

未经审计的半年度报告

华夏精选固定收益配置基金

（依据香港法律以伞形基金形式成立的开放式单位信托，同属华夏精选基金的子基金）

自 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

华夏精选固定收益配置基金
(华夏精选基金的子基金)

目录

	页码
管理及行政	1
基金管理人向基金份额持有人的报告	2
未审计的财务报表	
损益及其他全面收益表	3
财务状况表	4 - 5
基金份额持有人应占资产净值变动表	6
现金流量表	7
投资表现报表 (未审计)	8 - 10
投资组合持有变动表 (未审计)	11 - 22
金融衍生工具的详情 (未审计)	23
投资组合列表 (未审计)	24 - 27
股息披露 (未审计)	28

重要提示:

本年度报告内所载的任何意见仅反映基金管理人的意见, 可能发生变更。有关基金的更多资料, 请参阅刊载于我们网站的基金说明书:

<https://www.chinaamc.com.hk/zh-hans/product/chinaamc-select-fixed-income-allocation-fund/>

投资者制定投资决策时不得依赖本报告所载的资料。

华夏精选固定收益配置基金
(华夏精选基金的子基金)

管理及行政

基金管理人

华夏基金(香港)有限公司
香港中环花园道 1 号
中银大厦 37 楼

基金管理人董事

甘添先生
李丰名先生
李一梅女士
孙立强先生
阳琨先生(于 2023 年 5 月 30 日委任)

基金管理人的法律顾问

的近律师事务所
香港中环遮打道 18 号
历山大厦 5 楼

受托人、行政管理人及基金登记机构

中银国际英国保诚信托有限公司
香港太古城英皇道 1111 号
15 楼 1501-1057 & 1513-1516 室

审计师

安永会计师事务所
香港鲗鱼涌英皇道 979 号
太古坊一座 27 楼

保管人

中国银行(香港)有限公司
香港中环花园道 1 号
中国银行大厦 14 楼

华夏精选固定收益配置基金
(华夏精选基金的子基金)

基金管理人向基金份额持有人的报告

简介

华夏精选固定收益配置基金(“本子基金”)同属华夏精选基金的子基金,是按照 2012 年 1 月 12 日签订的信托契约并依据香港法律成立的伞形单位信托(经不时修订或补充)。本子基金旨在透过将本子基金不少于 70%的资产净值直接或间接投资于全球市场的固定收益及债务工具,以达致资本增值。

市场回顾

2023 年上半年,由于美欧银行业危机、美国债务上限僵局和地缘政治冲突等不利因素的影响,全球金融市场震荡剧烈。美国国债收益率降至 2022 年末水平,但由于市场预计加息周期接近尾声,股权资产在上半年末整体实现上涨。

随着加息趋近峰值,市场逐步吸收风险,短期内经济回升使大部分资产类别获得合理回报。股权资产普遍跑赢债券和大宗商品,成熟市场较于新兴市场也更具优势。

继 2022 年表现不佳之后,大部分固定收益证券在前六个月内实现了正向收益。在美元计价债券中,随着收益率曲线走低,久期表现优异,信用债表现优于利率债,美国高收益债券跑赢美国投资级债券。不过,中国高收益债券仍处于劣势。

华夏基金(香港)有限公司
2023 年 8 月 18 日

华夏精选固定收益配置基金
(华夏精选基金的子基金)

损益及其他全面收益表 (未审计)

自 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

	自 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 (未审计) 美元	自 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 (未审计) 美元
收入		
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产 产生的利息收入	1,166,356	861,924
银行存款利息收入	44,180	5,854
杂项收入	885	15,247
	<u>1,211,421</u>	<u>883,025</u>
费用		
管理费	(167,654)	(218,591)
受托人费用	(42,181)	(51,984)
保管费和银行费用	(21,252)	(20,174)
审计师酬金	(10,377)	(7,409)
交易手续费	(7,005)	(10,065)
法律和专业服务费	(47)	(7,142)
其他费用	(39,012)	(14,613)
	<u>(287,528)</u>	<u>(329,978)</u>
减: 由基金管理人承担的费用	<u>21,862</u>	<u>43,378</u>
投资利得及汇兑差额前利润	945,755	596,425
投资利得/ (损失) 及汇兑差额		
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产 及负债产生的净利得/ (损失)	621,730	(3,952,993)
汇兑差额	(6,203)	(4,294)
	<u>(615,527)</u>	<u>(3,957,287)</u>
税前利润/ (亏损)	<u>1,561,282</u>	<u>(3,360,862)</u>
预扣税	<u>-</u>	<u>(489)</u>
基金份额持有人应占资产净值增加/ (减少)	<u>1,561,282</u>	<u>(3,361,351)</u>

华夏精选固定收益配置基金
(华夏精选基金的子基金)

财务状况表 (未审计)

2023 年 6 月 30 日

	2023 年 6 月 30 日 (未审计) 美元	2022 年 12 月 31 日 (已审计) 美元
资产		
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	59,681,063	49,815,787
定期存款	-	2,000,000
应收利息	581,594	428,756
应收认购款	277,004	196,558
预付款	731	734
应收基金管理人的款项	51,487	63,200
应收经纪人的款项	4,557,737	32,812
现金及现金等价物	1,799,692	5,448,876
资产总额	66,949,308	57,986,723
负债		
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	80,434	-
应付管理费	83,606	69,857
应付受托人费用	6,613	6,212
应计费用和其他应付款	22,183	30,710
应付赎回款项	116,368	197,934
应付经纪人的款项	8,956,628	-
应付税费	373	373
总负债 (不含基金份额持有人应占资产净值)	9,266,205	305,086
基金份额持有人应占资产净值	57,683,103	57,681,637
负债总额	66,949,308	57,986,723

华夏精选固定收益配置基金
(华夏精选基金的子基金)

财务状况表 (未审计) (续)

2023 年 6 月 30 日

	2023 年 6 月 30 日 (未审计)	2022 年 12 月 31 日 (已审计)
已发行基金份额数目		
- I 类 (美元)	3,208,585.96	3,208,585.96
- I 类 (港币)	2,168,358.93	2,168,358.93
- A 类 (美元)	491,307.54	597,761.46
- A 类 (港币)	5,130,128.54	5,549,927.59
- A 类 (人民币)	123,450.67	2,081.79
- R 类 (人民币)	3,868,790.82	-
- R 类 (人民币) (对冲)	42,268,836.52	47,267,836.52
份额净值		
- I 类 (港币)	10.5665 港币	10.1561 港币
- I 类 (美元)	11.2719 美元	10.8878 美元
- A 类 (美元)	10.6133 美元	10.2622 美元
- A 类 (港币)	10.6285 港币	10.2263 港币
- A 类 (人民币)	11.1212 人民币	10.2212 人民币
- R 类 (人民币)	1.1219 人民币	-
- R 类 (人民币) (对冲)	0.9707 人民币	0.9526 人民币

注：本未经审计的半年度报告是根据国际会计准则委员会颁布的《国际财务报告准则》（“IFRS”）以及香港证券及期货事务监察委员会（“SFC”）制定的《单位信托及互惠基金守则》附录 E 所列明之相关披露规定编制。

本未经审计的半年度报告采用与截至 2022 年 12 月 31 日止年度的年度报告一致的会计政策，相关政策已载于该年度报告财务报表附注 2 中。

华夏精选固定收益配置基金
(华夏精选基金的子基金)

