2,400	18,768.00	0.06
287	300999	金龙鱼	800	18,608.00	0.06
288	600546	山煤国际	1,700	18,581.00	0.06
289	603160	汇顶科技	300	18,513.00	0.06
290	000988	华工科技	100	18,461.00	0.06
291	300140	节能环保	3,700	18,389.00	0.06

292	688599	天合光能	1,300	18,356.00	0.06
293	300803	指南针	200	18,334.00	0.06
294	002299	圣农发展	1,200	18,192.00	0.06
295	003022	联泓新科	700	18,130.00	0.06
296	300763	锦浪科技	200	18,070.00	0.06
297	600292	电投水电	1,500	18,060.00	0.06
298	601618	中国中冶	7,400	18,056.00	0.06
299	003031	中瓷电子	100	18,030.00	0.06
300	600601	方正科技	1,300	17,992.00	0.06
301	600499	科达制造	1,300	17,940.00	0.06
302	002517	恺英网络	1,100	17,875.00	0.06
303	600685	中船防务	700	17,808.00	0.06
304	603979	金诚信	300	17,709.00	0.06
305	600602	云赛智联	1,100	17,688.00	0.06
306	600711	盛屯矿业	1,600	17,552.00	0.06
307	600515	海南机场	6,400	17,536.00	0.06
308	003021	兆威机电	200	17,470.00	0.06
309	600927	永安期货	1,400	17,430.00	0.06
310	600372	中航机载	1,600	17,360.00	0.06
311	600362	江西铜业	400	17,320.00	0.06
312	601108	财通证券	2,000	17,300.00	0.06
313	002120	韵达股份	2,700	17,172.00	0.06
314	603087	甘李药业	300	17,028.00	0.06
315	603338	浙江鼎力	400	17,000.00	0.06
316	688180	君实生物	500	16,910.00	0.06
317	688561	奇安信	700	16,786.00	0.06
318	600060	海信视像	600	16,722.00	0.06
319	600153	建发股份	2,100	16,653.00	0.06
320	600104	上汽集团	1,700	16,592.00	0.06
321	600098	广州发展	2,800	16,548.00	0.06

322	600754	锦江酒店	900	16,191.00	0.05
323	601888	中国中免	300	16,113.00	0.05
324	301165	锐捷网络	200	16,090.00	0.05
325	600188	兖矿能源	900	15,993.00	0.05
326	600196	复星医药	700	15,729.00	0.05
327	600600	青岛啤酒	300	15,669.00	0.05
328	002265	建设工业	900	15,660.00	0.05
329	002185	华天科技	700	15,617.00	0.05
330	000932	华菱钢铁	4,500	15,615.00	0.05
331	000034	神州数码	560	15,540.00	0.05
332	000568	泸州老窖	200	15,504.00	0.05
333	601390	中国中铁	3,700	15,429.00	0.05
334	688336	三生国健	290	15,399.00	0.05
335	002025	航天电器	200	15,244.00	0.05
336	688709	成都华微	400	15,236.00	0.05
337	600486	扬农化工	300	15,210.00	0.05
337	001286	陕西能源	1,500	15,210.00	0.05
338	000729	燕京啤酒	1,500	15,195.00	0.05
339	601018	宁波港	4,800	15,120.00	0.05
340	600968	海油发展	4,500	14,985.00	0.05
341	600901	江苏金租	2,600	14,950.00	0.05
342	601567	三星电气	1,000	14,940.00	0.05
342	002126	银轮股份	300	14,940.00	0.05
343	000027	深圳能源	2,400	14,880.00	0.05
344	603156	养元饮品	300	14,721.00	0.05
345	002138	顺络电子	200	14,620.00	0.05
346	600363	联创光电	400	14,312.00	0.05
347	000878	云南铜业	900	14,292.00	0.05
348	600166	福田汽车	4,900	14,259.00	0.05
349	600989	宝丰能源	700	14,231.00	0.05

350	600674	川投能源	1,000	14,170.00	0.05
351	002602	世纪华通	1,000	14,100.00	0.05
352	000977	浪潮信息	200	14,000.00	0.05
353	002714	牧原股份	400	13,996.00	0.05
354	600316	洪都航空	500	13,970.00	0.05
355	600741	华域汽车	900	13,968.00	0.05
356	601001	晋控煤业	800	13,912.00	0.05
357	601881	中国银河	1,100	13,827.00	0.05
358	002558	巨人网络	500	13,780.00	0.05
359	600884	杉杉股份	1,000	13,550.00	0.05
360	600126	杭钢股份	2,200	13,486.00	0.05
361	603806	福斯特	800	13,432.00	0.05
362	600066	宇通客车	500	13,405.00	0.05
363	300395	菲利华	100	13,373.00	0.05
364	601111	中国国航	2,200	13,310.00	0.04
365	000830	鲁西化工	1,100	13,200.00	0.04
366	000155	川能动力	1,100	13,178.00	0.04
367	600583	海油工程	2,600	13,078.00	0.04
368	600100	同方股份	1,900	13,015.00	0.04
369	002461	珠江啤酒	1,700	12,869.00	0.04
370	001979	招商蛇口	2,000	12,860.00	0.04
371	601699	潞安环能	900	12,852.00	0.04
372	603341	龙旗科技	300	12,747.00	0.04
373	000683	博源化工	2,200	12,672.00	0.04
374	600170	上海建工	5,700	12,654.00	0.04
375	300832	新产业	300	12,600.00	0.04
376	000157	中联重科	1,800	12,546.00	0.04
377	300627	华测导航	440	12,496.00	0.04
378	688568	中科星图	300	12,441.00	0.04
379	002926	华西证券	1,500	12,255.00	0.04

380	300450	先导智能	300	12,216.00	0.04
381	000630	铜陵有色	1,900	12,084.00	0.04
382	600886	国投电力	900	11,979.00	0.04
383	601985	中国核电	1,300	11,739.00	0.04
384	002683	广东宏大	400	11,716.00	0.04
385	300759	康龙化成	400	11,572.00	0.04
386	300339	润和软件	300	11,553.00	0.04
387	000750	国海证券	3,100	11,408.00	0.04
388	002153	石基信息	1,576	11,394.48	0.04
389	603077	和邦生物	4,900	11,368.00	0.04
390	601059	信达证券	700	11,333.00	0.04
391	601399	国机重装	3,200	11,200.00	0.04
392	600000	浦发银行	1,300	11,193.00	0.04
393	600329	达仁堂	300	11,166.00	0.04
394	600208	衢州发展	3,900	11,037.00	0.04
395	001965	招商公路	1,200	10,992.00	0.04
396	601818	光大银行	3,800	10,982.00	0.04
397	600809	山西汾酒	100	10,937.00	0.04
398	600436	片仔癀	100	10,928.00	0.04
399	000063	中兴通讯	300	10,857.00	0.04
400	688472	阿特斯	1,000	10,820.00	0.04
401	603939	益丰药房	600	10,788.00	0.04
402	603019	中科曙光	100	10,723.00	0.04
403	688728	格科微	500	10,520.00	0.04
404	601298	青岛港	1,300	10,465.00	0.04
405	600764	中国海防	600	10,458.00	0.04
406	300017	网宿科技	800	10,408.00	0.04
407	601058	赛轮轮胎	900	10,377.00	0.04
408	002841	视源股份	300	10,359.00	0.04
409	600765	中航重机	800	10,336.00	0.03

