

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

基金管理人：华夏基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二四年八月三十日

## §1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 8 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	1
§2 基金简介.....	3
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	4
3.1 主要会计数据和财务指标.....	4
3.2 基金净值表现.....	4
§4 管理人报告.....	5
§5 托管人报告.....	11
§6 中期报告财务会计报告（未经审计）.....	11
6.1 资产负债表.....	11
6.2 利润表.....	13
6.3 净资产变动表.....	14
6.4 报表附注.....	15
§7 投资组合报告.....	31
7.1 期末基金资产组合情况.....	31
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	32
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	32
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	38
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	39
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.....	39
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.....	39
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.....	39
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.....	39
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	39
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	40
7.12 投资组合报告附注.....	40
§8 基金份额持有人信息.....	41
§9 开放式基金份额变动.....	42
§10 重大事件揭示.....	42
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	44
§12 备查文件目录.....	45

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华夏沪深 300ESG 基准交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	华夏沪深 300ESG 基准 ETF
场内简称	300ESGETF
基金主代码	159791
交易代码	159791
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2022 年 2 月 24 日
基金管理人	华夏基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	33,083,347.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2022 年 3 月 8 日

### 2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。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，衍生品投资策略，债券投资策略，可转换债券和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	沪深 300ESG 基准指数收益率。
风险收益特征	本基金属于股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华夏基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李彬	王小飞
	联系电话	400-818-6666	021-6063 7103
	电子邮箱	service@ChinaAMC.com	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		400-818-6666	021-60637228
传真		010-63136700	021-60635778
注册地址		北京市顺义区安庆大街甲3号院	北京市西城区金融大街25号
办公地址		北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座8层	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码		100033	100033
法定代表人		张佑君	张金良

### 2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	873,427.94
本期利润	418,255.97
加权平均基金份额本期利润	0.0154
本期加权平均净值利润率	1.87%
本期基金份额净值增长率	1.97%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024年6月30日)
期末可供分配利润	-6,046,302.59
期末可供分配基金份额利润	-0.1828
期末基金资产净值	27,037,044.41
期末基金份额净值	0.8172
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-18.28%

注：①所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

②本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

③期末可供分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

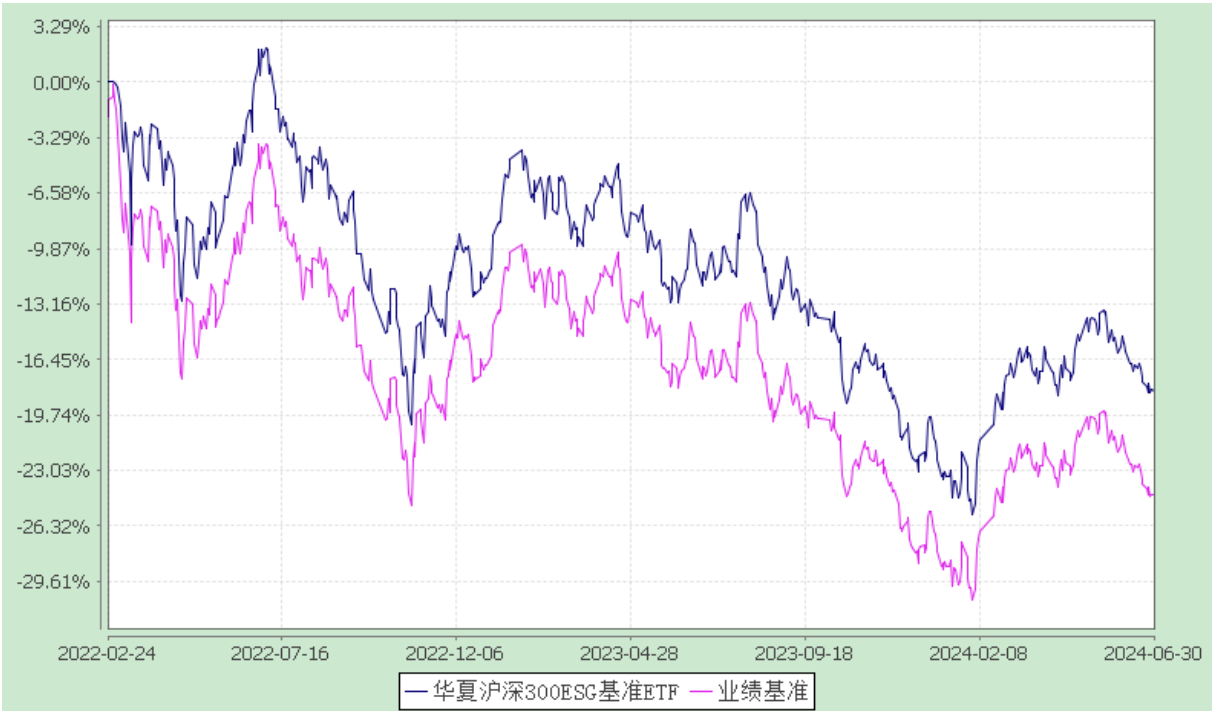
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-2.67%	0.48%	-3.22%	0.49%	0.55%	-0.01%
过去三个	-1.35%	0.74%	-2.20%	0.75%	0.85%	-0.01%

月						
过去六个月	1.97%	0.88%	1.39%	0.89%	0.58%	-0.01%
过去一年	-7.87%	0.87%	-8.80%	0.87%	0.93%	0.00%
自基金合同生效起至今	-18.28%	1.03%	-24.43%	1.05%	6.15%	-0.02%

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

华夏沪深 300ESG 基准交易型开放式指数证券投资基金  
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2022 年 2 月 24 日至 2024 年 6 月 30 日)



§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

华夏基金管理有限公司成立于 1998 年 4 月 9 日，是经中国证监会批准成立的首批全国性基金管理公司之一。公司总部设在北京，在北京、上海、深圳、成都、南京、杭州、广州、青岛、武汉及