基金份额持有人应占资产净值变动表 (未审计)

自 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

	基金份额数目	美元
2022 年 1 月 1 日	34,128,575.78	97,524,408
认购的基金份额		
- A 类 (美元)	26,762.31	281,955
- A 类 (港币)	2,290,833.52	3,076,935
- R 类 (美元)	616,887.79	599,800
- R 类 (人民币)	4,999,000.00	757,264
	<u>7,933,483.62</u>	<u>4,715,954</u>
赎回的基金份额		
- I 类 (美元)	(1,307,109.81)	(14,839,095)
- A 类 (美元)	(712,105.11)	(7,499,588)
- A 类 (港币)	(4,618,206.73)	(6,217,631)
- R 类 (美元)	(1,631,807.10)	(1,554,677)
	<u>(8,269,228.75)</u>	<u>(30,110,991)</u>
基金份额持有人应占资产净值减少	<u>-</u>	<u>(3,361,351)</u>
2022 年 6 月 30 日	<u>33,792,830.65</u>	<u>68,768,020</u>

	基金份额数目	美元
2023 年 1 月 1 日	58,794,552.25	57,681,637
认购的基金份额		
- A 类 (美元)	59,982.05	629,143
- A 类 (港币)	5,222,828.65	6,999,818
- A 类 (人民币)	121,462.58	185,015
- R 类 (人民币)	31,843,159.81	4,822,743
- R 类 (人民币) (对冲)	21,748,316.93	3,096,319
	<u>58,995,750.02</u>	<u>15,733,038</u>
赎回的基金份额		
- A 类 (美元)	(166,435.97)	(1,743,804)
- A 类 (港币)	(5,642,627.70)	(7,576,093)
- A 类 (人民币)	(93.70)	(141)
- R 类 (人民币)	(27,974,368.99)	(4,269,306)
- R 类 (人民币) (对冲)	(26,747,316.93)	(3,703,510)
	<u>(60,530,843.29)</u>	<u>(17,292,854)</u>
基金份额持有人应占资产净值增加	<u>-</u>	<u>1,561,282</u>
2023 年 6 月 30 日	<u>57,259,458.98</u>	<u>57,683,103</u>

华夏精选固定收益配置基金
(华夏精选基金的子基金)

现金流量表 (未审计)

自 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

	自 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 (未审计) 美元	自 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 (未审计) 美元
经营活动产生的现金流量		
税前利润/(亏损)	1,561,282	(3,360,862)
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产 (增加) /减少	(9,865,276)	24,677,664
定期存款减少	2,000,000	
应收利息 (增加) /减少	(152,838)	260,900
应收基金管理人的款项 (增加) /减少	(4,524,925)	(22,780)
应收经纪人的款项减少/(增加)	11,713	(5,587,827)
预付款项减少/(增加)	3	(1,384)
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债增加 / (减少)	80,434	(2,314)
应付管理费增加/(减少)	13,749	(40,843)
应付受托人费用增加/(减少)	401	5,432
应计费用和其他应付款减少	(8,527)	(5,756)
应付经纪人的款项增加	8,956,628	7,363,029
经营活动 (使用) /产生的现金流量	(1,927,356)	23,285,259
已缴税款	-	(289)
经营活动 (使用) /产生的现金流量净额	(1,927,356)	23,284,970
筹资活动产生的现金流量		
发行基金份额的收益	15,652,592	5,737,029
赎回基金份额支付的款项	(17,374,420)	(30,605,327)
筹资活动使用的现金流量净额	(1,721,828)	(24,868,298)
现金及现金等价物减少净额	(3,649,184)	(1,583,328)
期初现金及现金等价物	5,448,876	8,964,041
期末现金及现金等价物	1,799,692	7,380,713
现金及现金等价物余额分析		
银行存款	1,799,692	7,380,713
经营活动产生的现金流量净额包括:		
银行存款利息收入	44,180	5,854

华夏精选固定收益配置基金
(华夏精选基金的子基金)

投资表现报表 (未审计)

基金份额持有人应占资产净值
(根据国际财务报告准则计算)

	每份额资产净值	基金份额持有人应占资产净值
截至 2023 年 6 月 30 日 (未审计)		
- I类 (美元)	11.2719 美元	36,166,740 美元
- I类 (港币)	10.5665 港币	2,924,172 美元
- A类 (美元)	10.6133 美元	5,214,416 美元
- A类 (港币)	10.6285 港币	6,958,927 美元
- A类 (人民币)	11.1212 人民币	188,532 美元
- R类 (人民币)	1.1219 人民币	596,027 美元
- R类 (人民币) (对冲)	0.9707 人民币	5,634,289 美元
截至 2022 年 12 月 31 日 (已审计)		
- I类 (美元)	10.8878 美元	34,934,397 美元
- I类 (港币)	10.1561 港币	2,824,579 美元
- A类 (美元)	10.2622 美元	6,134,335 美元
- A类 (港币)	10.2263 港币	7,279,506 美元
- A类 (人民币)	0.2212 人民币	3,074 美元
- R类 (人民币) (对冲)	0.9526 人民币	6,505,745 美元
截至 2021 年 12 月 31 日 (已审计)		
- I类 (美元)	11.4254 美元	53,797,916 美元
- I类 (港币)	10.6587 港币	2,964,160 美元
- A类 (美元)	10.7826 美元	15,622,002 美元
- A类 (港币)	10.7485 港币	13,520,203 美元
- A类 (人民币)	9.8704 人民币	1,554 美元
- R类 (人民币) (对冲)	0.9934 人民币	781,756 美元
- R类 (美元)	0.9856 美元	10,836,817 美元
截至 2020 年 12 月 31 日 (已审计)		
- I类 (美元)	11.4083 美元	8,009,945 美元
- A类 (美元)	10.8100 美元	31,306,478 美元
- A类 (港币)	10.7144 港币	28,033,362 美元
- I类 (美元派息)	10.7706 美元	16,559,133 美元

华夏精选固定收益配置基金
(华夏精选基金的子基金)

投资表现报表 (未审计) (续)

每份额的最高发行价格和最低赎回价格¹

	每份额的 最高发行 价格	每份额的 最低赎回 价格
自 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 (未审计)		
- I 类 (港币)	10.5750 港币	10.1823 港币
- I 类 (美元)	11.2836 美元	10.8917 美元
- A 类 (美元)	10.6243 美元	10.2658 美元
- A 类 (港币)	10.6372 港币	10.2527 港币
- A 类 (人民币)	11.1212 人民币	10.0240 人民币
- R 类 (人民币)	1.1219 人民币	1.0184 人民币
- R 类 (人民币) (对冲)	0.9732 人民币	0.9529 人民币
自 2022 年 12 月 31 日止年度 (已审计)		
- I 类 (港币)	10.6607 港币	10.2855 港币
- I 类 (美元)	11.4286 美元	10.9576 美元
- A 类 (美元)	10.7852 美元	10.3280 美元
- A 类 (港币)	10.7502 港币	10.3587 港币
- A 类 (人民币)	10.2038 人民币	9.5746 人民币
- R 类 (人民币)	1.0394 人民币	1.0000 人民币
- R 类 (人民币) (对冲)	0.9944 人民币	0.9614 人民币
- R 类 (美元)	0.9858 美元	0.9440 美元
自 2021 年 12 月 31 日止年度 (已审计)		
- I 类 (港币)	10.8334 港币	10.4553 港币
- I 类 (美元)	11.6339 美元	11.2183 美元
- A 类 (美元)	10.9927 美元	10.5932 美元
- A 类 (港币)	10.9395 港币	10.5495 港币
- A 类 (人民币)	10.2688 人民币	9.7483 人民币
- I 类 (美元派息)	10.7771 美元	10.7616 美元
- R 类 (美元)	1.0048 美元	0.9683 美元
- R 类 (人民币) (对冲)	1.0000 人民币	0.9721 人民币

