

**华夏中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金
联接基金**

(原华夏中证 A500 指数证券投资基金转型)

2024 年第 4 季度报告

2024 年 12 月 31 日

基金管理人：华夏基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二五年一月二十二日

§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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 1 月 20 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。

华夏中证 A500 指数证券投资基金于 2024 年 11 月 15 日发布《华夏基金管理有限公司关于华夏中证 A500 指数证券投资基金转型为华夏中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金并修订基金合同的公告》，自 2024 年 11 月 18 日起，华夏中证 A500 指数证券投资基金转型为“华夏中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金”。

华夏中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金报告期自 2024 年 11 月 18 日起至 2024 年 12 月 31 日止，原华夏中证 A500 指数证券投资基金报告期自 2024 年 10 月 31 日起至 2024 年 11 月 17 日止。如无特殊说明，本报告中“本基金”指华夏中证 A500 指数证券投资基金及华夏中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金。

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 2024 年 10 月 31 日起至 12 月 31 日止。

§2 基金产品概况

2.1 基金产品概况

2.1.1 华夏中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

基金简称	华夏中证 A500ETF 联接		
基金主代码	022430		
交易代码	022430		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2024 年 11 月 18 日		
报告期末基金份额总额	4,540,478,205.99 份		
投资目标	通过对目标 ETF 基金份额的投资，追求跟踪标的指数，获得与指数收益相似的回报。本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。		
投资策略	主要投资策略包括目标 ETF 投资策略、股票投资策略，存托凭证投资策略，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，参与融资及转融通证券出借业务策略等。		
业绩比较基准	中证 A500 指数收益率×95%+人民币活期存款税后利率×5%		
风险收益特征	本基金为目标 ETF 的联接基金，目标 ETF 为股票型指数基金，因此本基金的预期风险与预期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	招商银行股份有限公司		
下属分级基金的基金简称	华夏中证 A500ETF 联接 A	华夏中证 A500ETF 联接 C	华 夏 中 证 A500ETF 联接 Y
下属分级基金的交易代码	022430	022431	022979
报告期末下属分级基金的份额总额	1,670,945,876.70 份	2,831,276,845.48 份	38,255,483.81 份

2.1.1.1 目标基金基本情况

基金名称	华夏中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	512050
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2024 年 11 月 8 日
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2024 年 11 月 15 日
基金管理人名称	华夏基金管理有限公司
基金托管人名称	招商银行股份有限公司

2.1.1.2 目标基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。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，存托凭证投资策略，金融衍生品投资策略，债券投资策略，可转换债券、可交换债券投资策略，资产支持证券投资策略，融资、转融通证券出借业务投资策略等。
业绩比较基准	中证 A500 指数收益率
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

2.1.2 华夏中证 A500 指数证券投资基金

基金简称	华夏中证 A500 指数
基金主代码	022430
交易代码	022430
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2024 年 10 月 31 日
报告期末基金份额总额	3,059,760,248.75 份
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，实现与标的指数表现相一致的长期投资收益。在正常市场情况下，力争控制本基金的份额净值与业绩比较基准的收益率日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。
投资策略	主要投资策略包括股票投资策略，存托凭证投资策略，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，参与融资及转融通证券出借业务策略等。	
业绩比较基准	中证 A500 指数收益率×95%+人民币活期存款税后利率×5%	
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期风险与预期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	招商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	华夏中证 A500 指数 A	华夏中证 A500 指数 C
下属分级基金的交易代码	022430	022431
报告期末下属分级基金的份额总额	993,388,046.27 份	2,066,372,202.48 份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

3.1.1 华夏中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

单位：人民币元

主要财务指标	报告期 (2024年11月18日-2024年12月31日)		
	华夏中证A500ETF联接A	华夏中证A500ETF联接C	华夏中证A500ETF联接Y
1.本期已实现收益	-22,998,290.70	-48,213,551.02	2,320.48
2.本期利润	-21,116,479.24	-38,974,978.43	-277,741.85
3.加权平均基金份额	-0.0172	-0.0158	-0.0146

本期利 润			
4.期末 基金资 产净值	1,611,593,419.44	2,729,337,345.72	36,894,953.12
5.期末 基金份 额净值	0.9645	0.9640	0.9644

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自 2024 年 11 月 18 日起，“华夏中证 A500 指数证券投资基金”正式转型为“华夏中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金”，自同日起，华夏中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同生效。

④本基金自 2024 年 12 月 13 日增加 Y 类基金份额类别。
3.1.2 华夏中证 A500 指数证券投资基金

单位：人民币元

主要财务 指标	报告期 (2024 年 10 月 31 日-2024 年 11 月 17 日)	
	华夏中证A500指数A	华夏中证 A500 指数 C
1. 本期已 实现收益	-137,444.53	-590,873.05
2. 本期利 润	-20,191,928.15	-42,763,526.44
3. 加权平 均基金份 额本期利	-0.0207	-0.0203