沈阳设有分公司，在香港、深圳、上海、北京设有子公司。公司是首批全国社保基金管理人、首批企业年金基金管理人、境内首批 QDII 基金管理人、境内首只 ETF 基金管理人、境内首只沪港通 ETF 基金管理人、首批内地与香港基金互认基金管理人、首批基本养老保险基金投资管理人资格、首家加入联合国责任投资原则组织的公募基金公司、首批公募 FOF 基金管理人、首批公募养老目标基金管理人、首批个人养老金基金管理人、境内首批中日互通 ETF 基金管理人、首批商品期货 ETF 基金管理人、首批公募 MOM 基金管理人、首批纳入互联互通 ETF 基金管理人、首批北交所主题基金管理人以及特定客户资产管理人、保险资金投资管理人、公募 REITs 管理人，国内首家承诺“碳中和”具体目标和路径的公募基金公司，香港子公司是首批 RQFII 基金管理人。华夏基金是业务领域最广泛的基金管理公司之一。

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

华夏基金以深入的投资研究为基础，尽力捕捉市场机会，为投资人谋求良好的回报。根据银河证券基金研究中心《中国基金业绩评价报告》，截至 2024 年 6 月 30 日，华夏基金旗下多只产品近 1 年同类排名领先（基金排名不作为产品未来表现的保证），其中：

主动权益产品：在北交所主题偏股型基金(A 类)中华夏北交所创新中小企业精选两年定开混合发起式排名第 1/10；在对冲策略绝对收益目标基金(A 类)华夏安泰对冲策略 3 个月定开混合排名第 1/22；在 QDII 混合基金(A 类)中华夏全球科技先锋混合(QDII)排名第 2/48；在汽车主题行业偏股型基金(A 类)中华夏新能源车龙头混合发起式(A 类)排名第 3/17；在消费行业偏股型基金(A 类)中华夏网购精选混合(A 类)排名第 3/78、华夏消费臻选混合发起式(A 类)排名第 7/78。

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

在《中国证券报》第二十届中国基金业金牛奖评选中，华夏基金荣获“金牛奖 20 周年特别贡献公司”，连续 8 年荣获“被动投资金牛基金公司”，产品层面华夏创新前沿股票荣获“五年期开放式股票

型持续优胜金牛基金”，华夏中证 5G 通信主题 ETF 荣获“开放式指数型金牛基金”。在证券时报主办的第十八届中国基金业明星基金奖评选活动上，华夏基金将两大奖项收入囊中：公司层面，华夏基金荣获“三年期海外投资明星基金公司”；产品层面，华夏沪深 300ETF 荣获“三年持续回报指数型明星基金奖”。在《上海证券报》主办的第二十届“金基金”奖评选活动上，华夏基金将三大金基金奖项收入囊中：公司层面，华夏基金荣获“金基金·被动投资基金管理公司奖”；产品层面，华夏创新前沿股票荣获“金基金·股票型基金五年期奖”，华夏行业景气混合荣获“金基金·偏股混合型基金五年期奖”。

在客户服务方面，2024 年上半年，华夏基金继续以客户需求为导向，努力提高客户使用的便利性和服务体验：（1）华夏基金直销渠道继续优化页面显示，升级搜索及查询等功能，给客户更方便直观的使用体验；（2）华夏基金管家客户端上线亲子账户，通过亲子账户客户可以为子女创建专属理财账户，管理和储备孩子的零花钱、教育资金，从客户投资需求出发，进一步提升操作体验；（3）与常熟农商银行等代销机构合作，拓展更加丰富的客户理财渠道；（4）开展“送你长期主义的花朵”、“领定制户口本”、“打工人又爱又怕的一天要来了”、“希望高考也这么简单”等活动，为客户提供了多样化的投资者教育和关怀服务。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 （助理）期限		证券从业 年限	说明
		任职日期	离任日期		
赵宗庭	本基金的 基金经理	2022-02-24	-	16 年	硕士。曾任华夏基金管理有限公司研究发展部产品经理、数量投资部研究员，嘉实基金管理有限公司指数投资部基金经理助理，嘉实国际资产管理有限公司基金经理。2016 年 11 月加入华夏基金管理有限公司。历任华夏中证四川国企改革交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理（2020 年 12 月 8 日至 2022 年 1 月 13 日期间）、华夏中证四川国企改革交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2020 年 12 月 8 日至 2022 年 1 月 13 日期间）、华夏中证浙江国资创新发展交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2020 年 12 月 8 日至 2022 年 1 月 13 日期间）、华夏中证



					浙江国资创新发展交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（2020 年 12 月 8 日至 2022 年 1 月 13 日期间）、上证主要消费交易型开放式指数发起式证券投资基金基金经理（2020 年 2 月 12 日至 2022 年 8 月 22 日期间）、华夏中证大数据产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2021 年 2 月 9 日至 2022 年 8 月 22 日期间）、华夏中证新能源交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2021 年 3 月 9 日至 2022 年 8 月 22 日期间）、华夏中证新材料主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2021 年 8 月 4 日至 2023 年 3 月 27 日期间）、华夏中证石化产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2021 年 12 月 2 日至 2023 年 3 月 27 日期间）、华夏国证消费电子主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2021 年 8 月 12 日至 2023 年 6 月 29 日期间）、华夏中证机器人交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2021 年 12 月 17 日至 2023 年 6 月 29 日期间）、华夏中证细分有色金属产业主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2021 年 6 月 9 日至 2023 年 12 月 28 日期间）、华夏中证细分有色金属产业主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理（2022 年 10 月 18 日至 2023 年 12 月 28 日期间）等。
--	--	--	--	--	---

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

②证券从业的含义遵从行业协会《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监

督管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《华夏基金管理有限公司公平交易制度》的规定。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，本基金管理人旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 119 次，均为指数量化投资组合因投资策略需要发生的反向交易。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金跟踪的标的指数为沪深 300 ESG 基准指数，沪深 300 ESG 基准指数从沪深 300 样本中剔除中证一级行业内 ESG 分数最低的 20% 的上市公司证券，选取剩余证券作为指数样本，为 ESG 投资提供业绩基准和投资标的。本基金主要采用完全复制策略及适当的替代性策略以更好地跟踪标的指数，实现基金投资目标。