¹ 所示本子基金的过往业绩并不预示其未来业绩。

华夏精选固定收益配置基金
(华夏精选基金的子基金)

投资表现报表 (未审计) (续)

每份额的最高发行价格和最低赎回价格²

	每份额的 最高发行 价格	每份额的 最低赎回 价格
自 2020 年 12 月 31 日止年度 (已审计)		
- I 类 (港币)	10.6071 港币	10.5553 港币
- I 类 (美元)	11.4111 美元	10.3474 美元
- A 类 (美元)	10.8126 美元	9.8351 美元
- A 类 (港币)	10.7171 港币	9.7517 港币
- I 类 (美元派息)	10.7733 美元	9.7690 美元
自 2019 年 12 月 31 日止年度 (已审计)		
- I 类 (港币)	10.6213 港币	10.0892 港币
- I 类 (美元)	10.6506 美元	10.1111 美元
- A 类 (美元)	10.1357 美元	9.9875 美元
- A 类 (港币)	10.1447 港币	10.0000 港币
- I 类 (美元派息)	10.0953 美元	10.0000 美元
自 2018 年 8 月 28 日 (成立日) 至 2018 年 12 月 31 日止的期间		
- I 类 (港币)	10.0840 港币	9.9521 港币
- I 类 (美元)	10.1075 美元	9.9533 美元

² 所示本子基金的过往业绩并不预示其未来业绩。

华夏精选固定收益配置基金
(华夏精选基金的子基金)

投资组合持有变动表 (未审计)

自 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

	2023 年 1 月 1 日	增加	持有量的变动 红利/ 股息	处置	2023 年 6 月 30 日
债务证券					
ABU DHABI NATIONAL ENERGY CO PJSC 4.375% S/A 24JAN2029 REGS	-	700,000	-	(700,000)	-
AIRPORT AUTHORITY HONG KONG 4.75% S/A 12JAN2028 REGS	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-
AIRPORT AUTHORITY HONG KONG 4.875% S/A 12JAN2030 REGS	-	500,000	-	(500,000)	-
AIRPORT AUTHORITY HONG KONG 4.875% S/A 12JAN2033 REGS	-	500,000	-	(500,000)	-
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC 4.75% S/A 15APR2035	-	400,000	-	(400,000)	-
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC 5.15% S/A 15APR2053	-	400,000	-	(400,000)	-
ALLY FINANCIAL INC 6.992% S/A 13JUN2029	-	500,000	-	(500,000)	-
AMERICAN EXPRESS CO 4.99% S/A 01MAY2026	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-
AMERICAN EXPRESS CO 5.043% S/A 01MAY2034	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-
AMGEN INC 5.15% S/A 02MAR2028	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-
AMGEN INC 5.25% S/A 02MAR2030	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-
AMGEN INC 5.507% S/A 2MAR2026	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-
AMPHENOL CORP 4.75% S/A 30MAR2026	-	500,000	-	(500,000)	-
AON CORP/AON GLOBAL HOLDINGS PLC 5.35% S/A 28FEB2033	-	500,000	-	(500,000)	-
AOZORA BANK LTD 5.9% S/A 02MAR2026	-	2,000,000	-	(1,000,000)	1,000,000
ASAHI MUTUAL LIFE INSURANCE CO 6.5% S/A PERP	-	3,900,000	-	(1,000,000)	2,900,000
ASAHI MUTUAL LIFE INSURANCE CO 6.9% S/A PERP	-	1,200,000	-	(400,000)	800,000
AT&T INC .4% S/A 15FEB2034	-	500,000	-	(500,000)	-
AUST & NZ BANK GP S+0.75% Q 03JUL2025 REGS	-	600,000	-	-	(600,000)
AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GROUP LTD 5.375% S/A 03JUL2025	-	500,000	-	(500,000)	-

华夏精选固定收益配置基金
(华夏精选基金的子基金)

投资组合持有变动表 (未审计) (续)

自 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

	2023 年 1 月 1 日	增加	持有量的变动 红利/ 股息	处置	2023 年 6 月 30 日
<u>债务证券</u> (续)					
AZURE ORBIT IV INTL FINANCE LTD 3.75% S/A 25JAN2023	300,000	-	-	(300,000)	-
BANK MANDIRI PERSERO TBK PT 5.5% S/A 04APR2026	-	800,000	-	-	800,000
BANK OF AMERICA CORP 3.864% S/A 23JUL2024	-	1,500,000	-	-	1,500,000
BANK OF AMERICA CORP 5.202% S/A 25APR2029	-	250,000	-	(250,000)	-
BANK OF AMERICA CORP 5.288% S/A 25APR2034	-	500,000	-	(500,000)	-
BANK OF CHINA HONG KONG LTD 5.9% S/A PERP REGS	-	3,500,000	-	(3,500,000)	-
BANK OF CHINA LTD/HONG KONG 3M L+0.75% Q 24JUN2023	-	300,000	-	(300,000)	-
BANK OF MONTREAL 4.338% S/A 05OCT2028	-	2,000,000	-	-	2,000,000
BANK OF NEW YORK MELLON CORP 4.947% S/A 26APR2027	-	300,000	-	(300,000)	-
BANK OF NEW YORK MELLON CORP 4.967% S/A 26APR2034	-	500,000	-	(500,000)	-
BAYFRONT INFRASTRUCTURE MANAGEMENT PTE LTD 4.257% S/A 16MAY2026	-	900,000	-	(900,000)	-
BHP BILLITON FINANCE USA LIMITED 4.75% S/A 28FEB2028	-	700,000	-	(700,000)	-
BLUESTAR FINANCE HLDGS LTD 3.875% S/A PERP(CALLED)	800,000	2,700,000	-	(3,500,000)	-
BOC AVIATION LTD 3.5% S/A 31JAN2023	2,250,000	-	-	(2,250,000)	-
BOC AVIATION LTD 3M L+1.125% Q 26SEP2023 REGS	-	800,000	-	-	800,000
BOC AVIATION USA CORP 4.875% S/A 03MAY2033 REGS	-	600,000	-	(600,000)	-
BOCOM LEASING MANAGEMENT HONG KONG CO LTD 3M L+0.83% Q 02MAR2023	350,000	-	-	(350,000)	-
BP CAPITAL MARKETS PLC 4.812% S/A 13FEB2033	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-
BRASKEM NETHERLANDS FINANCE BV 5.875% S/A 31JAN2050 REGS	-	500,000	-	(500,000)	-
CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE 5.001% S/A 28APR2028	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-
CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE 5.144% S/A 28APR2025	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-
CARGILL INC 4.5% S/A 24JUN2026 REGS	-	300,000	-	(300,000)	-
CARGILL INC 4.75% S/A 24APR2033 REGS	-	700,000	-	(700,000)	-
CCBL CAYMAN 1 CORP LTD 3M L+1.25% Q 12JUL2023	-	700,000	-	-	700,000