润		
4. 期末基金资产净值	973,082,801.40	2,023,853,727.01
5. 期末基金份额净值	0.9796	0.9794

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自 2024 年 11 月 18 日起，“华夏中证 A500 指数证券投资基金”正式转型为“华夏中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金”，自同日起，华夏中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同生效。

④本基金合同于 2024 年 10 月 31 日生效。

3.2 基金净值表现

3.2.1 华夏中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

（报告期：2024年11月18日-2024年12月31日）

3.2.1.1 本报告期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A500ETF联接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
自基金转型起至今	-1.54%	0.98%	-1.59%	1.00%	0.05%	-0.02%

华夏中证A500ETF联接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
----	--------	-----------	------------	---------------	-----	-----

自基金转 型起至今	-1.57%	0.98%	-1.59%	1.00%	0.02%	-0.02%
--------------	--------	-------	--------	-------	-------	--------

华夏中证A500ETF联接Y:

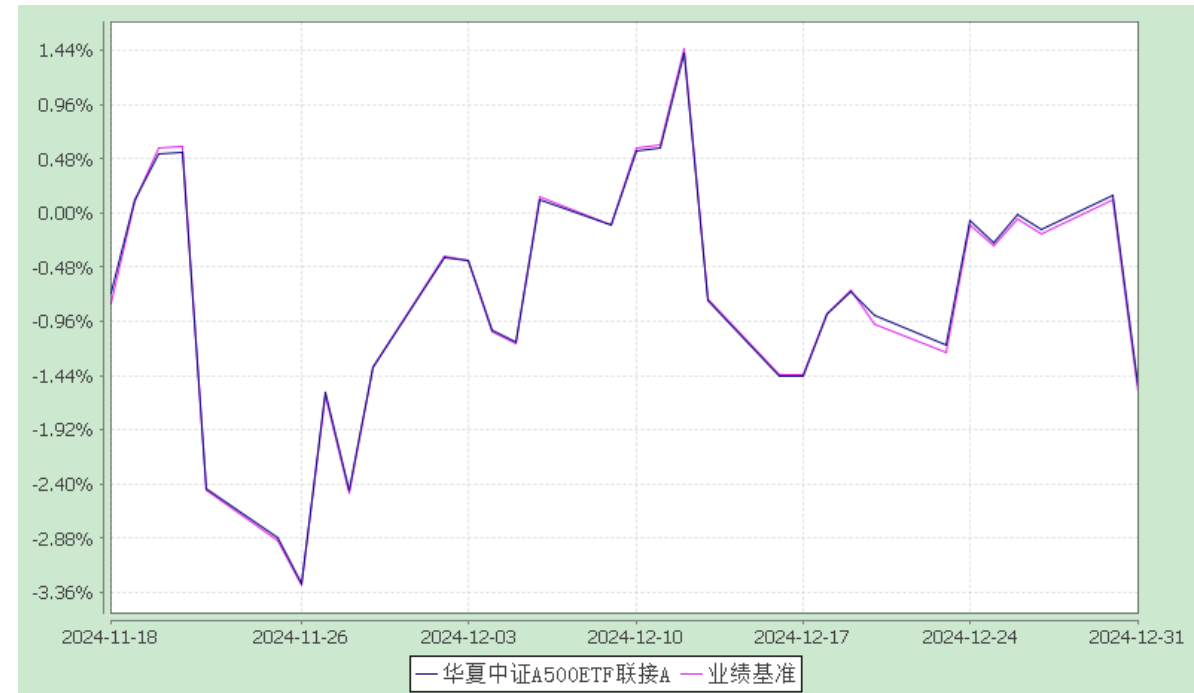
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
自新增份额类别以来至今	-0.78%	0.68%	-0.84%	0.70%	0.06%	-0.02%