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

市场方面，上半年 A 股主要指数表现分化，沪深 300 等大盘指数表现占优，表现较好的行业有

银行、煤炭、公用事业、家用电器、石油石化，基本上都是红利策略覆盖的行业。市场风格方面，大盘价值风格相对占优，小盘成长风格相对偏弱。

基金投资运作方面，报告期内，本基金在做好跟踪标的指数的基础上，认真应对投资者日常申购、赎回和成份股调整等工作。

为促进本基金的市场流动性和平稳运行，经深圳证券交易所同意，部分证券公司被确认为本基金的流动性服务商。目前，本基金的流动性服务商包括中信建投证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、海通证券股份有限公司等。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2024 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 0.8172 元，本报告期份额净值增长率为 1.97%，同期业绩比较基准增长率 1.39%。本基金本报告期跟踪偏离度为+0.58%，与业绩比较基准产生偏离的主要原因为成份股分红、日常运作费用、指数结构调整、申购赎回等产生的差异。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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

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

本基金将会根据基金合同要求，在紧密跟踪标的指数的基础上，做好相关投资工作。

珍惜基金份额持有人的每一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，本基金管理人为准确、及时进行基金估值和份额净值计价，制定了基金估值和份额净值计价的业务管理制度，建立了估值委员会，使用可靠的估值业务系统，设有完善的风险监测、控制和报告机制。本基金托管人审阅本基金管理人采用的估值原则及技术，并复核、审查基金资产净值和基金份额申购、赎回价格。会计师事务所在估值调整导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上时对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性发表专业意见。

定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金自 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 3 月 19 日、2024 年 3 月 21 日至 2024 年 6 月 30 日出现基金资产净值低于五千万元的情形。基金管理人已向中国证监会进行报告并提出解决方案。本报告期内，自 2024 年 6 月 21 日起至 2024 年 6 月 30 日，由本基金管理人承担本基金的固定费用。

§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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，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，本基金利润分配情况符合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真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

§6 中期报告财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华夏沪深 300ESG 基准交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
----	-----	------------------------	--------------------------

<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	739,023.88	882,831.15
结算备付金		254,253.03	261,503.35
存出保证金		140,657.66	139,860.57
交易性金融资产	6.4.7.2	25,962,826.60	15,767,689.39
其中：股票投资		25,962,826.60	15,767,689.39
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		27,096,761.17	17,051,884.46
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2023 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		11,276.48	7,571.02
应付托管费		2,255.28	1,514.20
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	46,185.00	145,647.96
负债合计		59,716.76	154,733.18
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	33,083,347.00	21,083,347.00
未分配利润	6.4.7.8	-6,046,302.59	-4,186,195.72
净资产合计		27,037,044.41	16,897,151.28
负债和净资产总计		27,096,761.17	17,051,884.46

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.8172 元，基金份额总额 33,083,347.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：华夏沪深 300ESG 基准交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		504,060.44	1,275,833.03
1.利息收入		4,926.53	7,661.44
其中：存款利息收入	6.4.7.9	4,926.53	7,661.44
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）		957,234.90	623,171.77
其中：股票投资收益	6.4.7.10	608,485.95	422,111.54
基金投资收益	6.4.7.11	-	-
债券投资收益	6.4.7.12	-	452.86
资产支持证券投资收益	6.4.7.13	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	38,766.40	-43,919.00
股利收益	6.4.7.16	309,982.55	244,526.37
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-455,171.97	216,096.60
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-2,929.02	428,903.22
<b>减：二、营业总支出</b>		85,804.47	72,208.90
1.管理人报酬		55,321.03	43,265.07
2.托管费		11,064.16	8,653.04
3.销售服务费		-	-
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.信用减值损失	6.4.7.20	-	-
7.税金及附加		181.40	-
8.其他费用	6.4.7.21	19,237.88	20,290.79
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		418,255.97	1,203,624.13
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		418,255.97	1,203,624.13

五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		418,255.97	1,203,624.13

6.3 净资产变动表

会计主体：华夏沪深 300ESG 基准交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	21,083,347.00	-4,186,195.72	16,897,151.28
二、本期期初净资产	21,083,347.00	-4,186,195.72	16,897,151.28
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	12,000,000.00	-1,860,106.87	10,139,893.13
（一）、综合收益总额	-	418,255.97	418,255.97
（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）	12,000,000.00	-2,278,362.84	9,721,637.16
其中：1.基金申购款	56,000,000.00	-9,440,657.67	46,559,342.33
2.基金赎回款	-44,000,000.00	7,162,294.83	-36,837,705.17
（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	33,083,347.00	-6,046,302.59	27,037,044.41
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	19,083,347.00	-2,214,696.86	16,868,650.14
二、本期期初净资产	19,083,347.00	-2,214,696.86	16,868,650.14

三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-	58,927.92	58,927.92
（一）、综合收益总额	-	1,203,624.13	1,203,624.13
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-	-1,144,696.21	-1,144,696.21
其中：1.基金申购款	148,000,000.00	-12,925,176.02	135,074,823.98
2.基金赎回款	-148,000,000.00	11,780,479.81	-136,219,520.19
（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	19,083,347.00	-2,155,768.94	16,927,578.06

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：张佑君，主管会计工作负责人：朱威，会计机构负责人：朱威

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

华夏沪深 300ESG 基准交易型开放式指数证券投资基金（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[2021]2467 号文《关于准予华夏沪深 300ESG 基准交易型开放式指数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》、《华夏沪深 300ESG 基准交易型开放式指数证券投资基金基金合同》及其他有关法律法规负责公开募集。本基金为交易型开放式，存续期限为不定期。本基金自 2022 年 1 月 19 日至 2022 年 2 月 18 日共募集 291,075,000.00 元（不含认购资金利息），业经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）安永华明（2022）验字第 60739337\_A10 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华夏沪深 300ESG 基准交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2022 年 2 月 24 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 291,083,347.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 8,347.00 份基金份额。



额。本基金的基金管理人为华夏基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

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沪深 300ESG 基准指数。本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，基金还可投资于非成份股（含创业板、存托凭证及其他中国证监会注册或核准上市的股票）、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）、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。