华夏精选固定收益配置基金
(华夏精选基金的子基金)

投资组合持有变动表 (未审计) (续)

自 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

	2023 年 1 月 1 日	增加	持有量的变动 红利/ 股息	处置	2023 年 6 月 30 日
<u>债务证券</u> (续)					
CENTERPOINT ENERGY HOUSTON ELECTRIC LLC 4.95% S/A 01APR2033	-	200,000	-	(200,000)	-
CHINA CONSTRUCTION BANK CORP 4.25% S/A 27FEB2029	-	2,000,000	-	-	2,000,000
CHINA GREAT WALL INTL HLDGS III LTD 4.375% S/A 25MAY2023	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-
CHINA GUANGFA BANK CO LTD 5.35% A 14FEB2023 FXCD	1,000,000	-	-	(1,000,000)	-
CHINA HONGQIAO GROUP LTD 7.375% S/A 02MAY2023	-	1,550,000	-	(1,550,000)	-
CHINA OVERSEAS FINANCE CAYMAN VII LTD 4.25% S/A 26APR2023	800,000	-	-	(800,000)	-
CHINA TAIPING INSURANCE HLDGS CO LTD 6.4% S/A PERP	-	1,000,000	-	-	1,000,000
CHINA TAIPING NEW HORIZON LTD 6% S/A 18OCT2023	-	2,000,000	-	(2,000,000)	-
CICC HONG KONG FINANCE 2016 MTN LTD 5.493% S/A 01MAR2026	-	2,800,000	-	(2,800,000)	-
CITIGROUP INC 6.174% S/A 25MAY2034	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-
CK HUTCHISON INTL 23 LTD 4.75% S/A 21APR2028 REGS	-	500,000	-	(500,000)	-
CK HUTCHISON INTL 23 LTD 4.875% S/A 21APR2033 REGS	-	500,000	-	(500,000)	-
CMHI FINANCE BVI CO LTD 3.5% S/A PERP	-	1,000,000	-	-	1,000,000
CNAC HK FINBRIDGE CO LTD 4.625% S/A 14MAR2023	1,000,000	2,000,000	-	(3,000,000)	-
COMCAST CORP 5.35% S/A 15MAY2053	-	3,000,000	-	(3,000,000)	-
CONOCOPHILLIPS CO 5.3% S/A 15MAY2053	-	200,000	-	(200,000)	-
CORP NACIONAL DEL COBRE DE CHILE 5.125% S/A 02FEB2033 REGS	-	400,000	-	(400,000)	-
CRCC YUXIANG LTD 3.5% S/A 16MAY2023 REGS	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-
CREDIT AGRICOLE SA 5.301% S/A 12JUL2028 REGS	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-
CREDIT AGRICOLE SA 7.25% Q PERP REGS	-	5,000,000	-	(5,000,000)	-
CREDIT AGRICOLE SA 7.875% Q PERP REGS	-	2,000,000	-	(2,000,000)	-
CROWN CASTLE INTL CORP 5.1% S/A 01MAY2033	-	400,000	-	(400,000)	-
CVS HEALTH CORP 5.3% S/A 01JUN2033	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-
CVS HEALTH CORP 5.875% S/A 01JUN2053	-	400,000	-	(400,000)	-

华夏精选固定收益配置基金
(华夏精选基金的子基金)

投资组合持有变动表 (未审计) (续)

自 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

	2023 年 1 月 1 日	增加	持有量的变动 红利/ 股息	处置	2023 年 6 月 30 日
债务证券 (续)					
CVS HEALTH CORP 6% S/A 1JUN2063	-	200,000	-	(200,000)	-
DEUTSCHE BANK AG/NEW YORK 7.079% S/A 10FEB2034	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-
DUKE ENERGY OHIO INC 5.25% S/A 1APR2033	-	400,000	-	(400,000)	-
DUKE ENERGY OHIO INC 5.65% S/A 01APR2053	-	400,000	-	(400,000)	-
EASTERN CREATION II INVESTMENT HLDGS LTD 1% S/A 10SEP2023	-	300,000	-	-	300,000
EBAY INC 2.75% S/A 30JAN2023	-	3,000,000	-	(3,000,000)	-
ELECTRICITE DE FRANCE SA 5.7% S/A 23MAY2028 REGS	-	1,000,000	-	-	1,000,000
ELECTRICITE DE FRANCE SA 6.9% S/A 23MAY2053 REGS	-	500,000	-	(500,000)	-
ELECTRICITE DE FRANCE SA 9.125% S/A 15DEC2099 REGS	-	250,000	-	(250,000)	-
ELI LILLY & CO 4.7% S/A 27FEB2033	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-
ELI LILLY & CO 4.875% S/A 27FEB2053	-	250,000	-	(250,000)	-
ELI LILLY & CO 4.95% S/A 27FEB2063	-	250,000	-	(250,000)	-
EXPORT-IMPORT BANK OF INDIA 5.50% S/A 18JAN2033 REGS	-	500,000	-	(500,000)	-
EXPORT-IMPORT BANK OF KOREA 4.625% S/A 07JUN2033	-	200,000	-	(200,000)	-
EXPORT-IMPORT BANK OF KOREA 5.125% S/A 11JAN2033	-	500,000	-	(500,000)	-
EXPORT-IMPORT BANK OF THAILAND 3M L+0.9% Q 20NOV2023	-	2,000,000	-	-	2,000,000
FORD MOTOR CO 6.95% S/A 06MAR2026	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-
FORD MOTOR CO 7.35% S/A 06MAR2030	-	500,000	-	(500,000)	-
FTL CAPITAL LTD 4.125% S/A 25APR2023	849,000	-	-	(849,000)	-
FUKOKU MUTUAL LIFE INSURANCE CO 6.5% S/A PERP	-	2,000,000	-	-	2,000,000
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO 5.9% S/A 01OCT2024	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-
HONG KONG GOVERNMENT INTL BOND 2.7% S/A 07JUN2025	-	5,000,000	-	(5,000,000)	-
HONG KONG GOVERNMENT INTL BOND 2.95% S/A 7JUN2028	-	3,000,000	-	(3,000,000)	-
HONG KONG GOVERNMENT INTL BOND 3.3% S/A 7JUN2033	-	2,000,000	-	(2,000,000)	-

华夏精选固定收益配置基金
(华夏精选基金的子基金)

投资组合持有变动表 (未审计) (续)