注：本基金自 2024 年 12 月 13 日增加 Y 类基金份额类别。

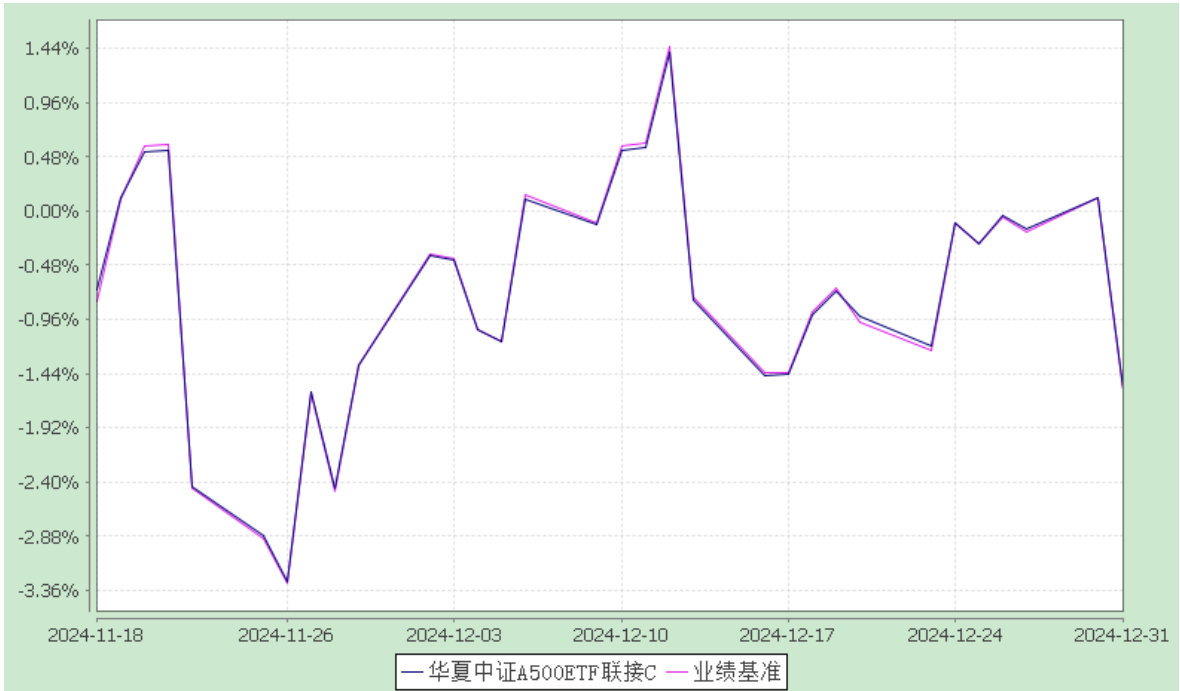
3.2.1.2自基金转型以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华夏中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金
基金份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2024 年 11 月 18 日至 2024 年 12 月 31 日)

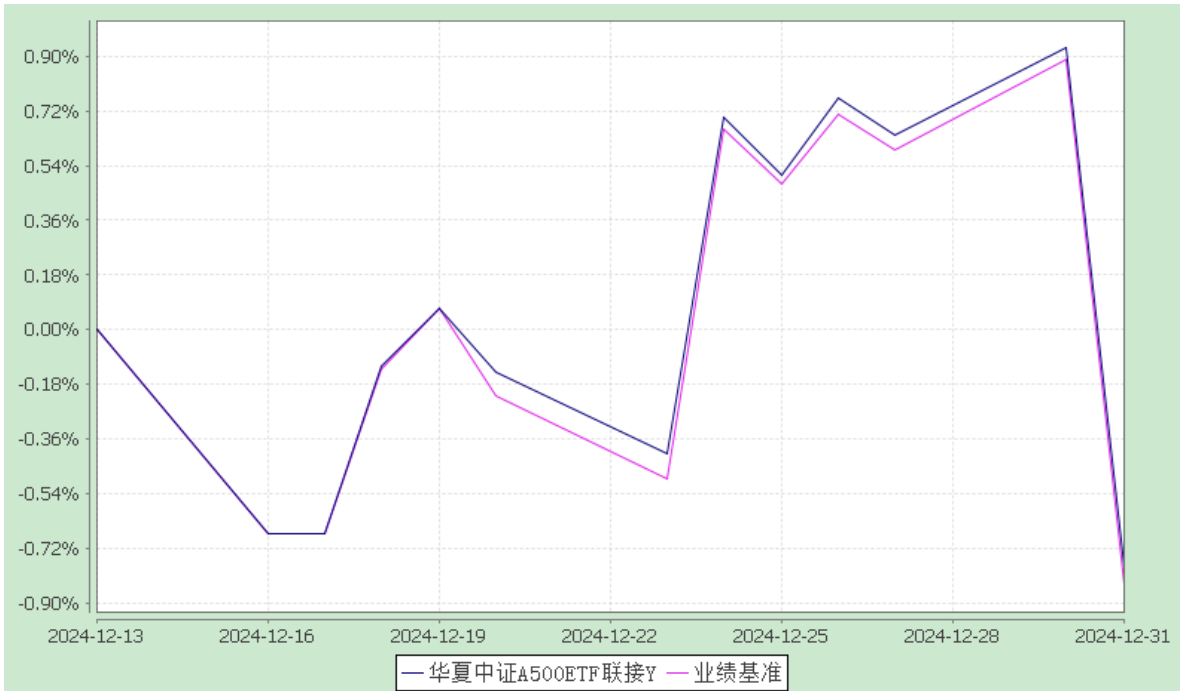
华夏中证 A500ETF 联接 A:



华夏中证 A500ETF 联接 C:



华夏中证 A500ETF 联接 Y:



注：本基金自 2024 年 12 月 13 日增加 Y 类基金份额类别。

①本基金自 2024 年 11 月 18 日起由"华夏中证 A500 指数证券投资基金"转型而来。

②根据本基金的基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同中投资范围、投资限制的有关约定。

3.2.2 华夏中证 A500 指数证券投资基金

（报告期：2024年10月31日-2024年11月17日）

3.2.2.1 本报告期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A500指数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
自基金合同生效起至 2024 年 11 月 17 日	-2.04%	0.64%	1.74%	1.41%	-3.78%	-0.77%

华夏中证A500指数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
自基金合同生效起至 2024 年 11 月 17 日	-2.06%	0.64%	1.74%	1.41%	-3.80%	-0.77%

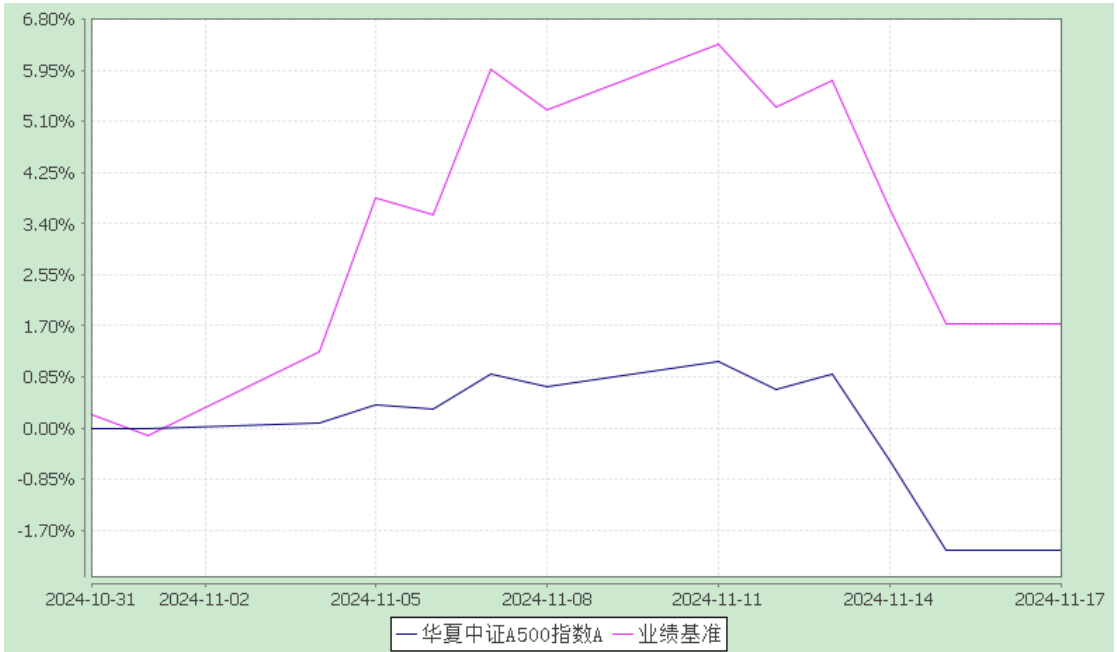
3.2.2.2 自基金合同生效日以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华夏中证 A500 指数证券投资基金

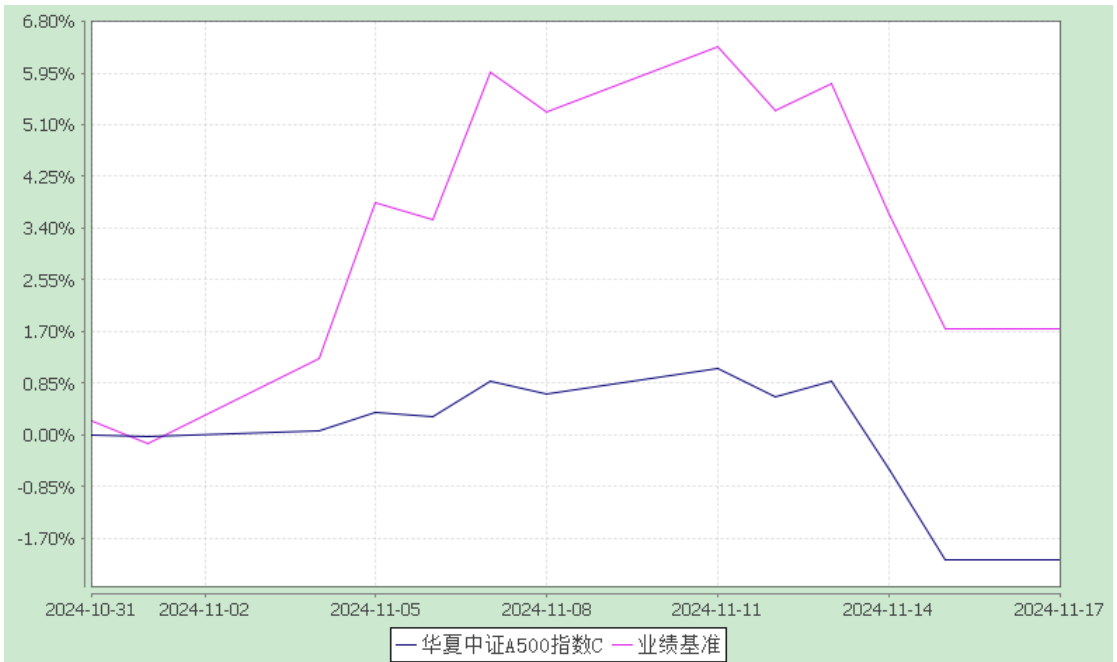
累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2024 年 10 月 31 日-2024 年 11 月 17 日)