通常情况下，本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%。本基金在每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金。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”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会发布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》和中国证监会、中国基金业协会允许的如财务报表附注 6.4.4 所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

### 6.4.6 税项

根据财税[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]103 号《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81 号《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]125 号《财政部、国家税务总局、证监会关于内地与香港基金互认有关税收政策的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《财政部、国家税务总局关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《财政部、国家税务总局关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2023]39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 以发行基金方式募集资金不属于增值税征收范围，不征收增值税。

(2) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

(3) 基金买卖股票、债券的差价收入免征增值税，暂不征收企业所得税。

(4) 存款利息收入不征收增值税。

(5) 国债、地方政府债利息收入，金融同业往来利息收入免征增值税。

(6) 对基金取得的债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(7) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(8) 对基金在境内取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利收入时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不征收企业所得税。基金在境内从上市公司分配取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，全额计入应纳税所得额，持股期限在 1 个月以上至 1

年（含 1 年）的，减按 50%计入应纳税所得额，持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20%的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20%的税率代扣个人所得税。对香港市场投资者取得的股息、红利收入按照 10%的税率代扣所得税。

（9）基金在境内卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

（10）基金在境外证券交易所进行交易或取得的源自境外证券市场的收益，其涉及的税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行。

（11）本基金分别按实际缴纳的增值税额的 7%、3%、2%缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	739,023.88
等于：本金	738,950.97
加：应计利息	72.91
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
合计	739,023.88

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

		2024 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		26,416,577.77	-	25,962,826.60	-453,751.17
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		26,416,577.77	-	25,962,826.60	-453,751.17

注：股票投资的估值增值和股票投资的公允价值均包含可退替代款的估值增值。

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	1,046,040.00	-	-	-
其中：股指期货	1,046,040.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	1,046,040.00	-	-	-

##### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IF2409	沪深 300 期货 IF2409 合约	1	1,027,080.00	-18,960.00
合计	-	-	-	-18,960.00
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	-18,960.00
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 2024 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	27,387.12
其中：交易所市场	27,387.12
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	18,797.88
合计	46,185.00

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	21,083,347.00	21,083,347.00
本期申购	56,000,000.00	56,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-44,000,000.00	-44,000,000.00
本期末	33,083,347.00	33,083,347.00

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-2,733,106.88	-1,453,088.84	-4,186,195.72
本期期初	-2,733,106.88	-1,453,088.84	-4,186,195.72

本期利润	873,427.94	-455,171.97	418,255.97
本期基金份额交易产生的变动数	-1,642,097.99	-636,264.85	-2,278,362.84
其中：基金申购款	-6,957,687.70	-2,482,969.97	-9,440,657.67
基金赎回款	5,315,589.71	1,846,705.12	7,162,294.83
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-3,501,776.93	-2,544,525.66	-6,046,302.59

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	1,691.15
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	3,107.01
其他	128.37
合计	4,926.53

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	446,587.67
股票投资收益——赎回差价收入	161,898.28
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	608,485.95

6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	27,199,624.62
减：卖出股票成本总额	26,708,174.78
减：交易费用	44,862.17
买卖股票差价收入	446,587.67

6.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	36,837,705.17
减：现金支付赎回款总额	24,010,950.17
减：赎回股票成本总额	12,664,856.72
减：交易费用	-
赎回差价收入	161,898.28

6.4.7.10.4 股票投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.10.5 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.11 基金投资收益

无。

6.4.7.12 债券投资收益

无。

6.4.7.13 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.14 贵金属投资收益

无。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
股指期货投资收益	38,766.40

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	309,982.55
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	309,982.55

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
1.交易性金融资产	-424,511.97
——股票投资	-424,511.97
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-30,660.00
——权证投资	-
——期货投资	-30,660.00
4.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	-455,171.97

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	-2,929.02
合计	-2,929.02

#### 6.4.7.19 持有基金产生的费用

无。

#### 6.4.7.20 信用减值损失

无。

#### 6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
审计费用	18,797.88
信息披露费	-
证券出借违约金	-
银行费用	440.00
合计	19,237.88



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 2024 年 6 月 21 日起至 2024 年 6 月 30 日，本基金的固定费用由本基金管理人承担，共计 1,092.90 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 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华夏基金管理有限公司	基金管理人
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人
华夏沪深 300ESG 基准交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（“华夏沪深 300ESG 基准 ETF 发起式联接”）	该基金是本基金的联接基金
中信证券股份有限公司（“中信证券”）	基金管理人的股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
中信证券	8,645,316.82	14.10%	50,290,341.59	27.66%

##### 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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
中信证券	3,844.06	14.07%	3,844.06	14.04%
关联方名称	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
中信证券	21,692.62	27.66%	11,144.55	12.35%

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	55,321.03	43,265.07
其中：应支付销售机构的客户维护费	-	-
应支付基金管理人的净管理费	55,321.03	43,265.07

注：①支付基金管理人的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 0.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

②基金管理人报酬计算公式为：日基金管理人报酬＝前一日基金资产净值×0.50%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2024年1月1日至2024年6月 30日	2023年1月1日至2023年6月30 日
当期发生的基金应支付的托管费	11,064.16	8,653.04

注：①支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值 0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

②基金托管费计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.10%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

无。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
华夏沪深 300ESG 基准 ETF 发起式联接	14,373,000.00	43.44%	-	-
中信证券	793,519.00	2.40%	1,785,119.00	8.47%

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的相关费用符合基金招募说明书、交易所、登记结算机构的有关规定。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2024年1月1日至2024年6月30日		2023年1月1日至2023年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行活期存款	739,023.88	1,691.15	3,620,355.37	2,589.55

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国建设银行保管，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

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

于 2024 年 6 月 30 日，本基金（因指数成份股包括中信证券而被动）持有的中信证券股票估值总额为人民币 255,220.00 元，占基金资产净值的比例为 0.94%（2023 年 12 月 31 日，本基金（因指数成份股包括中信证券而被动）持有的中信证券股票估值总额为人民币 160,923.00 元，占基金资产净值的比例为 0.95%）。