自 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

	2023 年 1 月 1 日	增加	持有量的变动 红利/ 股息	处置	2023 年 6 月 30 日
<u>债务证券 (续)</u>					
HONG KONG GOVERNMENT INTL BOND 3.375 A 07JUN2027	-	1,500,000	-	(1,500,000)	-
HONG KONG GOVERNMENT INTL BOND 3.75% A 7JUN2032	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-
HONG KONG GOVERNMENT INTL BOND 4% S/A 07JUN2028	-	500,000	-	(500,000)	-
HONG KONG GOVERNMENT INTL BOND 4.25% S/A 07JUN2026	-	500,000	-	(500,000)	-
HONG KONG GOVERNMENT INTL BOND 4.5% S/A 11JAN2028	-	500,000	-	(500,000)	-
HONG KONG GOVERNMENT INTL BOND 4.625% S/A 11JAN2033 REGS	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-
HONG KONG GOVERNMENT INTL BOND 5.25% S/A 11JAN2053	-	400,000	-	(400,000)	-
HONGKONG INTL QINGDAO CO LTD 3.99% S/A 27APR2023	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-
HSBC HLDGS PLC 3.95% S/A 18MAY2024(CALLED)	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-
HSBC HLDGS PLC 4.25% S/A 14MAR2024	-	500,000	-	-	500,000
HSBC HLGs PLC 6.25% S/A PERP(CALLED)	3,700,000	-	-	(3,700,000)	-
HUARONG FINANCE 2017 CO LTD 3M L+1.325% Q 03JUL2023	2,100,000	255,000	-	-	2,355,000
HUARONG FINANCE 2019 CO LTD 2.125% S/A 30SEP2023	-	500,000	-	-	500,000
HUARONG FINANCE 2019 CO LTD 2.5% S/A 24FEB2023	2,000,000	-	-	(2,000,000)	-
HUARONG FINANCE 2019 CO LTD 3.75% S/A 29MAY2024	-	1,200,000	-	-	1,200,000
HUARONG FINANCE 2019 CO LTD 3M L+1.125% Q 24FEB2023	600,000	-	-	(600,000)	-
HUMANA INC 5.50% S/A 15MAR2053	-	300,000	-	(300,000)	-
HUMANA INC 5.7% S/A 13MAR2026	-	400,000	-	(400,000)	-
HYATT HOTELS CORP 5.75% S/A 30JAN2027	-	500,000	-	-	500,000
INDIANA MICHIGAN POWER CO 5.625% S/A 01APR2053	-	500,000	-	(500,000)	-
INDONESIA GOVERNMENT INTL BOND 4.55% S/A 11JAN2028	-	700,000	-	(700,000)	-
INDUSTRIAL & COMMERCIAL BANK OF CHINA MACAU LTD 5.32% A 09FEB2023 FXCD	1,500,000	-	-	(1,500,000)	-
INTL BUSINESS MACHINES CORP 5.1% S/A 06FEB2053	-	2,000,000	-	(2,000,000)	-
INVERSIONES CMPC SA 6.125% S/A 23JUN2033 REGS	-	600,000	-	-	600,000
JPMORGAN CHASE & CO 5.35% S/A 01JUN2034	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-

华夏精选固定收益配置基金
(华夏精选基金的子基金)

投资组合持有变动表 (未审计) (续)

自 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

	2023 年 1 月 1 日	增加	持有量的变动 红利/ 股息	处置	2023 年 6 月 30 日
<u>债务证券 (续)</u>					
KHAZANAH CAPITAL LTD 4.876% S/A 1JUN2033	-	500,000	-	(500,000)	-
KHAZANAH GLOBAL SUKUK BHD 4.687% S/A 01JUN2028	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-
KODIT GLOBAL 2023-1 LTD 4.954% S/A 25MAY2026	-	400,000	-	(400,000)	-
KOREA HOUSING FINANCE CORP 4.625% S/A 24FEB2033 REGS	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-
KOREA MINE REHABILITATION & MINERAL RESOURCES CORP 5.375% S/A 11MAY2028	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-
KOREA NATIONAL OIL CORP 4.75% S/A 03APR2026 REGS	-	250,000	-	(250,000)	-
KOREA NATIONAL OIL CORP 4.875% S/A 03APR2028 REGS	-	450,000	-	(450,000)	-
KOREA OCEAN BUSINESS CORP 4.5% S/A 3MAY2028	-	400,000	-	(400,000)	-
KUBOTA CREDIT CORP USA 4.958% S/A 31MAY2026	-	500,000	-	(500,000)	-
LEADER GOAL INTL LTD 4.25% S/A PERP	1,000,000	-	-	(1,000,000)	-
LEADING AFFLUENCE LTD 4.5% S/A 24JAN2023	1,700,000	-	-	(1,700,000)	-
LOCKHEED MARTIN 4.45% S/A 15MAY2028	-	400,000	-	(400,000)	-
LOCKHEED MARTIN 4.75% S/A 15FEB2034	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-
LOCKHEED MARTIN 5.2% S/A 15FEB2055	-	400,000	-	(400,000)	-
LONGFOR GROUP HLDGS LTD 3.95% S/A 16SEP2029	-	200,000	-	(200,000)	-
MAJID AL FUTTAIM HLDG LLC 5% S/A 01JUN2033	-	500,000	-	(500,000)	-
MARS INC 4.65% S/A 20APR2031 REGS	-	500,000	-	(500,000)	-
MARS INC 4.75% S/A 20APR2033 REGS	-	300,000	-	(300,000)	-
MARUBENI CORP 3.75% S/A 17APR2023	-	800,000	-	(800,000)	-
MCC HLDG HONG KONG CORP LTD 3.25% S/A PERP(CALLED)	200,000	-	-	(200,000)	-
MDGH GMTN RSC LTD 4.375% S/A 22NOV2033	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-
MDGH GMTN RSC LTD 5.084% S/A 22MAY2053 REGS	-	400,000	-	-	400,000
META PLATFORMS INC 5.75% S/A 15MAY2063	-	500,000	-	(500,000)	-
MEXICO GOVERNMENT INTL BOND 6.338% S/A 4MAY2053	-	400,000	-	-	400,000
MEXICO GOVERNMENT INTL BOND 6.35% S/A 9FEB2035	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-

华夏精选固定收益配置基金
(华夏精选基金的子基金)

投资组合持有变动表(未审计)(续)

自 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

	2023 年 1 月 1 日	增加	持有量的变动 红利/ 股息	处置	2023 年 6 月 30 日
债务证券(续)					
MICRON TECHNOLOGY INC 6.75% S/A 01NOV2029	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-
MINOR INTL PCL 3.1% S/A PERP(CALLED)	2,000,000	200,000	-	(2,200,000)	-
mitsubishi UFJ FINANCIAL GROUP INC 5.406% S/A 19APR2034	-	600,000	-	(600,000)	-
MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GROUP INC 5.422% S/A 22FEB2029	-	1,100,000	-	(1,100,000)	-
MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GROUP INC 5.441% S/A 22FEB2034	-	1,100,000	-	(1,100,000)	-
MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GROUP INC 5.475% S/A 22FEB2031	-	1,100,000	-	(1,100,000)	-
MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GROUP INC 5.719% S/A 20FEB2026	-	1,100,000	-	(1,100,000)	-
MITSUI FUDOSAN CO LTD 2.95% S/A 23JAN2023 REGS	2,000,000	-	-	(2,000,000)	-
MIZUHO FINANCIAL GROUP CAYMAN 3 LTD 4.6% S/A 27MAR2024 REGS	-	1,000,000	-	-	1,000,000
MIZUHO FINANCIAL GROUP INC 5.748% S/A 6JUL2034	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-
MIZUHO FINANCIAL GROUP INC 5.778% S/A 6JUL2029	-	750,000	-	(750,000)	-
MORGAN STANLEY 5.123% S/A 01FEB2029	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-
MORGAN STANLEY 5.948% S/A 19JAN2038	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-
MOROCCO GOVERNMENT INTL BOND 5.95% S/A 8MAR2028 REGS	-	500,000	-	(500,000)	-
MOROCCO GOVERNMENT INTL BOND 6.5% S/A 8SEP2033 REGS	-	1,200,000	-	(1,200,000)	-
MPLX LP 5% S/A 01MAR2033	-	500,000	-	(500,000)	-
MPLX LP 5.65% S/A 01MAR2053	-	200,000	-	(200,000)	-
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD/NEW YORK 4.9% S/A 13JUN2028	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-
NATWEST GROUP PLC 5.847% S/A 02MAR2027	-	1,250,000	-	(1,250,000)	-
NATWEST GROUP PLC 6.016% S/A 02MAR2034	-	1,850,000	-	(1,850,000)	-
NEXTERA ENERGY CAPITAL HLDGS INC 6.051% S/A 01MAR2025	-	1,100,000	-	-	1,100,000