华夏中证 A500 指数 A:



华夏中证 A500 指数 C:



注：①本基金合同于 2024 年 10 月 31 日生效。

②根据本基金的基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同中投资范围、投资限制的有关约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

4.1.1 华夏中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

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		
李俊	本基金的基金经理	2024-11-18	-	16 年	硕士。曾任职于北京市金杜律师事务所证券部。2008 年 12 月加入华夏基金管理有限公司。历任数量投资部研究员、基金经理助理、华夏新趋势灵活配置混合型证券投资基金基金经理（2018 年 1 月 17 日至 2021 年 5 月 26 日期间）、华夏新锦绣灵活配置混合型证券投资基金基金经理(2019 年 1 月 31 日至 2021 年 5 月 26 日期间)、华夏中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2019 年 9 月 17 日至 2021 年 12 月 13 日期间）、华夏中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理（2020 年 4 月 3 日至 2021 年 12 月 13 日期间）、上证金融地产交易型开放式指数发起式证券投资基

					<div>金基金经理 (2017 年 12 月 11 日至 2022 年 3 月 14 日期间)、华夏中证智能汽车主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理 (2021 年 5 月 13 日至 2022 年 8 月 22 日期间)、上证医药卫生交易型开放式指数发起式证券投资基金基金经理 (2021 年 5 月 27 日至 2022 年 8 月 22 日期间)、华夏中证农业主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理(2021 年 12 月 29 日至 2024 年 5 月 31 日期间)、华夏中证新能源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 12 月 27 日至 2024 年 5 月 31 日期间)、华夏中证物联网主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理 (2021 年 7 月 22 日至 2024 年 11 月 7 日期</div>
--	--	--	--	--	---

					间)、华夏中证 A500 指数证券投资基金基金经理（2024 年 10 月 31 日至 2024 年 11 月 17 日期间)等。
--	--	--	--	--	---

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

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

4.1.2 华夏中证 A500 指数证券投资基金

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		
李俊	本基金的基金经理	2024-10-31	2024-11-17	16 年	硕士。曾任职于北京市金杜律师事务所证券部。2008 年 12 月加入华夏基金管理有限公司。历任数量投资部研究员、基金经理助理、华夏新趋势灵活配置混合型证券投资基金基金经理（2018 年 1 月 17 日至 2021 年 5 月 26 日期间）、华夏新锦绣灵活配置混合型证券投资基金基金经理(2019 年 1 月 31 日至 2021 年 5 月 26 日期间)、华夏中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金基金经理

					<div>（2019 年 9 月 17 日至 2021 年 12 月 13 日期间）、华夏中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理（2020 年 4 月 3 日至 2021 年 12 月 13 日期间）、上证金融地产交易型开放式指数发起式证券投资基金基金经理（2017 年 12 月 11 日至 2022 年 3 月 14 日期间）、华夏中证智能汽车主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2021 年 5 月 13 日至 2022 年 8 月 22 日期间）、上证医药卫生交易型开放式指数发起式证券投资基金基金经理（2021 年 5 月 27 日至 2022 年 8 月 22 日期间）、华夏中证农业主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2021 年 12 月 29 日至 2024 年 5 月 31 日期间）、华夏</div>
--	--	--	--	--	---

					中证新能源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 12 月 27 日至 2024 年 5 月 31 日期间）、华夏中证物联网主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2021 年 7 月 22 日至 2024 年 11 月 7 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遵规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《基金管理公司开展投资、研究活动防控内幕交易指导意见》等法律法规和基金合同，本着诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在严格控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 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 26 次,其中 25 次为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易,其余 1 次为不同基金经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易,有关基金经理已根据基金管理要求提供决策依据。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