于 2024 年 6 月 30 日，本基金（因指数成份股包括中国建设银行而被动）持有的中国建设银行股票估值总额为人民币 106,560.00 元，占基金资产净值的比例为 0.39%（2023 年 12 月 31 日，本基金（因指数成份股包括中国建设银行而被动）持有的中国建设银行股票估值总额为人民币 57,288.00 元，占基金资产净值的比例为 0.34%）。

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 2024 年 6 月 21 日起至 2024 年 6 月 30 日，本基金的固定费用由本基金管理人承担，共计 1,092.90 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（2024 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

#### 6.4.13.2 信用风险

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

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

#### 6.4.13.3 流动性风险

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

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

##### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

在资产端，本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股，如需对组合进行调整时，由于投资标的的流动性较好，市场冲击成本较小，基金投资组合收益偏离投资目标收益的风险较小。基金管理人持续监测本基金持有资产的市场交易量、交易集中度等涉及资产流动性水平的风险指标，并定期开展压力测试，详细评估在不同的压力情景下资产变现情况的变化。

在负债端，基金管理人持续监测本基金投资者历史申赎、投资者类型和结构变化等数据，审慎评估不同市场环境可能带来的投资者潜在赎回需求，当市场环境或投资者结构发生变化时，及时调整组合资产结构，预留充足现金头寸，保持基金资产可变现规模和期限与负债赎回规模和期限的匹配。

如遭遇极端市场情形或投资者非预期巨额赎回情形，基金管理人将采用本基金合同约定的赎回申请处理方式及其他各类流动性风险管理工具，控制极端情况下的潜在流动性风险。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指由于市场变化或波动所引起的资产损失的可能性，本基金管理人通过监测组合敏感性指标来衡量市场风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率变动引起组合中资产特别是债券投资的市场价格变动，从而影响基金投资收益的风险。

本基金为指数型基金，采用完全复制策略。本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。因此，利率风险不是本基金的主要风险。

##### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

##### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险为除市场利率和外汇汇率以外的市场因素（单个证券发行主体自身经营情况或证券市场整体波动）发生变动时导致基金资产发生损失的风险。

本基金为指数型基金，采用完全复制策略。本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。本基金管理人通常用敏感性指标来衡量市场价格风险。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
----	------------------------	--------------------------

	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	25,962,826.60	96.03	15,767,689.39	93.32
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	25,962,826.60	96.03	15,767,689.39	93.32

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

②由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300ESG 基准指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
	-5%	-1,245,809.74	-784,615.76
	+5%	1,245,809.74	784,615.76

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

- 第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；
- 第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；
- 第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024 年 6 月 30 日
第一层次	25,962,826.60
第二层次	-
第三层次	-
合计	25,962,826.60

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）和非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。本基金政策以导致各层次之间转换的事项发生日作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

截至 2024 年 6 月 30 日止，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，其账面价值与公允价值差异很小。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## §7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	25,962,826.60	95.82
	其中：股票	25,962,826.60	95.82
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	993,276.91	3.67
8	其他各项资产	140,657.66	0.52
9	合计	27,096,761.17	100.00

注：股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值。



## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	174,400.00	0.65
B	采矿业	1,360,439.50	5.03
C	制造业	14,441,554.35	53.41
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,459,278.00	5.40
E	建筑业	633,009.00	2.34
F	批发和零售业	61,866.00	0.23
G	交通运输、仓储和邮政业	709,928.81	2.63
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,321,723.90	4.89
J	金融业	5,058,117.18	18.71
K	房地产业	268,287.00	0.99
L	租赁和商务服务业	131,229.00	0.49
M	科学研究和技术服务业	272,559.86	1.01
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	70,434.00	0.26
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	25,962,826.60	96.03

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	1,300	1,907,607.00	7.06
2	600036	招商银行	27,300	933,387.00	3.45
3	300750	宁德时代	5,140	925,354.20	3.42
4	600900	长江电力	27,100	783,732.00	2.90
5	000333	美的集团	9,800	632,100.00	2.34
6	601166	兴业银行	30,300	533,886.00	1.97
7	000858	五粮液	4,036	516,769.44	1.91
8	002594	比亚迪	2,000	500,500.00	1.85
9	601328	交通银行	62,200	464,634.00	1.72
10	601318	中国平安	11,100	459,096.00	1.70
11	600887	伊利股份	13,700	354,008.00	1.31
12	300760	迈瑞医疗	1,200	349,092.00	1.29
13	000651	格力电器	8,100	317,682.00	1.17
14	600276	恒瑞医药	8,200	315,372.00	1.17

15	601398	工商银行	52,400	298,680.00	1.10
16	002475	立讯精密	7,538	296,318.78	1.10
17	601088	中国神华	6,300	279,531.00	1.03
18	300308	中际旭创	1,960	270,244.80	1.00
19	000725	京东方 A	62,800	256,852.00	0.95
20	600030	中信证券	14,000	255,220.00	0.94
21	601899	紫金矿业	14,100	247,737.00	0.92
22	002415	海康威视	7,800	241,098.00	0.89
23	002371	北方华创	700	223,923.00	0.83
24	600406	国电南瑞	8,880	221,644.80	0.82
25	600690	海尔智家	7,700	218,526.00	0.81
26	601919	中远海控	13,906	215,403.94	0.80
27	601857	中国石油	20,700	213,624.00	0.79
28	601668	中国建筑	39,000	207,090.00	0.77
29	601985	中国核电	19,300	205,738.00	0.76
30	300274	阳光电源	3,220	199,736.60	0.74
31	601728	中国电信	31,600	194,340.00	0.72
32	600941	中国移动	1,800	193,500.00	0.72
33	000063	中兴通讯	6,823	190,839.31	0.71
34	603259	药明康德	4,844	189,836.36	0.70
35	300124	汇川技术	3,700	189,810.00	0.70
36	600050	中国联通	39,800	187,060.00	0.69
37	600028	中国石化	29,500	186,440.00	0.69
38	688981	中芯国际	3,862	178,038.20	0.66
39	600309	万华化学	2,200	177,892.00	0.66
40	002714	牧原股份	4,000	174,400.00	0.65
41	600837	海通证券	19,600	167,776.00	0.62
42	601288	农业银行	38,300	166,988.00	0.62
43	601012	隆基绿能	11,900	166,838.00	0.62
44	603501	韦尔股份	1,675	166,444.75	0.62
45	002230	科大讯飞	3,800	163,210.00	0.60
46	600660	福耀玻璃	3,400	162,860.00	0.60
47	600809	山西汾酒	740	156,051.20	0.58
48	002352	顺丰控股	4,300	153,467.00	0.57
49	600938	中国海油	4,600	151,800.00	0.56
49	600031	三一重工	9,200	151,800.00	0.56
51	601988	中国银行	32,800	151,536.00	0.56
52	601390	中国中铁	22,400	146,048.00	0.54
53	000100	TCL 科技	32,650	141,048.00	0.52
54	600104	上汽集团	9,800	135,828.00	0.50
55	000001	平安银行	13,358	135,583.70	0.50
56	600048	保利发展	15,400	134,904.00	0.50
57	603986	兆易创新	1,400	133,868.00	0.50