华夏精选固定收益配置基金
(华夏精选基金的子基金)

投资组合持有变动表 (未审计) (续)

自 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

	2023 年 1 月 1 日	增加	持有量的变动 红利/ 股息	处置	2023 年 6 月 30 日
债务证券 (续)					
NISOURCE INC 5.25% S/A 30MAR2028	-	500,000	-	(500,000)	-
NONGHYUP BANK 4.875% S/A 03JUL2028 REGS	-	500,000	-	(500,000)	-
NORINCHUKIN BANK 5.43% S/A 09MAR2028 REGS	-	1,000,000	-	-	1,000,000
OKLAHOMA GAS AND ELECTRIC CO 5.6% S/A 01APR2053	-	250,000	-	(250,000)	-
ORACLE CORP 5.55% S/A 06FEB2053	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-
OVERSEAS CHINESE TOWN ASIA HLDGS LTD 4.5% S/A PERP	-	2,400,000	-	-	2,400,000
PCCW-HKT CAPITAL NO5 LTD 3.75% S/A 08MAR2023 REGS	-	200,000	-	(200,000)	-
PERTAMINA GEOTHERMAL ENERGY PT 5.15% S/A 27APR2028 REGS	-	500,000	-	(500,000)	-
PETROBRAS GLOBAL FINANCE BV 6.5% S/A 3JUL2033	-	1,300,000	-	1,300,000	1,300,000
PFIZER INC 4.45% S/A 19MAY2028	-	800,000	-	(800,000)	-
PFIZER INC 4.65% S/A 19MAY2025	-	500,000	-	(500,000)	-
PFIZER INC 5.3% S/A 19MAY2053	-	500,000	-	(500,000)	-
PFIZER INVESTMENT ENTERPRISES PTE LTD 4.75% S/A 19MAY2033	-	800,000	-	(800,000)	-
PHILIP MORRIS INTL INC 4.875% S/A 13FEB2026	-	1,300,000	-	(1,300,000)	-
PHILIPPINE GOVERNMENT INTL BOND 4.625% S/A 17JUL2028	-	200,000	-	(200,000)	-
PHILIPPINE GOVERNMENT INTL BOND 5.50% S/A 17JAN2048	-	500,000	-	(500,000)	-
PIONEER NATURAL RESOURCE CO 5.1% S/A 29MAR2026	-	400,000	-	(400,000)	-
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP INC 6.25% Q PERP	-	500,000	-	(500,000)	-
POLY REAL ESTATE FINANCE LTD 3.95% S/A 05FEB2023	1,000,000	-	-	(1,000,000)	-
POSCO 5.75% S/A 17JAN2028 REGS	-	500,000	-	(500,000)	-
POSCO 5.875% S/A 17JAN2033 REGS	-	200,000	-	(200,000)	-
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP 5% S/A 27FEB2026	-	250,000	-	(250,000)	-
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP 5.375% S/A 27FEB2053	-	500,000	-	(500,000)	-
REALTY INCOME CORP 5.05% S/A 13JAN2026	-	300,000	-	(300,000)	-
REPUBLIC OF INDONESIA 3.85% S/A 11JAN2053 REGS	-	500,000	-	(500,000)	-
REPUBLIC OF INDONESIA 4.85% S/A 11JAN2033 REGS	-	500,000	-	(500,000)	-

华夏精选固定收益配置基金
(华夏精选基金的子基金)

投资组合持有变动表 (未审计) (续)

自 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

	2023 年 1 月 1 日	增加	持有量的变动 红利/ 股息	处置	2023 年 6 月 30 日
<u>债务证券 (续)</u>					
SAUDI GOVERNMENT INTL BOND 4.75% S/A 18JAN2028 REGS	-	500,000	-	(500,000)	-
SAUDI GOVERNMENT INTL BOND 4.875% S/A 18JUL2033 REGS	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-
SAUDI GOVERNMENT INTL BOND 5% S/A 18JAN2053 REGS	-	1,500,000	-	(1,500,000)	-
SHINHAN FINANCIAL GROUP CO LTD 5.875% S/A PERP	-	1,000,000	-	-	1,000,000
SINOCHEM OFFSHORE CAPITAL CO LTD 3% S/A PERP	-	2,000,000	-	-	2,000,000
SK BROADBAND CO LTD 4.875% S/A 28JUN2028	-	200,000	-	(200,000)	-
SK HYNIX INC 6.25% S/A 17JAN2026 REGS	-	500,000	-	(500,000)	-
SK HYNIX INC 6.375% S/A 17JAN2028 REGS	-	500,000	-	(500,000)	-
SK HYNIX INC 6.5% S/A 17JAN2033 REGS	-	250,000	-	(250,000)	-
SK ON CO LTD 5.375% S/A 11MAY2026	-	1,000,000	-	-	1,000,000
SMBC AVIATION CAPITAL FINANCE DAC 5.45% S/A 03MAY2028 REGS	-	700,000	-	-	700,000
SOCIETE GENERALE SA 4.125% A 2JUN2027	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-
SOCIETE GENERALE SA 5.625% A 2JUN2033	-	400,000	-	(400,000)	-
SOCIETE GENERALE SA 6.446% S/A 10JAN2029 REGS	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-
SOCIETE GENERALE SA 6.691% S/A 10JAN2034 REGS	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-
SOCIETE GENERALE SA 7.367% S/A 10JAN2053 REGS	-	1,500,000	-	(1,500,000)	-
SOMPO JAPAN INSURANCE INC 5.325% S/A 28MAR2073 REGS(CALLED)	2,000,000	-	-	(2,000,000)	-
SOUTHWEST GAS CORP 5.45% S/A 23MAR2028	-	500,000	-	(500,000)	-
STANDARD CHARTERED PLC 6.17% S/A 09JAN2027	-	2,000,000	-	(2,000,000)	-
STANDARD CHARTERED PLC 6.187% S/A 6JUL2027 REGS	-	1,200,000	-	(1,200,000)	-
STANDARD CHARTERED PLC 6.296% S/A 06JUL2034 REGS	-	600,000	-	(600,000)	-
STANDARD CHARTERED PLC 6.301% S/A 09JAN2029	-	700,000	-	(700,000)	-
STANDARD CHARTERED PLC 7.75% S/A PERP REGS(CALLED)	1,000,000	1,000,000	-	(2,000,000)	-
STANDARD CHARTERED PLC S+1.93% Q 06JUL2027 REGS	-	1,000,000	-	-	1,000,000
STATE GRID OVERSEAS INVESTMENT 2013 LTD 3.125% S/A 22MAY2023 REGS	-	940,000	-	(940,000)	-