410	603858	步长制药	700	10,220.00	0.03
411	600585	海螺水泥	600	10,170.00	0.03
412	603568	伟明环保	660	10,150.80	0.03
413	603179	新泉股份	200	9,930.00	0.03
414	000050	深天马 A	1,000	9,910.00	0.03
415	600115	中国东航	2,600	9,906.00	0.03
416	688772	珠海冠宇	500	9,815.00	0.03
417	000997	新大陆	600	9,780.00	0.03
418	601717	中创智领	700	9,737.00	0.03
419	600369	西南证券	2,400	9,648.00	0.03
420	300033	同花顺	40	9,640.00	0.03
421	601106	中国一重	2,900	9,570.00	0.03
422	600803	新奥股份	600	9,480.00	0.03
423	000538	云南白药	200	9,474.00	0.03
424	300390	天华新能	100	9,351.00	0.03
425	002500	山西证券	1,800	9,288.00	0.03
426	600637	东方明珠	1,100	9,141.00	0.03
427	002244	滨江集团	1,200	9,120.00	0.03
428	300735	光弘科技	400	9,096.00	0.03
428	002625	光启技术	300	9,096.00	0.03
429	000423	东阿阿胶	200	9,072.00	0.03
430	600977	中国电影	700	9,044.00	0.03
431	002241	歌尔股份	400	9,012.00	0.03
432	002311	海大集团	200	8,922.00	0.03
433	600339	中油工程	2,900	8,903.00	0.03
434	600517	国网英大	1,900	8,892.00	0.03
435	600312	平高电气	500	8,830.00	0.03
436	601997	贵阳银行	1,700	8,721.00	0.03
436	601066	中信建投	300	8,721.00	0.03
437	300896	爱美客	100	8,720.00	0.03

438	601901	方正证券	1,200	8,640.00	0.03
439	000960	锡业股份	200	8,538.00	0.03
440	600958	东方证券	900	8,496.00	0.03
441	600008	首创环保	3,100	8,432.00	0.03
442	601136	首创证券	600	8,370.00	0.03
443	600132	重庆啤酒	200	8,260.00	0.03
444	601155	新城控股	800	8,208.00	0.03
445	603786	科博达	200	8,182.00	0.03
446	601615	明阳智能	700	8,099.00	0.03
447	000425	徐工机械	1,000	8,090.00	0.03
448	300418	昆仑万维	200	8,072.00	0.03
449	600642	申能股份	900	7,857.00	0.03
450	002195	岩山科技	1,200	7,848.00	0.03
451	000598	兴蓉环境	1,200	7,704.00	0.03
452	000629	钒钛股份	2,300	7,682.00	0.03
453	002155	湖南黄金	320	7,638.40	0.03
454	301358	湖南裕能	100	7,587.00	0.03
455	300001	特锐德	200	7,566.00	0.03
455	003035	南网能源	1,300	7,566.00	0.03
456	300383	光环新网	600	7,464.00	0.03
457	600737	中粮糖业	600	7,398.00	0.03
458	600995	南网储能	600	7,380.00	0.02
459	600588	用友网络	800	7,344.00	0.02
460	300413	芒果超媒	500	7,315.00	0.02
461	600131	国网信通	500	7,300.00	0.02
462	000039	中集集团	900	7,299.00	0.02
463	002027	分众传媒	1,500	7,260.00	0.02
464	000786	北新建材	400	7,236.00	0.02
465	002271	东方雨虹	600	7,122.00	0.02
466	600918	中泰证券	1,300	6,916.00	0.02

467	688425	铁建重工	1,700	6,834.00	0.02
468	601139	深圳燃气	1,200	6,792.00	0.02
469	600027	华电国际	1,500	6,675.00	0.02
470	688819	天能股份	300	6,660.00	0.02
471	600535	天士力	500	6,615.00	0.02
472	601186	中国铁建	1,100	6,545.00	0.02
473	002410	广联达	800	6,528.00	0.02
474	600699	均胜电子	300	6,483.00	0.02
475	002465	海格通信	500	6,385.00	0.02
476	601816	京沪高铁	1,400	6,342.00	0.02
477	601696	中银证券	500	6,325.00	0.02
478	000519	中兵红箭	300	6,321.00	0.02
479	300957	贝泰妮	200	6,302.00	0.02
480	300002	神州泰岳	800	6,248.00	0.02
481	002444	巨星科技	200	6,220.00	0.02
482	300496	中科创达	100	6,179.00	0.02
483	002131	利欧股份	1,300	6,175.00	0.02
484	600704	物产中大	1,300	6,136.00	0.02
485	002466	天齐锂业	100	6,132.00	0.02
486	601127	赛力斯	100	6,125.00	0.02
487	603233	大参林	400	6,012.00	0.02
488	603605	珀莱雅	100	5,992.00	0.02
488	601825	沪农商行	800	5,992.00	0.02
489	001203	大中矿业	200	5,990.00	0.02
490	302132	中航成飞	100	5,832.00	0.02
491	603658	安图生物	200	5,804.00	0.02
492	688538	和辉光电	2,225	5,785.00	0.02
493	000938	紫光股份	200	5,772.00	0.02
494	002335	科华数据	135	5,730.75	0.02
495	300699	光威复材	200	5,730.00	0.02

496	600663	陆家嘴	900	5,652.00	0.02
497	601689	拓普集团	100	5,642.00	0.02
498	601228	广州港	2,000	5,640.00	0.02
499	000831	中国稀土	100	5,549.00	0.02
500	002670	国盛证券	500	5,500.00	0.02
501	601808	中海油服	500	5,405.00	0.02
502	300433	蓝思科技	100	5,366.00	0.02
503	002340	格林美	800	5,288.00	0.02
504	000528	柳工	700	5,285.00	0.02
505	600688	上海石化	1,800	5,274.00	0.02
506	000728	国元证券	700	5,243.00	0.02
507	600511	国药股份	200	5,208.00	0.02
508	300142	沃森生物	400	5,196.00	0.02
509	002709	天赐材料	100	5,143.00	0.02
510	600795	国电电力	1,100	5,137.00	0.02
511	601238	广汽集团	1,000	5,080.00	0.02
512	603486	科沃斯	100	5,075.00	0.02
513	600390	五矿资本	1,100	5,016.00	0.02
514	603596	伯特利	200	4,968.00	0.02
515	300498	温氏股份	400	4,928.00	0.02
516	688349	三一重能	320	4,857.60	0.02
517	002202	金风科技	200	4,780.00	0.02
518	301301	川宁生物	600	4,764.00	0.02
519	000800	一汽解放	800	4,760.00	0.02
520	600380	健康元	500	4,710.00	0.02
521	600009	上海机场	200	4,620.00	0.02
521	002179	中航光电	100	4,620.00	0.02
522	601212	白银有色	900	4,572.00	0.02
523	000959	首钢股份	1,300	4,563.00	0.02
524	600011	华能国际	600	4,554.00	0.02