58	603019	中科曙光	3,200	132,800.00	0.49
59	600905	三峡能源	30,100	131,236.00	0.49
60	601888	中国中免	2,100	131,229.00	0.49
61	688012	中微公司	919	129,817.94	0.48
62	000338	潍柴动力	7,977	129,546.48	0.48
63	688041	海光信息	1,788	125,732.16	0.47
64	601766	中国中车	16,700	125,417.00	0.46
65	600019	宝钢股份	18,300	121,695.00	0.45
66	601600	中国铝业	15,800	120,554.00	0.45
67	688008	澜起科技	1,966	112,376.56	0.42
68	601658	邮储银行	21,800	110,526.00	0.41
69	601818	光大银行	34,300	108,731.00	0.40
70	002304	洋河股份	1,340	108,191.60	0.40
71	688111	金山办公	472	107,380.00	0.40
72	601939	建设银行	14,400	106,560.00	0.39
73	600886	国投电力	5,800	105,792.00	0.39
74	000625	长安汽车	7,840	105,291.20	0.39
75	601138	工业富联	3,800	104,120.00	0.39
76	600547	山东黄金	3,800	104,044.00	0.38
77	601211	国泰君安	7,500	101,625.00	0.38
78	600438	通威股份	5,000	95,550.00	0.35
79	601229	上海银行	13,100	95,106.00	0.35
80	000938	紫光股份	4,100	91,635.00	0.34
81	601601	中国太保	3,200	89,152.00	0.33
82	601006	大秦铁路	12,400	88,784.00	0.33
83	601186	中国铁建	9,700	83,129.00	0.31
84	003816	中国广核	17,000	78,710.00	0.29
85	600989	宝丰能源	4,500	77,985.00	0.29
86	600089	特变电工	5,480	76,007.60	0.28
87	688036	传音控股	971	74,320.34	0.27
88	600000	浦发银行	8,600	70,778.00	0.26
89	300015	爱尔眼科	6,825	70,434.00	0.26
90	001979	招商蛇口	8,000	70,320.00	0.26
91	688271	联影医疗	635	69,659.50	0.26
92	002049	紫光国微	1,300	68,380.00	0.25
93	002236	大华股份	4,300	66,478.00	0.25
94	002460	赣锋锂业	2,320	66,468.00	0.25
95	601800	中国交建	7,400	66,156.00	0.24
96	600015	华夏银行	10,300	65,920.00	0.24
97	300122	智飞生物	2,350	65,870.50	0.24
98	000977	浪潮信息	1,800	65,466.00	0.24
99	600011	华能国际	6,800	65,416.00	0.24
100	300896	爱美客	380	65,398.00	0.24

101	600016	民生银行	17,200	65,188.00	0.24
102	600585	海螺水泥	2,700	63,693.00	0.24
103	002142	宁波银行	2,874	63,400.44	0.23
104	300059	东方财富	6,000	63,360.00	0.23
105	000002	万科 A	9,100	63,063.00	0.23
106	002466	天齐锂业	2,100	62,811.00	0.23
107	600919	江苏银行	8,300	61,669.00	0.23
108	002601	龙佰集团	3,300	61,281.00	0.23
109	300782	卓胜微	780	60,637.20	0.22
110	601633	长城汽车	2,300	58,190.00	0.22
111	002179	中航光电	1,476	56,161.80	0.21
112	603369	今世缘	1,200	55,440.00	0.21
113	000661	长春高新	600	55,062.00	0.20
114	300661	圣邦股份	660	54,634.80	0.20
115	300347	泰格医药	1,100	53,460.00	0.20
116	601916	浙商银行	19,000	52,440.00	0.19
117	600570	恒生电子	2,968	52,414.88	0.19
118	002920	德赛西威	600	52,254.00	0.19
119	001965	招商公路	4,400	52,184.00	0.19
120	600219	南山铝业	13,600	51,816.00	0.19
121	002311	海大集团	1,100	51,755.00	0.19
122	600600	青岛啤酒	700	50,939.00	0.19
123	000538	云南白药	980	50,127.00	0.19
124	000157	中联重科	6,500	49,920.00	0.18
125	603993	洛阳钼业	5,700	48,450.00	0.18
126	688223	晶科能源	6,688	47,484.80	0.18
127	601169	北京银行	8,100	47,304.00	0.17
128	300832	新产业	700	47,208.00	0.17
129	600026	中远海能	3,000	46,830.00	0.17
130	600196	复星医药	2,100	46,494.00	0.17
131	600183	生益科技	2,200	46,332.00	0.17
132	002129	TCL 中环	5,325	46,061.25	0.17
133	002648	卫星化学	2,500	44,950.00	0.17
134	600188	兖矿能源	1,950	44,323.50	0.16
135	605499	东鹏饮料	200	43,150.00	0.16
136	000596	古井贡酒	200	42,214.00	0.16
137	300033	同花顺	400	41,480.00	0.15
138	600845	宝信软件	1,294	41,317.42	0.15
139	002241	歌尔股份	2,100	40,971.00	0.15
140	601868	中国能建	19,300	40,916.00	0.15
141	000895	双汇发展	1,700	40,409.00	0.15
142	600362	江西铜业	1,700	40,256.00	0.15
143	601669	中国电建	7,200	40,248.00	0.15