华夏精选固定收益配置基金
(华夏精选基金的子基金)

投资组合持有变动表 (未审计) (续)

自 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

	2023 年 1 月 1 日	增加	持有量的变动 红利/ 股息	处置	2023 年 6 月 30 日
债务证券 (续)					
SUMITOMO LIFE INSURANCE CO 6.5% S/A 20SEP2073 REGS	-	2,725,000	-	-	2,725,000
SUMITOMO MITSUI FINANCE & LEASING CO LTD 5.353% S/A 25APR2028	-	800,000	-	-	800,000
SUMITOMO MITSUI FINANCIAL GROUP INC 5.464% S/A 13JAN26	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-
SUMITOMO MITSUI FINANCIAL GROUP INC 5.52% S/A 13JAN2028	-	2,000,000	-	(2,000,000)	-
SUMITOMO MITSUI FINANCIAL GROUP INC 5.766% S/A 13JAN33	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-
SUMITOMO MITSUI TRUST BANK LTD 5.5% S/A 9MAR2028	-	1,300,000	-	-	1,300,000
SUMITOMO MITSUI TRUST BANK LTD 5.65% S/A 9MAR2026	-	1,500,000	-	(1,000,000)	500,000
SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP CO LTD 3.75% S/A 23JAN2023	200,000	-	-	(200,000)	-
SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP CO LTD 5.95% S/A 17JUL2026	-	550,000	-	(550,000)	-
SVENSKA HANDELSBANKEN AB S+1.25% Q 15JUN2026 REGS	-	1,000,000	-	-	1,000,000
SYNCHRONY FINANCIAL 7.25% S/A 02FEB2033	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-
TARGET CORP 4.8% S/A 15JAN2053	-	400,000	-	(400,000)	-
TENCENT HLDGS LTD 2.985% S/A 19JAN2023	1,000,000	-	-	(1,000,000)	-
TENCENT HLDGS LTD 3M L+0.605% Q 19JAN2023 REGS	2,100,000	-	-	(2,100,000)	-
TFI OVERSEAS INVESTMENT LTD 5.15% A 01FEB2023	470,000	-	-	(470,000)	-
TFI OVERSEAS INVESTMENT LTD 5.8% A 02MAY2023	900,000	-	-	(900,000)	-
THAI OIL PCL 3.625% S/A 23JAN2023 REGS	2,000,000	-	-	(2,000,000)	-
TOYOTA MOTOR CREDIT CORP 4.8% S/A 10JAN2025	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-
TOYOTA MOTOR CREDIT CORP 4.625% S/A 12JAN2028	-	500,000	-	(500,000)	-
TOYOTA MOTOR CREDIT CORP 4.7% S/A 12JAN2033	-	250,000	-	(250,000)	-
TRAVELERS COS INC 5.45% S/A 25MAY2053	-	200,000	-	(200,000)	-
TRIMBLE INC 6.1% S/A 15MAR2033	-	400,000	-	(400,000)	-
UBS GROUP AG 5.959% S/A 12JAN2034 REGS	-	2,000,000	-	(2,000,000)	-
UNITED PARCEL SERVICE INC 4.875% S/A 3MAR2033	-	700,000	-	(700,000)	-

华夏精选固定收益配置基金
(华夏精选基金的子基金)

投资组合持有变动表(未审计)(续)

自 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

	2023 年 1 月 1 日	增加	持有量的变动 红利/ 股息	处置	2023 年 6 月 30 日
<u>债务证券</u> (续)					
UNITED PARCEL SERVICE INC 5.05% S/A 3MAR2053	-	200,000	-	(200,000)	-
VANKE REAL ESTATE HONG KONG CO LTD 3M L+1.55% Q 25MAY2023	1,500,000	600,000	-	(2,100,000)	-
VERIZON COMMUNICATIONS INC 5.05% S/A 9MAY2033	-	500,000	-	(500,000)	-
WALMART INC 3.9% S/A 15APR2028	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-
WALMART INC 4% S/A 15APR2026	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-
WELLS FARGO & CO 5.389% S/A 24APR2034	-	400,000	-	(400,000)	-
WISCONSIN POWER AND LIGHT CO 4.95% S/A 1APR2033	-	250,000	-	(250,000)	-
WOORI BANK 4.875% S/A 26JAN2028 REGS	-	500,000	-	(500,000)	-

华夏精选固定收益配置基金
(华夏精选基金的子基金)

投资组合持有变动表(未审计)(续)

自 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

	2023 年 1 月 1 日	增加	持有量的变动 红利/ 股息	处置	2023 年 6 月 30 日
集体投资计划					
CHINAAMC GLOBAL INVESTMENT GRADE BOND FUND-I DIS USD A	465,844	-	-	-	465,844
CHINAAMC GLOBAL SELCTED INCOME FUND-I A USD	509,716	-	-	-	509,716
CHINAAMC SELECT MONEY MARKET FUND-I HKD	1,041,451	-	-	-	1,041,451
CHINAAMC SELECT RMB INVESTMENT GRADE INCOME FUND-I USD HEDGED ACC	199,740	-	-	-	199,740
远期外汇合约					
Buy CNY 45,032,923.87 and Sell USD 6,503,794.55					
T/D 2022-12-19 S/D 2023-03-31	1	-	-	(1)	-
Buy USD 700,297.41 and Sell CNY 4,786,042.60					
T/D 2023-01-09 S/D 2023-03-31	-	1	-	(1)	-
Buy CNY 20,998,000.00 and Sell USD 3,107,316.21					
T/D 2022-02-10 S/D 2022-03-31	-	1	-	(1)	-
Buy USD 8,888,307.27 and Sell CNY 61,244,811.27					
T/D 2023-03-22 S/D 2023-03-31	-	1	-	(1)	-
Buy CNY 61,625,330.41 and Sell USD 9,017,461.28					
T/D 2022-03-22 S/D 2022-06-30	-	1	-	(1)	-
Buy USD 3,013,668.75 and Sell CNY 21,119,790.57					
T/D 2023-05-22 S/D 2023-06-30	-	1	-	(1)	-
Buy USD 5,639,947.62 and Sell CNY 40,505,539.84					
T/D 2023-06-20 S/D 2022-06-30	-	1	-	(1)	-
Buy CNY 41,077,130.19 and Sell USD 5,766,020.52					
T/D 2022-06-20 S/D 2022-09-29	-	1	-	-	1
投资组合合计	38,535,751	203,420,000	-	(194,059,000)	47,896,751

华夏精选固定收益配置基金
(华夏精选基金的子基金)

金融衍生工具的详情 (未审计)

于2023年6月30日, 本子基金持有的金融衍生工具详情如下:

远期外汇合约

描述	相关资产	交易对手	公允价值 美元
<u>金融负债:</u>			
Buy CNY 41,077,130 and Sell USD 5,766,020 T/D 2023-06-20 S/D 2023-09-29	无	中国银行 (香港) 有限公司	(80,434)

华夏精选固定收益配置基金
(华夏精选基金的子基金)

投资组合列表 (未审计)