525	601633	长城汽车	300	4,527.00	0.02
526	603816	顾家家居	200	4,472.00	0.02
527	000709	河钢股份	2,300	4,462.00	0.02
528	603000	人民网	300	4,437.00	0.01
529	600967	内蒙一机	400	4,340.00	0.01
530	600598	北大荒	400	4,336.00	0.01
531	600879	航天电子	200	4,258.00	0.01
532	600655	豫园股份	1,000	4,110.00	0.01
533	000429	粤高速 A	300	4,095.00	0.01
534	601236	红塔证券	600	4,092.00	0.01
535	002230	科大讯飞	100	4,084.00	0.01
536	600483	福能股份	400	4,076.00	0.01
537	301498	乖宝宠物	100	4,059.00	0.01
538	001221	悍高集团	100	4,022.00	0.01
539	600219	南山铝业	1,000	3,990.00	0.01
540	002032	苏泊尔	100	3,960.00	0.01
541	601118	海南橡胶	800	3,936.00	0.01
542	002984	森麒麟	300	3,921.00	0.01
543	000559	万向钱潮	300	3,879.00	0.01
544	002422	科伦药业	100	3,852.00	0.01
545	600048	保利发展	800	3,704.00	0.01
546	000738	航发控制	200	3,658.00	0.01
547	300146	汤臣倍健	400	3,616.00	0.01
548	300003	乐普医疗	300	3,555.00	0.01
549	600435	北方导航	300	3,360.00	0.01
550	300015	爱尔眼科	400	3,304.00	0.01
551	600282	南钢股份	700	3,213.00	0.01
552	600143	金发科技	200	3,090.00	0.01
553	000825	太钢不锈	900	3,069.00	0.01
554	601377	兴业证券	500	3,020.00	0.01

555	603833	欧派家居	100	3,011.00	0.01
556	002603	以岭药业	200	3,000.00	0.01
557	600392	盛和资源	100	2,977.00	0.01
558	603565	中谷物流	300	2,943.00	0.01
559	600873	梅花生物	400	2,940.00	0.01
560	000783	长江证券	300	2,925.00	0.01
561	000537	绿发电力	400	2,924.00	0.01
562	000983	山西焦煤	500	2,900.00	0.01
563	000513	丽珠集团	100	2,889.00	0.01
564	000625	长安汽车	400	2,868.00	0.01
565	601800	中国交建	500	2,855.00	0.01
566	600032	浙江新能	400	2,820.00	0.01
567	600536	中国软件	100	2,812.00	0.01
567	000963	华东医药	100	2,812.00	0.01
568	601958	金钼股份	100	2,811.00	0.01
569	300058	蓝色光标	200	2,752.00	0.01
570	603392	万泰生物	100	2,697.00	0.01
571	600998	九州通	566	2,654.54	0.01
572	600820	隧道股份	500	2,605.00	0.01
573	600038	中直股份	100	2,529.00	0.01
574	002078	太阳纸业	200	2,498.00	0.01
575	000009	中国宝安	400	2,492.00	0.01
576	002624	完美世界	200	2,484.00	0.01
577	600177	雅戈尔	300	2,259.00	0.01
578	600808	马钢股份	900	2,250.00	0.01
579	601611	中国核建	200	2,230.00	0.01
580	600566	济川药业	100	2,219.00	0.01
581	600023	浙能电力	400	2,104.00	0.01
582	001696	宗申动力	100	2,081.00	0.01
583	600415	小商品城	200	2,032.00	0.01

584	603529	爱玛科技	100	1,951.00	0.01
585	603298	杭叉集团	80	1,908.80	0.01
586	002262	恩华药业	100	1,875.00	0.01
587	601928	凤凰传媒	200	1,758.00	0.01
588	000723	美锦能源	500	1,675.00	0.01
589	000088	盐田港	400	1,636.00	0.01
590	600062	华润双鹤	100	1,604.00	0.01
591	600004	白云机场	200	1,452.00	0.00
592	002797	第一创业	200	1,314.00	0.00
593	600352	浙江龙盛	100	1,211.00	0.00
594	000002	万科 A	400	1,184.00	0.00
595	600377	宁沪高速	100	1,157.00	0.00
596	600909	华安证券	100	1,111.00	0.00
597	002085	万丰奥威	100	1,109.00	0.00
598	000582	北部湾港	100	1,073.00	0.00
599	601966	玲珑轮胎	100	1,019.00	0.00
600	601577	长沙银行	100	871.00	0.00
601	600905	三峡能源	200	742.00	0.00
602	000539	粤电力 A	100	681.00	0.00
603	601990	南京证券	100	657.00	0.00
604	601019	山东出版	100	640.00	0.00
605	300144	宋城演艺	100	581.00	0.00
606	600398	海澜之家	100	523.00	0.00
607	000937	冀中能源	10	39.80	0.00

7.3.2 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	688630	芯碁微装	200.00	109,878.00	0.37
2	688536	思瑞浦	300.00	109,227.00	0.37
3	002379	宏桥控股	6,400.00	94,528.00	0.32

4	688127	蓝特光学	500.00	48,800.00	0.16
5	002544	普天科技	2,600.00	47,372.00	0.16
6	600487	亨通光电	400.00	43,736.00	0.15
7	688372	伟测科技	200.00	37,200.00	0.13
8	301479	弘景光电	600.00	36,120.00	0.12
9	002080	中材科技	400.00	36,000.00	0.12
10	603629	利通电子	200.00	35,762.00	0.12
11	300936	中英科技	300.00	33,090.00	0.11
12	301429	森泰股份	2,100.00	32,907.00	0.11
13	300782	卓胜微	300.00	32,874.00	0.11
14	301321	翰博高新	700.00	30,905.00	0.10
15	000829	天音控股	3,900.00	30,420.00	0.10
16	300672	国科微	100.00	29,500.00	0.10
17	301189	奥尼电子	500.00	29,465.00	0.10
18	002497	雅化集团	1,400.00	28,518.00	0.10
19	301328	维峰电子	400.00	28,480.00	0.10
20	605222	起帆电缆	1,200.00	27,984.00	0.09
21	600872	中炬高新	1,600.00	27,776.00	0.09
22	688655	迅捷兴	500.00	26,780.00	0.09
23	002961	瑞达期货	1,300.00	25,454.00	0.09
24	002237	恒邦股份	1,700.00	24,973.00	0.08
25	688309	恒誉环保	400.00	24,352.00	0.08
26	605056	咸亨国际	1,500.00	24,000.00	0.08
27	688230	芯导科技	300.00	23,643.00	0.08
28	688353	华盛锂电	200.00	23,214.00	0.08
29	601231	环旭电子	700.00	22,680.00	0.08
30	301100	风光股份	1,600.00	22,240.00	0.08
31	688388	嘉元科技	490.00	21,560.00	0.07
32	688063	派能科技	400.00	21,308.00	0.07
33	605006	山东玻纤	1,000.00	21,090.00	0.07