144	300316	晶盛机电	1,400	40,222.00	0.15
145	002938	鹏鼎控股	1,000	39,760.00	0.15
146	601998	中信银行	5,900	39,530.00	0.15
147	600588	用友网络	3,900	39,000.00	0.14
148	000963	华东医药	1,400	38,934.00	0.14
149	600025	华能水电	3,600	38,808.00	0.14
150	000999	华润三九	910	38,747.80	0.14
151	300450	先导智能	2,300	38,249.00	0.14
152	601238	广汽集团	4,900	37,926.00	0.14
153	600111	北方稀土	2,200	37,840.00	0.14
154	600426	华鲁恒升	1,400	37,296.00	0.14
155	002459	晶澳科技	3,300	36,960.00	0.14
156	688599	天合光能	2,170	36,716.40	0.14
157	600029	南方航空	6,183	36,417.87	0.13
158	688396	华润微	970	36,316.80	0.13
159	300751	迈为股份	300	35,844.00	0.13
160	002812	恩捷股份	1,100	34,815.00	0.13
161	601872	招商轮船	4,100	34,645.00	0.13
162	601377	兴业证券	6,794	34,377.64	0.13
163	601009	南京银行	3,300	34,287.00	0.13
164	600176	中国巨石	3,100	34,255.00	0.13
165	300628	亿联网络	920	33,828.40	0.13
166	002001	新和成	1,720	33,024.00	0.12
167	002821	凯莱英	500	32,900.00	0.12
168	600233	圆通速递	2,100	32,865.00	0.12
169	000786	北新建材	1,100	32,626.00	0.12
170	688009	中国通号	5,380	32,280.00	0.12
171	002916	深南电路	300	31,731.00	0.12
172	603799	华友钴业	1,420	31,424.60	0.12
173	600875	东方电气	1,700	31,365.00	0.12
174	300413	芒果超媒	1,500	31,350.00	0.12
175	600926	杭州银行	2,400	31,320.00	0.12
176	601898	中煤能源	2,500	31,200.00	0.12
177	601628	中国人寿	1,000	31,050.00	0.11
178	000983	山西焦煤	3,000	30,930.00	0.11
179	300142	沃森生物	2,700	30,726.00	0.11
180	601111	中国国航	4,100	30,258.00	0.11
181	688126	沪硅产业	2,133	29,456.73	0.11
182	000166	申万宏源	6,800	29,308.00	0.11
183	300759	康龙化成	1,575	29,263.50	0.11
184	002180	纳思达	1,100	29,062.00	0.11
185	600161	天坛生物	1,180	28,792.00	0.11
186	601688	华泰证券	2,300	28,497.00	0.11

187	002410	广联达	2,960	28,356.80	0.10
188	601319	中国人保	5,500	28,325.00	0.10
189	600460	士兰微	1,600	28,016.00	0.10
190	603195	公牛集团	360	27,763.20	0.10
191	002841	视源股份	900	26,577.00	0.10
192	601618	中国中冶	8,500	26,350.00	0.10
193	002709	天赐材料	1,500	26,340.00	0.10
194	600023	浙能电力	3,600	25,596.00	0.09
195	300454	深信服	500	25,265.00	0.09
196	603899	晨光股份	800	25,024.00	0.09
197	688303	大全能源	1,198	24,427.22	0.09
198	000807	云铝股份	1,800	24,318.00	0.09
199	601100	恒立液压	500	23,290.00	0.09
200	601117	中国化学	2,800	23,072.00	0.09
201	000708	中信特钢	1,700	23,069.00	0.09
202	002603	以岭药业	1,500	22,995.00	0.09
203	300919	中伟股份	740	22,932.60	0.08
204	601607	上海医药	1,200	22,932.00	0.08
205	300496	中科创达	500	22,795.00	0.08
206	688363	华熙生物	400	22,628.00	0.08
207	601808	中海油服	1,300	22,360.00	0.08
208	002493	荣盛石化	2,300	22,218.00	0.08
209	601865	福莱特	1,100	22,110.00	0.08
210	603833	欧派家居	400	21,424.00	0.08
211	002271	东方雨虹	1,700	20,978.00	0.08
212	600803	新奥股份	1,000	20,800.00	0.08
213	688187	时代电气	408	20,147.04	0.07
214	300957	贝泰妮	400	19,328.00	0.07
215	002074	国轩高科	1,000	19,150.00	0.07
216	300999	金龙鱼	700	19,145.00	0.07
217	000301	东方盛虹	2,400	19,128.00	0.07
218	600018	上港集团	3,300	19,074.00	0.07
219	603659	璞泰来	1,335	18,863.55	0.07
220	600958	东方证券	2,424	18,422.40	0.07
221	300979	华利集团	300	18,255.00	0.07
222	000733	振华科技	400	16,612.00	0.06
223	601877	正泰电器	800	15,248.00	0.06
224	601881	中国银河	1,400	15,204.00	0.06
225	605117	德业股份	200	14,868.00	0.05
226	601698	中国卫通	1,000	14,090.00	0.05
227	601066	中信建投	700	13,468.00	0.05
228	002736	国信证券	1,400	12,166.00	0.04
229	601336	新华保险	400	12,012.00	0.04

230	601995	中金公司	400	11,844.00	0.04
231	603806	福斯特	740	10,878.00	0.04
232	000617	中油资本	1,500	8,280.00	0.03
233	600732	爱旭股份	900	8,145.00	0.03
234	001289	龙源电力	200	3,450.00	0.01

#### 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	600519	贵州茅台	4,739,260.00	28.05
2	600036	招商银行	1,592,588.00	9.43
3	600900	长江电力	1,063,160.00	6.29
4	601318	中国平安	925,972.00	5.48
5	601166	兴业银行	909,141.00	5.38
6	600809	山西汾酒	714,792.00	4.23
7	601328	交通银行	710,971.00	4.21
8	600887	伊利股份	654,056.00	3.87
9	601899	紫金矿业	626,556.00	3.71
10	600276	恒瑞医药	590,433.00	3.49
11	600030	中信证券	476,137.00	2.82
12	601398	工商银行	466,758.00	2.76
13	603259	药明康德	453,280.00	2.68
14	600309	万华化学	447,131.00	2.65
15	601088	中国神华	430,731.00	2.55
16	600028	中国石化	420,061.00	2.49
17	601012	隆基绿能	414,760.00	2.45
18	600406	国电南瑞	406,794.00	2.41
19	601857	中国石油	394,331.00	2.33
20	601668	中国建筑	392,262.00	2.32
21	600690	海尔智家	346,826.00	2.05