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 A500 指数,该指数从各行业选取市值较大、流动性较好的 500 只证券作为指数样本,以反映各行业最具代表性上市公司证券的整体表现。本基金通过交易所买卖或申购赎回的方式投资于目标 ETF(华夏中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金),从而实现基金投资目标,基金也可以通过买入中证 A500 指数成份股来跟踪标的指数。

4 季度,国际环境依然复杂。俄乌战火未熄,中东硝烟再起,其他地区也并不平静;特朗普在美国大选中胜出,美国即将进入特朗普 2.0 时代。国际环境日趋复杂,不稳定性不确定性明显增加。我国发展仍处于重要战略机遇期,但机遇和挑战都有新的发展变化。这也意味着我们在面临发展问题的同时,安全性的重要性与紧迫性日益抬升。美联储在 9 月份开启降息后继续降息,但特朗普施政纲领带来的通胀预期也给美联储的降息节奏带来了扰动。

国内方面,9 月底以来的政策力度与抢出口对于经济会有一定的提振作用,但有效需求不足依然是中长期的症结所在。12 月中旬召开了中央经济工作会议,分析了当前的经济形势,为 2025 年经济工作指明方向,内容涉及财政、货币、消费、投资、外贸、房地产、金融市场等诸多方面。整体方向上,这次会议既锚定长远高质量发展的目标任务,又充分考虑当前面临的机遇挑战。政策基调上看:空间打开,保持弹性,明年要实施更加积极的财政政策,确保财政政策持续用力、更加给力;基本情形下温和维稳,从通稿来看,整体思想还在于稳;特别情势下相机抉择,为政策的发力留有空间。从着力方向看,大力提振消费、扩内需被放在明年重点工作之首。

市场方面,在 9 月底市场大幅上涨之后,随着特朗普胜选,未来中美经贸关系的不确定性增强,同时美国的再通胀预期提升也对美联储的降息节奏带来新的扰动,市场的波动进一步抬升,但市场的热度仍然还在。

基金投资运作方面,作为被动指数基金,本基金主要采取复制指数的投资策略,报告期内,本基金完成了新基金的建仓,并在做好跟踪标的指数的基础上,认真应对投资者日常申

购、赎回等工作。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

转型前,截至 2024 年 11 月 17 日,原华夏中证 A500 指数 A 基金份额净值为 0.9796 元,2024 年 10 月 31 日至 2024 年 11 月 17 日期间份额净值增长率为-2.04%,同期业绩比较基准增长率为 1.74%,同期跟踪偏离度为-3.78%;原华夏中证 A500 指数 C 基金份额净值为 0.9794 元,2024 年 10 月 31 日至 2024 年 11 月 17 日期间份额净值增长率为-2.06%,同期业绩比较基准增长率为 1.74%,同期跟踪偏离度为-3.80%。与业绩比较基准产生偏离的主要原因为基金尚处于建仓期,基金组合的结构与指数结构尚存在差异等产生的差异。转型后,截至 2024 年 12 月 31 日,华夏中证 A500ETF 联接 A 基金份额净值为 0.9645 元,2024 年 11 月 18 日至 2024 年 12 月 31 日期间份额净值增长率为-1.54%,同期业绩比较基准增长率为-1.59%,同期跟踪偏离度为+0.05%;华夏中证 A500ETF 联接 C 基金份额净值为 0.9640 元,2024 年 11 月 18 日至 2024 年 12 月 31 日期间份额净值增长率为-1.57%;同期业绩比较基准收益率为-1.59%,同期跟踪偏离度为+0.02%;华夏中证 A500ETF 联接 Y 基金份额净值为 0.9644 元,本报告期份额净值增长率为-0.78%,同期业绩比较基准增长率为-0.84%,同期跟踪偏离度为+0.06%。与业绩比较基准产生偏离的主要原因为基金尚处于建仓期,基金组合的结构与指数结构尚存在差异等产生的差异。

4.5 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 华夏中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

(报告期: 2024年11月18日-2024年12月31日)

5.1.1 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	135,855,288.57	2.98
	其中: 股票	135,855,288.57	2.98
2	基金投资	3,960,228,032.55	86.84
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	426,929,933.15	9.36
8	其他资产	37,430,037.53	0.82
9	合计	4,560,443,291.80	100.00

5.1.2 期末投资目标基金明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	华夏中证 A500ETF	股票型	交易型开放式	华夏基金管理有限公司	3,960,228,032.55	90.46

5.1.3 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.1.3.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	756,344.00	0.02
B	采矿业	6,025,906.22	0.14
C	制造业	81,897,054.43	1.87
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,419,782.59	0.10
E	建筑业	2,669,104.00	0.06
F	批发和零售业	887,773.64	0.02
G	交通运输、仓储和邮政业	4,685,587.00	0.11
H	住宿和餐饮业	114,590.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,747,740.69	0.20
J	金融业	19,933,191.00	0.46