34	300689	澄天伟业	300.00	21,054.00	0.07
35	301567	贝隆精密	600.00	20,766.00	0.07
36	301359	东南电子	1,300.00	20,644.00	0.07
37	300814	中富电路	100.00	20,450.00	0.07
38	301616	浙江华业	600.00	20,112.00	0.07
39	301668	昊创瑞通	600.00	19,740.00	0.07
40	688619	罗普特	1,200.00	19,476.00	0.07
41	300055	万邦达	3,000.00	19,290.00	0.07
42	603124	江南新材	100.00	18,698.00	0.06
43	301187	欧圣电气	1,300.00	18,603.00	0.06
44	301386	未来电器	900.00	18,549.00	0.06
45	301387	光大同创	200.00	18,484.00	0.06
46	001337	四川黄金	500.00	18,330.00	0.06
47	300970	华绿生物	1,000.00	18,280.00	0.06
48	301180	万祥科技	1,400.00	17,542.00	0.06
49	301608	博实结	349.00	17,540.74	0.06
50	301389	隆扬电子	200.00	17,358.00	0.06
51	300977	深圳瑞捷	1,100.00	16,962.00	0.06
52	603638	艾迪精密	700.00	16,415.00	0.06
53	300904	威力传动	400.00	16,236.00	0.05
54	301211	亨迪药业	1,400.00	15,848.00	0.05
55	688311	盟升电子	600.00	15,714.00	0.05
56	300843	胜蓝股份	100.00	15,625.00	0.05
57	603406	天富龙	600.00	15,570.00	0.05
58	300808	久量股份	700.00	15,512.00	0.05
59	600418	江淮汽车	600.00	15,498.00	0.05
60	002716	湖南白银	1,900.00	15,371.00	0.05
61	301280	珠城科技	300.00	15,171.00	0.05
62	600683	京投发展	1,300.00	14,950.00	0.05
63	301589	诺瓦星云	100.00	14,898.00	0.05

64	603198	迎驾贡酒	500.00	14,800.00	0.05
65	002772	众兴菌业	1,300.00	14,768.00	0.05
66	301665	泰禾股份	700.00	14,672.00	0.05
67	300286	安科瑞	600.00	14,490.00	0.05
68	301083	百胜智能	1,100.00	14,487.00	0.05
69	300427	红相股份	2,100.00	14,091.00	0.05
70	601061	中信金属	1,300.00	14,001.00	0.05
71	605118	力鼎光电	400.00	13,956.00	0.05
72	301326	捷邦科技	100.00	13,937.00	0.05
73	000603	盛达资源	600.00	13,860.00	0.05
74	300571	平治信息	300.00	13,698.00	0.05
75	301448	开创电气	300.00	13,614.00	0.05
76	600775	南京熊猫	1,400.00	13,384.00	0.05
77	603057	紫燕食品	600.00	13,380.00	0.05
78	002653	海思科	200.00	13,268.00	0.04
79	000426	兴业银锡	400.00	13,184.00	0.04
80	301090	华润材料	2,100.00	13,167.00	0.04
81	600241	时代万恒	2,000.00	12,980.00	0.04
82	000933	神火股份	600.00	12,720.00	0.04
83	301227	森鹰窗业	500.00	12,605.00	0.04
84	002885	京泉华	300.00	12,258.00	0.04
85	301277	新天地	1,400.00	12,250.00	0.04
86	603115	海星股份	100.00	12,247.00	0.04
87	002552	宝鼎科技	200.00	12,200.00	0.04
88	600338	西藏珠峰	800.00	12,192.00	0.04
89	688432	有研硅	300.00	11,991.00	0.04
90	301130	西点药业	500.00	11,990.00	0.04
91	300935	盈建科	400.00	11,736.00	0.04
92	301556	托普云农	200.00	11,692.00	0.04
93	603162	海通发展	1,300.00	11,661.00	0.04

94	688516	奥特维	200.00	11,478.00	0.04
95	301067	显盈科技	300.00	11,346.00	0.04
96	002287	奇正藏药	600.00	11,304.00	0.04
97	301285	鸿日达	100.00	11,033.00	0.04
98	300775	三角防务	500.00	11,020.00	0.04
99	300407	凯发电气	1,000.00	10,800.00	0.04
100	603790	雅运股份	500.00	10,670.00	0.04
101	000810	创维数字	800.00	10,600.00	0.04
102	002484	江海股份	100.00	10,500.00	0.04
103	300034	钢研高纳	600.00	10,284.00	0.03
104	301353	普莱得	610.00	10,132.10	0.03
105	001248	华润新能源	1,000.00	10,110.00	0.03
106	301538	骏鼎达	200.00	10,074.00	0.03
107	300590	移为通信	700.00	10,045.00	0.03
108	688489	三未信安	436.00	9,897.20	0.03
109	002946	新乳业	700.00	9,856.00	0.03
110	301390	经纬股份	300.00	9,678.00	0.03
111	688651	盛邦安全	300.00	9,666.00	0.03
112	603859	能科科技	200.00	9,596.00	0.03
113	002396	星网锐捷	500.00	9,585.00	0.03
114	688231	隆达股份	260.00	9,549.80	0.03
115	301087	可孚医疗	200.00	9,530.00	0.03
116	301372	科净源	300.00	9,453.00	0.03
117	300804	广康生化	300.00	9,378.00	0.03
118	002222	福晶科技	100.00	9,228.00	0.03
119	603380	易德龙	200.00	9,018.00	0.03
120	603285	键邦股份	200.00	8,962.00	0.03
121	300947	德必集团	700.00	8,925.00	0.03
122	300789	唐源电气	500.00	8,885.00	0.03
123	001336	楚环科技	400.00	8,808.00	0.03