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	600519	贵州茅台	3,933,122.00	23.28
2	600036	招商银行	1,300,029.00	7.69
3	601318	中国平安	795,206.00	4.71
4	601166	兴业银行	760,525.00	4.50

5	600900	长江电力	661,634.00	3.92
6	600809	山西汾酒	647,263.00	3.83
7	601899	紫金矿业	620,550.00	3.67
8	601328	交通银行	571,984.00	3.39
9	600887	伊利股份	511,976.00	3.03
10	600276	恒瑞医药	405,818.00	2.40
11	600000	浦发银行	388,685.00	2.30
12	600309	万华化学	387,913.00	2.30
13	600028	中国石化	381,565.00	2.26
14	600030	中信证券	366,566.00	2.17
15	601398	工商银行	346,596.00	2.05
16	603259	药明康德	343,839.00	2.03
17	601088	中国神华	335,812.00	1.99
18	601857	中国石油	333,431.00	1.97
19	601668	中国建筑	332,988.00	1.97
20	601012	隆基绿能	327,443.00	1.94

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	34,121,118.68
卖出股票收入（成交）总额	27,199,624.62

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

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金为指数型基金，主要投资标的为指数成份股和备选成份股。基金留存的现金头寸根据基



金合同规定，投资于以标的指数或与标的指数相关性较高的其他指数为基础资产的股指期货，旨在配合基金日常投资管理需要，更有效地进行流动性管理，以更好地跟踪标的指数，实现投资目标。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末无国债期货投资。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货投资。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，交通银行股份有限公司、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，采取完全复制策略，交通银行、招商银行系标的指数成份股，上述股票的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

7.12.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	140,657.66
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	140,657.66

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人 户数 (户)	户均持有的基金份 额	持有人结构					
		机构投资者		个人投资者		华夏沪深 300ESG 基准 ETF 发 起式联接	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
371	89,173.44	8,180,254.00	24.73%	10,530,093.00	31.83%	14,373,000.00	43.44%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	中信建投证券股份有限公司	2,648,349.00	8.01%
2	广发证券股份有限公司	2,238,955.00	6.77%
3	海通证券股份有限公司	941,600.00	2.85%
4	华泰证券股份有限公司	857,831.00	2.59%
5	郝立斌	800,014.00	2.42%
6	中信证券股份有限公司	793,519.00	2.40%
7	华振芝	700,097.00	2.12%
8	北京普华路通科技发展有限公司	700,000.00	2.12%
9	孟瑜	491,009.00	1.48%
10	赵新峰	307,100.00	0.93%
11	中国建设银行股份有限公司－华夏沪深 300ESG 基 准交易型开放式指数证券 投资基金发起式联接基金	14,373,000.00	43.44%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人 员持有本基金	-	-

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、	0

基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2022 年 2 月 24 日）基金份额总额	291,083,347.00
本报告期期初基金份额总额	21,083,347.00
本报告期基金总申购份额	56,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	44,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	33,083,347.00

## §10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期未发生影响基金管理人经营或基金运营业务的诉讼。

本报告期无涉及基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金所聘用的会计师事务所未发生改变。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人及其高级管理人员在本报告期内无受稽查或处罚等情况。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
方正证券	1	44,362,863.12	72.35%	19,783.85	72.39%	-
中信证券	18	8,645,316.82	14.10%	3,844.06	14.07%	-
中金公司	5	4,515,695.36	7.36%	2,013.89	7.37%	-
申万宏源证券	2	1,710,593.00	2.79%	762.78	2.79%	-
华泰证券	2	1,093,817.00	1.78%	482.75	1.77%	-
国泰君安证券	2	992,458.00	1.62%	442.58	1.62%	-

注：①为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择券商的标准，即：

i 经营行为规范。

ii 公司财务状况良好。

iii 有良好的内控制度，在业内有良好的声誉。

iv 有较强的全方位金融服务能力和水平：能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

v 建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯和服务。

②券商专用交易单元选择程序：

i 本基金管理人根据上述标准进行评估并确定选用的券商。

ii 本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议/证券经纪服务协议。

③除本表列示外，本基金还选择了东北证券、东方证券、东兴证券、光大证券、广发证券、国盛证券、国投证券、海通证券、华西证券、万联证券、粤开证券、招商证券、浙商证券、中国银河证券、中泰证券、中信建投证券的交易单元作为本基金交易单元，本报告期无股票交易及应付佣金。

④在上述租用的券商交易单元中，广发证券的交易单元为本基金本期新增的交易单元。本期没有剔除的券商交易单元。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券	-	-	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

本基金本报告期内无需要披露的主要事项。

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2024-03-20	1,785,119.00	24,216,300.00	25,207,900.00	793,519.00	2.40%
华夏沪深 300ESG 基准 ETF 发起式联	1	2024-04-11 至 2024-06-30	-	15,237,300.00	864,300.00	14,373,000.00	43.44%

接							
产品特有风险							
<p>本基金在报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额20%的情形，在市场流动性不足的情况下，如遇投资者巨额赎回或集中赎回，基金管理人可能无法以合理的价格及时变现基金资产，有可能对基金净值产生一定的影响，甚至可能引发基金的流动性风险。</p> <p>在特定情况下，若持有基金份额占比较高的投资者大量赎回本基金，可能导致在其赎回后本基金资产规模持续低于正常运作水平，面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。</p>							

§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、《华夏沪深 300ESG 基准交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《华夏沪深 300ESG 基准交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- 4、法律意见书；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照。

12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

12.3 查阅方式

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

华夏基金管理有限公司  
二〇二四年八月三十日