K	房地产业	1,468,187.00	0.03
L	租赁和商务服务业	1,496,129.00	0.03
M	科学研究和技术服务业	1,336,601.00	0.03
N	水利、环境和公共设施管理业	358,534.00	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	108,800.00	0.00
Q	卫生和社会工作	581,330.00	0.01
R	文化、体育和娱乐业	368,634.00	0.01
S	综合	-	-
	合计	135,855,288.57	3.10

5.1.4 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

5.1.4.1 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	600519	贵州茅台	3,400	5,181,600.00	0.12
2	300750	宁德时代	17,100	4,548,600.00	0.10
3	601318	中国平安	61,400	3,232,710.00	0.07
4	600036	招商银行	70,400	2,766,720.00	0.06
5	000333	美的集团	31,700	2,384,474.00	0.05
6	300059	东方财富	81,900	2,114,658.00	0.05
7	600900	长江电力	70,185	2,073,966.75	0.05
8	000858	五粮液	12,600	1,764,504.00	0.04
9	002594	比亚迪	5,900	1,667,694.00	0.04
10	600030	中信证券	55,600	1,621,852.00	0.04

5.1.5 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。

5.1.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.1.7 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。

5.1.8 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。

5.1.9 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。

5.1.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.1.10.1 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
IF2503	沪深 300 股指期货 IF2503 合约	20	23,628,000.00	-272,240.00	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。
IF2502	沪深 300 股指期货 IF2502 合约	8	9,453,600.00	-1,440.00	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。
IC2503	中证 500 股指期货 IC2503 合约	6	6,810,480.00	-196,112.00	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。
IC2502	中证 500 股指期货 IC2502 合约	2	2,279,360.00	-34,840.00	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)					-504,632.00
股指期货投资本期收益 (元)					-18,454.31
股指期货投资本期公允价值变动 (元)					-504,632.00

5.1.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金为指数型联接基金，主要投资于目标 ETF 基金份额、标的指数成份股和备选成份股。本基金根据基金合同规定投资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。

5.1.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.1.11.1 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。

5.1.11.2 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。

5.1.11.3 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。

5.1.12 投资组合报告附注

5.1.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，招商银行股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责、处罚的情况。本基金为指数型联接基金，主要采取复制策略，招商银行系目标 ETF 标的指数成份股，上述股票的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

5.1.12.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.1.12.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	6,146,438.33
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	30,434,719.94
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	848,879.26
9	合计	37,430,037.53

5.1.12.4 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。

5.1.12.5 报告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。

5.1.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

5.2 华夏中证 A500 指数证券投资基金

（报告期：2024年10月31日-2024年11月17日）

5.2.1 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	2,417,262,875.19	72.53
	其中：股票	2,417,262,875.19	72.53
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	861,688,294.86	25.85
8	其他资产	53,833,614.70	1.62
9	合计	3,332,784,784.75	100.00

5.2.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	13,612,708.00	0.45
B	采矿业	109,258,243.52	3.65
C	制造业	1,447,704,438.04	48.31
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	84,675,761.98	2.83
E	建筑业	51,123,090.00	1.71
F	批发和零售业	15,747,112.83	0.53
G	交通运输、仓储和邮政业	76,520,050.00	2.55

H	住宿和餐饮业	2,360,942.00	0.08
I	信息传输、软件和信息技术服务业	151,029,417.46	5.04
J	金融业	359,798,797.36	12.01
K	房地产业	28,645,139.00	0.96
L	租赁和商务服务业	25,325,768.00	0.85
M	科学研究和技术服务业	24,233,989.00	0.81
N	水利、环境和公共设施管理业	6,271,685.00	0.21
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	1,612,031.00	0.05
Q	卫生和社会工作	11,830,496.00	0.39
R	文化、体育和娱乐业	7,513,206.00	0.25
S	综合	-	-
	合计	2,417,262,875.19	80.66

5.2.3 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

5.2.3.1 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	600519	贵州茅台	67,200	104,764,800.00	3.50
2	300750	宁德时代	282,200	74,941,032.00	2.50
3	601318	中国平安	1,151,600	64,259,280.00	2.14
4	600036	招商银行	1,324,400	50,088,808.00	1.67
5	000333	美的集团	522,200	37,728,950.00	1.26
6	600900	长江电力	1,308,985	35,473,493.50	1.18
7	300059	东方财富	1,351,500	34,638,945.00	1.16
8	600030	中信证券	1,044,300	32,509,059.00	1.08
9	000858	五粮液	207,500	31,392,675.00	1.05
10	002594	比亚迪	97,000	28,130,000.00	0.94

5.2.4 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。

5.2.5 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。

5.2.6 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。

5.2.7 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。

5.2.8 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。

5.2.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.2.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无股指期货投资。