124	002468	申通快递	600.00	8,736.00	0.03
125	688262	国芯科技	200.00	8,646.00	0.03
126	300706	阿石创	100.00	8,635.00	0.03
127	301155	海力风电	200.00	8,580.00	0.03
128	300700	岱勒新材	400.00	8,512.00	0.03
129	002969	嘉美包装	600.00	8,448.00	0.03
130	301503	智迪科技	300.00	8,253.00	0.03
131	600323	瀚蓝环境	300.00	8,238.00	0.03
132	300715	凯伦股份	500.00	8,230.00	0.03
133	002400	省广集团	1,300.00	8,203.00	0.03
134	000990	诚志股份	1,000.00	8,180.00	0.03
135	002796	世嘉科技	200.00	8,156.00	0.03
136	603065	宿迁联盛	400.00	8,104.00	0.03
137	688616	西力科技	800.00	8,080.00	0.03
138	002515	金字火腿	800.00	8,008.00	0.03
139	001379	腾达科技	500.00	7,850.00	0.03
140	301056	森赫股份	700.00	7,840.00	0.03
141	300790	宇瞳光学	300.00	7,833.00	0.03
142	300405	科隆股份	1,500.00	7,770.00	0.03
143	002803	吉宏股份	300.00	7,752.00	0.03
144	300050	世纪鼎利	1,300.00	7,696.00	0.03
145	603588	高能环境	400.00	7,680.00	0.03
146	688116	天奈科技	200.00	7,640.00	0.03
147	002947	恒铭达	100.00	7,605.00	0.03
148	301519	舜禹股份	700.00	7,595.00	0.03
148	300858	科拓生物	500.00	7,595.00	0.03
149	002156	通富微电	100.00	7,587.00	0.03
150	002745	木林森	600.00	7,530.00	0.03
151	002079	苏州固锝	500.00	7,515.00	0.03
152	300741	华宝股份	600.00	7,512.00	0.03

153	603042	华脉科技	520.00	7,488.00	0.03
154	301109	军信股份	600.00	7,476.00	0.03
155	300566	激智科技	200.00	7,390.00	0.02
156	002647	仁东控股	700.00	7,308.00	0.02
157	600388	龙净环保	500.00	7,275.00	0.02
157	002724	海洋王	1,500.00	7,275.00	0.02
158	688678	福立旺	300.00	7,251.00	0.02
159	000636	风华高科	100.00	7,224.00	0.02
160	603045	福达合金	100.00	7,139.00	0.02
161	002792	通宇通讯	200.00	7,114.00	0.02
162	688653	康希通信	400.00	6,952.00	0.02
163	300492	华图山鼎	200.00	6,870.00	0.02
164	600645	中源协和	400.00	6,844.00	0.02
165	600216	浙江医药	600.00	6,840.00	0.02
166	603091	众鑫股份	140.00	6,827.80	0.02
167	000586	汇源通信	500.00	6,605.00	0.02
168	301222	浙江恒威	220.00	6,591.20	0.02
169	300865	大宏立	300.00	6,555.00	0.02
170	603317	天味食品	500.00	6,505.00	0.02
171	600773	西藏城投	500.00	6,435.00	0.02
172	688222	成都先导	200.00	6,422.00	0.02
173	001209	洪兴股份	400.00	6,408.00	0.02
174	300855	图南股份	200.00	6,252.00	0.02
175	002478	常宝股份	1,000.00	6,180.00	0.02
175	001314	亿道信息	100.00	6,180.00	0.02
176	002838	道恩股份	200.00	6,124.00	0.02
177	688100	威胜信息	200.00	6,118.00	0.02
178	002134	天津普林	200.00	6,084.00	0.02
179	301173	毓恬冠佳	200.00	5,942.00	0.02
180	001326	联域股份	100.00	5,929.00	0.02

181	301122	采纳股份	200.00	5,882.00	0.02
182	002077	大港股份	300.00	5,787.00	0.02
183	688236	春立医疗	400.00	5,784.00	0.02
184	600726	华电能源	800.00	5,696.00	0.02
185	301192	泰祥股份	300.00	5,670.00	0.02
186	002270	华明装备	300.00	5,655.00	0.02
187	300127	银河磁体	200.00	5,590.00	0.02
188	600420	国药现代	700.00	5,565.00	0.02
188	002534	西子洁能	300.00	5,565.00	0.02
189	002985	北摩高科	200.00	5,540.00	0.02
190	300303	聚飞光电	500.00	5,530.00	0.02
191	000751	锌业股份	900.00	5,508.00	0.02
192	301219	腾远钴业	100.00	5,480.00	0.02
193	000534	万泽股份	200.00	5,472.00	0.02
194	605098	行动教育	100.00	5,416.00	0.02
195	002364	中恒电气	100.00	5,380.00	0.02
196	601033	永兴股份	400.00	5,360.00	0.02
197	002518	科士达	100.00	5,359.00	0.02
198	301049	超越科技	300.00	5,358.00	0.02
199	002970	锐明技术	100.00	5,343.00	0.02
200	603926	铁流股份	300.00	5,307.00	0.02
201	688321	微芯生物	200.00	5,266.00	0.02
202	300184	力源信息	300.00	5,265.00	0.02
203	002106	莱宝高科	300.00	5,256.00	0.02
204	603876	鼎胜新材	200.00	5,202.00	0.02
205	301172	君逸数码	200.00	5,190.00	0.02
206	300389	艾比森	400.00	5,128.00	0.02
207	000581	威孚高科	300.00	5,106.00	0.02
208	000682	东方电子	400.00	5,052.00	0.02
209	300322	硕贝德	200.00	5,040.00	0.02

210	300861	美畅股份	200.00	5,038.00	0.02
211	601677	明泰铝业	300.00	4,980.00	0.02
212	002810	山东赫达	200.00	4,940.00	0.02
213	603421	鼎信通讯	800.00	4,920.00	0.02
214	300371	汇中股份	500.00	4,890.00	0.02
215	002649	博彦科技	600.00	4,884.00	0.02
216	002842	翔鹭钨业	100.00	4,820.00	0.02
217	600123	兰花科创	900.00	4,806.00	0.02
218	300347	泰格医药	100.00	4,800.00	0.02
219	600619	海立股份	300.00	4,755.00	0.02
220	001289	龙源电力	300.00	4,689.00	0.02
221	300357	我武生物	200.00	4,664.00	0.02
221	300337	银邦股份	400.00	4,664.00	0.02
222	603777	来伊份	300.00	4,659.00	0.02
223	002128	电投能源	200.00	4,624.00	0.02
224	300545	联得装备	100.00	4,620.00	0.02
225	301382	蜂助手	100.00	4,600.00	0.02
226	300658	延江股份	400.00	4,572.00	0.02
226	002948	青岛银行	900.00	4,572.00	0.02
227	300153	科泰电源	200.00	4,524.00	0.02
228	300277	汽轮科技	300.00	4,512.00	0.02
229	300583	赛托生物	400.00	4,492.00	0.02
230	688221	前沿生物	200.00	4,480.00	0.02
231	603235	天新药业	200.00	4,450.00	0.02
232	300199	翰宇药业	200.00	4,416.00	0.01
233	601789	宁波建工	1,100.00	4,411.00	0.01
234	688522	纳睿雷达	220.00	4,404.40	0.01
235	601069	西部黄金	200.00	4,400.00	0.01
236	002858	力盛体育	400.00	4,364.00	0.01
237	603200	上海洗霸	100.00	4,336.00	0.01