2023 年 6 月 30 日

	票面价值 美元	公允价值 美元	在资产净值 中的占比
<u>上市债务证券</u>			
开曼群岛			
CCBL CAYMAN 1 CORP LTD 3M L+1.25% Q 12JUL2023	700,000	700,042	1.21%
MIZUHO FINANCIAL GROUP CAYMAN 3 LTD 4.6% S/A 27MAR2024 REGS	1,000,000	985,440	1.71%
OVERSEAS CHINESE TOWN ASIA HLDGS LTD 4.5% S/A PERP	2,400,000	2,395,008	4.15%
加拿大			
BANK OF MONTREAL 4.338% S/A 05OCT2028	2,000,000	1,976,340	3.43%
中国内地			
CHINA CONSTRUCTION BANK CORP 4.25% S/A 27FEB2029	2,000,000	1,975,380	3.42%
香港特别行政区			
CHINA TAIPING INSURANCE HLDGS CO LTD 6.4% S/A PERP	1,000,000	1,039,380	1.80%
印度尼西亚			
BANK MANDIRI PERSERO TBK PT 5.5% S/A 04APR2026	800,000	800,040	1.39%
日本			
AOZORA BANK LTD 5.9% S/A 02MAR2026	1,000,000	999,230	1.73%
ASAHI MUTUAL LIFE INSURANCE CO 6.5% S/A PERP	2,900,000	2,889,183	5.01%
ASAHI MUTUAL LIFE INSURANCE CO 6.9% S/A PERP	800,000	809,888	1.40%
FUKOKU MUTUAL LIFE INSURANCE CO 6.5% S/A PERP	2,000,000	1,993,700	3.46%
NORINCHUKIN BANK 5.43% S/A 09MAR2028 REGS	1,000,000	1,007,960	1.75%
SUMITOMO MITSUI FINANCE & LEASING CO LTD 5.353% S/A 25APR2028	800,000	795,192	1.38%
SUMITOMO MITSUI TRUST BANK LTD 5.5% S/A 9MAR2028	1,300,000	1,309,555	2.27%
SUMITOMO MITSUI TRUST BANK LTD 5.65% S/A 9MAR2026	500,000	500,485	0.87%

华夏精选固定收益配置基金
(华夏精选基金的子基金)

投资组合列表 (未审计) (续)

2023 年 6 月 30 日

	票面价值 美元	公允价值 美元	在资产净值 中的占比
<u>上市债务证券 (续)</u>			
韩国			
SHINHAN FINANCIAL GROUP CO LTD 5.875% S/A PERP	1,000,000	996,070	1.73%
SK ON CO LTD 5.375% S/A 11MAY2026	1,000,000	992,230	1.72%
新加坡			
BOC AVIATION LTD 3M L+1.125% Q 26SEP2023 REGS	2,000,000	2,000,960	3.47%
泰国			
EXPORT-IMPORT BANK OF THAILAND 3M L+0.9% Q 20NOV2023	2,000,000	2,000,960	3.47%
英国			
STANDARD CHARTERED PLC S+1.93% Q 06JUL2027 REGS	1,000,000	1,004,790	1.74%
MEXICO GOVERNMENT INTL BOND 6.338% S/A 4MAY2053	400,000	408,292	0.71%
HYATT HOTELS CORP 5.75% S/A 30JAN2027	500,000	498,170	0.86%
美国			
BANK OF AMERICA CORP 3.864% S/A 23JUL2024	1,500,000	1,498,005	2.60%
阿联酋			
MDGH GMTN RSC LTD 5.084% S/A 22MAY2053 REGS	400,000	399,112	0.69%
英属维尔京群岛			
CMHI FINANCE BVI CO LTD 3.5% S/A PERP	1,000,000	993,000	1.72%
EASTERN CREATION II INVESTMENT HLDGS LTD 1% S/A 10SEP2023	300,000	297,282	0.52%
HUARONG FINANCE 2017 CO LTD 3M L+1.325% Q 03JUL2023	2,355,000	2,355,471	4.08%
HUARONG FINANCE 2019 CO LTD 2.125% S/A 30SEP2023	500,000	493,870	0.86%
HUARONG FINANCE 2019 CO LTD 3.75% S/A 29MAY2024	1,200,000	1,154,016	2.00%
SINOCHAM OFFSHORE CAPITAL CO LTD 3% S/A PERP	2,000,000	1,979,540	3.43%

华夏精选固定收益配置基金
(华夏精选基金的子基金)

投资组合列表(未审计)(续)

2023年6月30日

	票面价值 美元	公允价值 美元	在资产净值 中的占比
<u>非上市债务证券(续)</u>			
澳大利亚 AUST & NZ BANK GP S+0.75% Q 03JUL2025 REGS	600,000	601,128	1.04%
智利 INVERSIONES CMPC SA 6.125% S/A 23JUN2033 REGS	600,000	604,824	1.05%
法国 ELECTRICITE DE FRANCE SA 5.7% S/A 23MAY2028 REGS	1,000,000	1,000,580	1.73%
爱尔兰 SMBC AVIATION CAPITAL FINANCE DAC 5.45% S/A 03MAY2028 REGS	700,000	689,766	1.20%
日本 SUMITOMO LIFE INSURANCE CO 6.5% S/A 20SEP2073 REGS	2,725,000	2,714,264	4.71%
荷兰 PETROBRAS GLOBAL FINANCE BV 6.5% S/A 3JUL2033	1,300,000	1,273,285	2.21%
瑞典 SVENSKA HANDELSBANKEN AB S+1.25% Q 15JUN2026 REGS	1,000,000	1,005,050	1.74%
英国 HSBC HLDGS PLC 4.25% S/A 14MAR2024	500,000	493,345	0.86%
美国 NEXTERA ENERGY CAPITAL HLDGS INC 6.051% S/A 01MAR2025	1,100,000	1,106,182	1.92%

华夏精选固定收益配置基金
(华夏精选基金的子基金)

投资组合列表 (未审计) (续)

2023 年 6 月 30 日

	票面价值 美元	公允价值 美元	在资产净值 中的占比
<u>集体投资计划</u>			
<u>香港特别行政区</u>			
CHINAAMC GLOBAL INVESTMENT GRADE BOND FUND-I DIS USD A	465,844	5,338,108	9.24%
CHINAAMC SELECT MONEY MARKET FUND-I HKD	1,041,451	1,386,306	2.39%
CHINAAMC SELECT RMB INVESTMENT GRADE INCOME FUND-I USD HEDGED ACC	199,740	2,115,270	3.66%
<u>卢森堡</u>			
CHINAAMC GLOBAL SELECTED INCOME FUND-I A USD	509,716	5,305,124	9.19%
<u>远期外汇合约</u>			
Buy CNY 41,077,130 and Sell USD 5,766,020 (交易对手: 中国银行(香港)有限公司)		(80,434)	-0.14%
投资组合合计		59,600,629	103.32%
其他资产净值		(1,917,526)	-3.32%
截至 2023 年 6 月 30 日的净资产总额		57,683,103	100.00%
投资总额 (按成本计量)		60,017,108	

华夏精选固定收益配置基金
(华夏精选基金的子基金)

股息披露 (未审计)

自 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

基金管理人可以凭其绝对酌情权，决定在每个财政期间的确定时间将收益分配给基金份额持有人，或在任意财政期间不做任何分配。分配给基金份额持有人的款项（如有）可以用本子基金的资本支付或实际上用本子基金的资本间接支付。

在截至 2023 年 6 月 30 日和截至 2022 年 6 月 30 日的期间，本子基金未派发任何股息。