5.2.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末无股指期货投资。

5.2.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.2.10.1 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。

5.2.10.2 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。

5.2.10.3 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。

5.2.11 投资组合报告附注

5.2.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，中信证券股份有限公司、招商银行股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责、处罚的情况。本基金为指数型基金，主要采取复制策略，中信证券、招商银行系标的指数成份股，该股票的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

5.2.11.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.2.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	53,698,911.86

6	其他应收款	134,702.84
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	53,833,614.70

5.2.11.4 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。

5.2.11.5 报告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。

5.2.11.6 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

6.1 华夏中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

单位：份

项目	华夏中证A500ETF 联接A	华夏中证A500ETF 联接C	华夏中证A500ETF 联接Y
基金转型日基金份额总额	993,388,046.27	2,066,372,202.48	-
基金转型日起至报告期末基金总申购份额	766,252,579.14	997,132,120.63	38,352,017.43
减：基金转型日起至报告期末基金总赎回份额	88,694,748.71	232,227,477.63	96,533.62
基金转型日起至报告期末基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,670,945,876.70	2,831,276,845.48	38,255,483.81

注：自 2024 年 11 月 18 日起，“华夏中证 A500 指数证券投资基金”正式转型为“华夏中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金”，自同日起，华夏中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同生效。

6.2 华夏中证 A500 指数证券投资基金

单位：份

项目	华夏中证A500指数A	华夏中证A500指数C
基金合同生效日基	972,403,197.91	2,110,926,885.97

基金份额总额		
报告期期间基金总申购份额	23,639,745.77	32,514,071.38
减：报告期期间基金总赎回份额	2,654,897.41	77,068,754.87
报告期期间基金拆分变动份额	-	-
报告期末基金份额总额	993,388,046.27	2,066,372,202.48

注：①自 2024 年 11 月 18 日起，“华夏中证 A500 指数证券投资基金”正式转型为“华夏中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金”，自同日起，华夏中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同生效。

②本基金合同于 2024 年 10 月 31 日生效。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 华夏中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

7.1.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

项目	华夏中证A500ETF联接A	华夏中证 A500ETF联接C	华夏中证 A500ETF联接 Y
基金转型日管理人持有的本基金份额	-	-	-
基金转型日起至报告期末买入/申购总份额	163,082,254.61	-	-
基金转型日起至报告期末卖出/赎回总份额	-	-	-
基金转型日起至报告期末管理人持有的本基金份额	163,082,254.61	-	-
基金转型日起至报告期末持有	9.76	-	-

的本基金份额占 基金总份额比例 (%)			
---------------------------	--	--	--

注：自 2024 年 11 月 18 日起，“华夏中证 A500 指数证券投资基金”正式转型为“华夏中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金”，自同日起，华夏中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同生效。

7.1.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额（份）	交易金额（元）	适用费率
1	申购	2024-12-30	163,082,254.61	160,000,000.00	-
合计			163,082,254.61	160,000,000.00	

注：本基金管理人此项申购本基金适用的费用为 1000 元。

7.2 华夏中证 A500 指数证券投资基金

7.2.1 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。

7.2.2 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 华夏中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

8.1.1 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

本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

8.1.2 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

2024 年 12 月 13 日发布华夏中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 Y 类基金份额开放日常申购、赎回、转换、定期定额申购业务的公告。

2024 年 11 月 15 日发布华夏中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金开放日常申购、赎回、转换、定期定额申购业务的公告。

2024 年 11 月 15 日发布华夏基金管理有限公司关于华夏中证 A500 指数证券投资基金转

型为华夏中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金并修订基金合同的公告。

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、首批公募 MOM 基金管理人、首批纳入互联互通 ETF 基金管理人、首批北交所主题基金管理人以及特定客户资产管理人、保险资金投资管理人、公募 REITs 管理人，国内首家承诺“碳中和”具体目标和路径的公募基金公司，香港子公司是首批 RQFII 基金管理人。华夏基金是业务领域最广泛的基金管理公司之一。

8.2 华夏中证 A500 指数证券投资基金

8.2.1 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

本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

8.2.2 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

2024 年 11 月 13 日发布华夏中证 A500 指数证券投资基金开放日常申购、赎回、转换、定期定额申购业务的公告。

2024 年 11 月 1 日华夏中证 A500 指数证券投资基金基金合同生效公告。

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、首批公募 MOM 基金管理人、首批纳入互联互通 ETF 基金管理人、首批北交所主题基金管理人以及特定客户资产管理人、保险资金投资管理人、公募 REITs 管理人，国内首家承诺“碳中和”具体目标和路径的公募基金公司，香港子公司是首批 RQFII 基金管理人。华夏基金是业务领域最广泛的基金管理公司之一。

§9 备查文件目录

9.1 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。

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

二〇二五年一月二十二日