238	002843	泰嘉股份	200.00	4,294.00	0.01
239	300766	每日互动	200.00	4,280.00	0.01
240	000593	德龙汇能	200.00	4,276.00	0.01
241	301516	中远通	300.00	4,245.00	0.01
242	600703	三安光电	200.00	4,244.00	0.01
243	600509	天富能源	500.00	4,225.00	0.01
244	002595	豪迈科技	90.00	4,194.00	0.01
245	301129	瑞纳智能	200.00	4,174.00	0.01
246	001308	康冠科技	200.00	4,172.00	0.01
247	300098	高新兴	900.00	4,131.00	0.01
248	300283	温州宏丰	200.00	4,110.00	0.01
249	601963	重庆银行	400.00	4,032.00	0.01
250	605299	舒华体育	300.00	4,005.00	0.01
251	603171	税友股份	100.00	3,985.00	0.01
252	000619	海螺新材	900.00	3,960.00	0.01
253	603195	公牛集团	100.00	3,915.00	0.01
254	300300	海峡创新	500.00	3,905.00	0.01
255	601218	吉鑫科技	900.00	3,870.00	0.01
256	002645	华宏科技	140.00	3,851.40	0.01
257	605598	上海港湾	100.00	3,843.00	0.01
258	300659	中孚信息	400.00	3,800.00	0.01
259	300540	蜀道装备	100.00	3,790.00	0.01
260	300310	宜通世纪	900.00	3,753.00	0.01
261	002245	蔚蓝锂芯	200.00	3,742.00	0.01
262	603237	五芳斋	300.00	3,714.00	0.01
263	603311	金海高科	100.00	3,665.00	0.01
264	300428	立中集团	200.00	3,636.00	0.01
265	603366	日出东方	500.00	3,635.00	0.01
266	603093	南华期货	200.00	3,630.00	0.01
267	603337	杰克科技	100.00	3,623.00	0.01

268	300378	鼎捷数智	100.00	3,610.00	0.01
269	300150	世纪瑞尔	900.00	3,573.00	0.01
270	600702	舍得酒业	100.00	3,555.00	0.01
271	002876	三利谱	100.00	3,521.00	0.01
272	002339	积成电子	500.00	3,465.00	0.01
273	002541	鸿路钢构	200.00	3,464.00	0.01
274	002218	拓日新能	900.00	3,456.00	0.01
275	601918	新集能源	400.00	3,436.00	0.01
276	300986	志特新材	200.00	3,430.00	0.01
277	600877	电科芯片	200.00	3,426.00	0.01
278	600916	中国黄金	500.00	3,420.00	0.01
278	300032	金龙机电	900.00	3,420.00	0.01
279	600391	航发科技	100.00	3,345.00	0.01
280	002705	新宝股份	300.00	3,324.00	0.01
280	002043	兔宝宝	300.00	3,324.00	0.01
281	603836	海程邦达	420.00	3,318.00	0.01
282	301272	英华特	100.00	3,294.00	0.01
283	600552	凯盛科技	100.00	3,258.00	0.01
284	300945	曼卡龙	300.00	3,249.00	0.01
285	002545	东方铁塔	200.00	3,244.00	0.01
286	600961	株冶集团	100.00	3,239.00	0.01
287	300101	振芯科技	200.00	3,234.00	0.01
288	600623	华谊集团	400.00	3,228.00	0.01
289	300774	倍杰特	300.00	3,225.00	0.01
290	300327	中颖电子	100.00	3,205.00	0.01
291	600410	华胜天成	200.00	3,166.00	0.01
292	300872	天阳科技	200.00	3,160.00	0.01
293	000869	张裕 A	200.00	3,116.00	0.01
294	301138	华研精机	100.00	3,100.00	0.01
294	300736	百邦科技	100.00	3,100.00	0.01

295	300853	申昊科技	100.00	3,089.00	0.01
296	603868	飞科电器	100.00	3,080.00	0.01
297	600468	百利电气	500.00	3,035.00	0.01
298	002034	旺能环境	200.00	3,030.00	0.01
299	002566	益盛药业	500.00	3,020.00	0.01
300	300940	南极光	200.00	3,016.00	0.01
301	002730	电光科技	100.00	2,991.00	0.01
302	301175	中科环保	600.00	2,970.00	0.01
303	300319	麦捷科技	100.00	2,963.00	0.01
304	000700	模塑科技	200.00	2,952.00	0.01
305	300812	易天股份	100.00	2,931.00	0.01
306	002956	西麦食品	140.00	2,906.40	0.01
307	002297	博云新材	100.00	2,899.00	0.01
308	300681	英搏尔	100.00	2,862.00	0.01
309	002284	亚太股份	300.00	2,847.00	0.01
310	002928	华夏航空	400.00	2,796.00	0.01
311	300298	三诺生物	200.00	2,790.00	0.01
312	300222	科大智能	200.00	2,770.00	0.01
313	603025	大豪科技	200.00	2,728.00	0.01
314	603105	芯能科技	400.00	2,724.00	0.01
315	600397	江钨装备	100.00	2,723.00	0.01
316	601168	西部矿业	100.00	2,714.00	0.01
317	300435	中泰股份	100.00	2,707.00	0.01
318	002437	誉衡药业	1,000.00	2,700.00	0.01
319	603551	奥普科技	300.00	2,697.00	0.01
320	600108	亚盛集团	900.00	2,664.00	0.01
321	300490	华自科技	200.00	2,646.00	0.01
322	605196	华通线缆	100.00	2,610.00	0.01
323	301501	恒鑫生活	100.00	2,602.00	0.01
324	300189	神农种业	600.00	2,592.00	0.01

325	002862	实丰文化	200.00	2,566.00	0.01
326	300217	东方电热	600.00	2,562.00	0.01
327	300810	中科海讯	100.00	2,538.00	0.01
328	000923	河钢资源	200.00	2,482.00	0.01
329	002448	中原内配	200.00	2,460.00	0.01
330	601890	亚星锚链	300.00	2,451.00	0.01
331	601777	千里科技	300.00	2,448.00	0.01
332	300444	双杰电气	200.00	2,442.00	0.01
333	603059	倍加洁	100.00	2,425.00	0.01
334	300164	通源石油	300.00	2,400.00	0.01
335	300830	金现代	300.00	2,382.00	0.01
336	301108	洁雅股份	100.00	2,359.00	0.01
337	600780	通宝能源	400.00	2,344.00	0.01
338	600428	中远海特	300.00	2,343.00	0.01
338	002587	奥拓电子	300.00	2,343.00	0.01
339	301388	欣灵电气	100.00	2,332.00	0.01
340	600201	生物股份	200.00	2,330.00	0.01
341	600268	国电南自	200.00	2,324.00	0.01
342	000410	沈阳机床	500.00	2,320.00	0.01
343	300016	北陆药业	300.00	2,301.00	0.01
344	603511	爱慕股份	200.00	2,300.00	0.01
345	301216	万凯新材	100.00	2,299.00	0.01
346	300680	隆盛科技	100.00	2,272.00	0.01
347	601388	怡球资源	800.00	2,264.00	0.01
348	000685	中山公用	200.00	2,232.00	0.01
349	002654	万润科技	100.00	2,226.00	0.01
350	300370	安控科技	1,100.00	2,222.00	0.01
351	002358	森源电气	400.00	2,220.00	0.01
352	002668	TCL 智家	200.00	2,216.00	0.01
353	002167	东方锆业	100.00	2,207.00	0.01

354	002952	亚世光电	100.00	2,203.00	0.01
355	002328	新朋股份	300.00	2,202.00	0.01
356	600331	宏达股份	200.00	2,198.00	0.01
357	301036	双乐股份	100.00	2,193.00	0.01
358	300443	金雷股份	100.00	2,158.00	0.01
359	002373	千方科技	300.00	2,154.00	0.01
360	605028	世茂能源	100.00	2,130.00	0.01
361	300911	亿田智能	100.00	2,125.00	0.01
361	300880	迦南智能	100.00	2,125.00	0.01
361	000930	中粮科技	500.00	2,125.00	0.01
362	300201	海伦哲	100.00	2,107.00	0.01
363	002782	可立克	100.00	2,105.00	0.01
364	300130	新国都	100.00	2,104.00	0.01
365	002104	恒宝股份	200.00	2,062.00	0.01
366	603871	嘉友国际	200.00	2,042.00	0.01
367	301578	辰奕智能	100.00	2,039.00	0.01
368	300565	科信技术	200.00	2,036.00	0.01
369	000420	吉林化纤	500.00	2,025.00	0.01
370	600959	江苏有线	700.00	2,023.00	0.01
371	600075	新疆天业	500.00	2,020.00	0.01
372	000592	平潭发展	300.00	2,007.00	0.01
373	600925	苏能股份	500.00	2,005.00	0.01
374	300756	金马游乐	60.00	1,983.00	0.01
375	000758	中色股份	300.00	1,971.00	0.01
376	002255	海陆重工	200.00	1,964.00	0.01
377	600416	湘电股份	200.00	1,960.00	0.01
378	600389	江山股份	100.00	1,952.00	0.01
379	300813	泰林生物	100.00	1,909.00	0.01
380	300149	睿智医药	200.00	1,908.00	0.01
381	002408	齐翔腾达	400.00	1,876.00	0.01

382	603619	中曼石油	100.00	1,871.00	0.01
383	002467	二六三	400.00	1,868.00	0.01
384	300740	水羊股份	100.00	1,841.00	0.01
385	300113	顺网科技	100.00	1,821.00	0.01
386	002757	南兴股份	100.00	1,805.00	0.01
387	600328	中盐化工	300.00	1,800.00	0.01
388	600236	桂冠电力	200.00	1,756.00	0.01
389	000601	韶能股份	300.00	1,755.00	0.01
390	603960	克来机电	100.00	1,741.00	0.01
391	600502	安徽建工	400.00	1,740.00	0.01
392	300082	奥克股份	200.00	1,726.00	0.01
393	002734	利民股份	100.00	1,717.00	0.01
394	603185	弘元绿能	100.00	1,669.00	0.01
395	600480	凌云股份	200.00	1,662.00	0.01
396	605218	伟时电子	100.00	1,653.00	0.01
397	300351	永贵电器	100.00	1,650.00	0.01
398	603829	洛凯股份	100.00	1,637.00	0.01
399	600761	安徽合力	100.00	1,636.00	0.01
400	603515	欧普照明	100.00	1,634.00	0.01
401	600722	金牛化工	200.00	1,624.00	0.01
401	300363	博腾股份	100.00	1,624.00	0.01
402	301370	国科恒泰	200.00	1,618.00	0.01
403	601969	海南矿业	200.00	1,582.00	0.01
404	000552	甘肃能化	700.00	1,568.00	0.01
405	301601	惠通科技	100.00	1,562.00	0.01
406	002063	远光软件	300.00	1,530.00	0.01
407	300170	汉得信息	100.00	1,524.00	0.01
408	301110	青木科技	40.00	1,514.40	0.01
409	000543	皖能电力	200.00	1,514.00	0.01
410	605399	晨光新材	100.00	1,469.00	0.00

411	002169	智光电气	100.00	1,464.00	0.00
412	002017	东信和平	100.00	1,463.00	0.00
413	300743	天地数码	100.00	1,459.00	0.00
414	000099	中信海直	100.00	1,456.00	0.00
415	000973	佛塑科技	100.00	1,435.00	0.00
416	001208	华菱线缆	100.00	1,419.00	0.00
417	600986	浙文互联	200.00	1,396.00	0.00
417	600839	四川长虹	200.00	1,396.00	0.00
417	000922	佳电股份	100.00	1,396.00	0.00
418	300768	迪普科技	100.00	1,377.00	0.00
419	002606	大连电瓷	100.00	1,341.00	0.00
420	000917	电广传媒	200.00	1,338.00	0.00
421	600230	沧州大化	100.00	1,302.00	0.00
421	002998	优彩资源	200.00	1,302.00	0.00
422	000801	四川九洲	100.00	1,294.00	0.00
423	300121	阳谷华泰	100.00	1,260.00	0.00
424	002457	青龙管业	100.00	1,223.00	0.00
425	603118	共进股份	100.00	1,211.00	0.00
426	002324	普利特	100.00	1,207.00	0.00
427	601965	中国汽研	100.00	1,196.00	0.00
428	603527	众源新材	100.00	1,192.00	0.00
429	603803	瑞斯康达	100.00	1,174.00	0.00
430	300088	长信科技	100.00	1,160.00	0.00
431	000612	焦作万方	100.00	1,059.00	0.00
432	300219	鸿利智汇	100.00	1,043.00	0.00
433	300417	南华仪器	100.00	1,026.00	0.00
434	002440	闰土股份	100.00	1,025.00	0.00
435	600633	浙数文化	100.00	1,018.00	0.00
436	002181	粤传媒	100.00	995.00	0.00
437	600577	精达股份	100.00	978.00	0.00

438	002283	天润工业	100.00	965.00	0.00
439	300694	蠡湖股份	100.00	960.00	0.00
440	688119	中钢洛耐	200.00	950.00	0.00
441	002941	新疆交建	100.00	944.00	0.00
442	300800	力合科技	100.00	925.00	0.00
443	600395	盘江股份	200.00	912.00	0.00
444	002418	康盛股份	200.00	788.00	0.00
445	002041	登海种业	100.00	787.00	0.00
446	000404	长虹华意	100.00	786.00	0.00
447	000905	厦门港务	100.00	776.00	0.00
448	002040	南京港	100.00	745.00	0.00
449	002160	常铝股份	200.00	732.00	0.00
450	603707	健友股份	100.00	707.00	0.00
451	300466	赛摩智能	100.00	704.00	0.00
452	300663	科蓝软件	100.00	666.00	0.00
452	000892	欢瑞世纪	200.00	666.00	0.00
453	603980	吉华集团	100.00	664.00	0.00
453	600903	贵州燃气	100.00	664.00	0.00
454	002405	四维图新	100.00	647.00	0.00
455	002685	华东重机	100.00	646.00	0.00
456	600740	山西焦化	200.00	638.00	0.00
457	601226	华电科工	100.00	636.00	0.00
458	000571	新大洲 A	100.00	633.00	0.00
459	002320	海峡股份	100.00	627.00	0.00
460	300226	上海钢联	40.00	612.40	0.00
461	600841	动力新科	100.00	610.00	0.00
462	603609	禾丰股份	100.00	576.00	0.00
463	000958	电投产融	100.00	564.00	0.00
464	600116	三峡水利	100.00	560.00	0.00
464	300296	利亚德	100.00	560.00	0.00

465	600746	江苏索普	100.00	523.00	0.00
466	000978	桂林旅游	100.00	522.00	0.00
467	600864	哈投股份	100.00	519.00	0.00
468	600163	中闽能源	100.00	515.00	0.00
469	601107	四川成渝	100.00	488.00	0.00
470	600720	中交设计	100.00	482.00	0.00
471	300182	捷成股份	100.00	475.00	0.00
472	002225	濮耐股份	100.00	473.00	0.00
473	000690	宝新能源	100.00	470.00	0.00
474	300048	合康新能	100.00	467.00	0.00
475	600229	城市传媒	100.00	464.00	0.00
476	600149	廊坊发展	100.00	449.00	0.00
477	002355	兴民智通	100.00	430.00	0.00
478	300079	数码视讯	100.00	420.00	0.00
479	002666	德联集团	100.00	395.00	0.00
480	600979	广安爱众	100.00	391.00	0.00
481	000778	新兴铸管	100.00	371.00	0.00
482	000757	浩物股份	100.00	341.00	0.00
483	300074	华平股份	100.00	340.00	0.00
484	600716	凤凰股份	100.00	336.00	0.00
485	601333	广深铁路	100.00	275.00	0.00
486	002589	瑞康医药	100.00	246.00	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	300308	中际旭创	1,106,819.00	1.96
2	300750	宁德时代	857,746.00	1.52
3	600690	海尔智家	672,376.00	1.19
4	300223	北京君正	615,236.00	1.09

5	002415	海康威视	589,392.00	1.04
6	600887	伊利股份	563,226.00	1.00
7	600919	江苏银行	555,250.00	0.98
8	601838	成都银行	549,717.00	0.97
9	601128	常熟银行	546,166.00	0.97
10	000333	美的集团	523,274.00	0.93
11	601899	紫金矿业	495,651.00	0.88
12	600000	浦发银行	493,123.00	0.87
13	002475	立讯精密	465,932.00	0.83
14	002738	中矿资源	451,592.00	0.80
15	002128	电投能源	449,313.00	0.80
16	002966	苏州银行	443,553.00	0.79
17	300604	长川科技	439,845.00	0.78
18	601077	渝农商行	435,447.00	0.77
19	600519	贵州茅台	430,779.00	0.76
20	000001	平安银行	420,190.00	0.74

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	300750	宁德时代	1,810,256.00	3.21
2	300308	中际旭创	1,012,071.00	1.79
3	000333	美的集团	984,332.00	1.74
4	601899	紫金矿业	951,199.00	1.68
5	601318	中国平安	848,722.00	1.50
6	000001	平安银行	790,814.00	1.40
7	600036	招商银行	757,222.00	1.34
8	600183	生益科技	745,805.00	1.32
9	002475	立讯精密	735,986.00	1.30
10	601128	常熟银行	725,504.00	1.28

11	002415	海康威视	723,619.00	1.28
12	600519	贵州茅台	688,003.00	1.22
13	601838	成都银行	669,408.00	1.19
14	600690	海尔智家	650,798.00	1.15
15	300223	北京君正	641,469.00	1.14
16	600926	杭州银行	624,603.00	1.11
17	600887	伊利股份	606,025.00	1.07
18	002966	苏州银行	588,068.00	1.04
19	600919	江苏银行	561,531.00	0.99
20	300408	三环集团	559,595.60	0.99

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	114,194,612.65
卖出股票收入（成交）总额	141,212,681.95

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	1,000.05	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,000.05	0.00

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	113704	春风转债	10	1,000.05	0.00
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金为指数增强型基金，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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末无国债期货投资。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货投资。

7.12 本报告期投资基金情况

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

本基金本报告期末未持有基金。

7.13 投资组合报告附注

7.13.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，江苏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。

7.13.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同约定的备选股票库。

7.13.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	171,410.40
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	56,051.53
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	227,461.93

7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.13.5.1 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。

7.13.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

7.13.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基 金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比 例	持有份额	占总份额比 例
华夏中证 800 指数增强 A	649	19,379.46	-	-	12,577,267.15	100.00%

华夏中证 800 指数增强 C	994	10,129.71	-	-	10,068,934.52	100.00%
合计	1,643	13,783.45	-	-	22,646,201.67	100.00%

注：本章节持有人户数合计按份额级别汇总，未予以合并别重。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	华夏中证 800 指数增强 A	367,562.30	2.92%
	华夏中证 800 指数增强 C	-	-
	合计	367,562.30	1.62%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	华夏中证 800 指数增强 A	0
	华夏中证 800 指数增强 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	华夏中证 800 指数增强 A	10~50
	华夏中证 800 指数增强 C	0
	合计	10~50

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华夏中证 800 指数增强 A	华夏中证 800 指数增强 C
基金合同生效日（2023 年 3 月 30 日）基金份额总额	99,110,008.26	140,198,107.68
本报告期期初基金份额总额	22,839,939.02	24,889,489.46
本报告期基金总申购份额	10,748,593.21	10,384,061.82
减：本报告期基金总赎回份额	21,011,265.08	25,204,616.76
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	12,577,267.15	10,068,934.52

§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。

2026 年 6 月，樊玲同志担任上海银行股份有限公司资产托管部见习总经理助理。上述人事变动已进行备案、公告。

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。

报告期内未发生涉及基金财产、基金托管业务的重大诉讼。

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，本基金托管人的托管业务部门无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，本基金托管人的分管公募基金托管业务的高级管理人员无受调查或处罚等情况。

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	
东海证券	4	255,397,184.60	100.00%	23,207.75	100.00%	-

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，本基金本报告期末选择其他交易单元作为本基金交易单元。

⑤本报告期内，本基金租用的券商交易单元未发生变更。

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
东海证券	2,287.51	100.00%	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-06-26

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

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

12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

12.3 查阅方式

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

华夏基金管理有限公司

二〇二六年八月三十一日