

华夏智胜价值成长股票型发起式
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：招商银行股份有限公司

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。

基金托管人招商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.....	5
§4 管理人报告.....	6
§5 托管人报告.....	10
§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.....	12
6.3 净资产变动表.....	13
6.4 报表附注.....	15
§7 投资组合报告.....	37
7.1 期末基金资产组合情况.....	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	38
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.....	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	54
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	55
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.....	56
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.....	56
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.....	56
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.....	56
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	56
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	56
7.12 投资组合报告附注.....	56
§8 基金份额持有人信息.....	57
§9 开放式基金份额变动.....	58
§10 重大事件揭示.....	58
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	60
§12 备查文件目录.....	61

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金	
基金简称	华夏智胜价值成长股票	
基金主代码	002871	
交易代码	002871	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 3 月 6 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	
报告期末基金份额总额	352,565,299.98 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华夏智胜价值成长股票 A	华夏智胜价值成长股票 C
下属分级基金的交易代码	002871	002872
报告期末下属分级基金的份额总额	245,971,925.01 份	106,593,374.97 份

2.2 基金产品说明

投资目标	利用定量投资模型，灵活应用多种策略，把握市场机会，追求资产的长期增值。
投资策略	主要投资策略包括资产配置策略、股票投资策略、固定收益品种投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、期权投资策略、国债期货投资策略等。在股票投资策略上，本基金采用混合多种投资策略，包含基本面选股策略、多因子策略，辅助其他投资策略如套利类策略、衍生品交易类策略等。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率*95%+银行活期存款利率(税后)*5%。
风险收益特征	本基金为股票基金，其预期风险和预期收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金还可通过港股通渠道投资于香港证券市场，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还将面临汇率风险、香港市场风险等特殊投资风险。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华夏基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李彬	张姗
	联系电话	400-818-6666	400-61-95555
	电子邮箱	service@ChinaAMC.com	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		400-818-6666	400-61-95555
传真		010-63136700	0755-83195201

注册地址	北京市顺义区安庆大街甲3号院	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
办公地址	北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座8层	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
邮政编码	100033	518040
法定代表人	张佑君	缪建民

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金中期报告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	华夏基金管理有限公司	北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 8 层

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日）	
	华夏智胜价值成长股票 A	华夏智胜价值成长股票 C
本期已实现收益	-47,157,052.16	-53,066,305.35
本期利润	-38,548,723.68	-69,313,856.47
加权平均基金份额本期利润	-0.1460	-0.2931
本期加权平均净值利润率	-10.32%	-20.96%
本期基金份额净值增长率	-9.52%	-9.63%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)	
	华夏智胜价值成长股票 A	华夏智胜价值成长股票 C
期末可供分配利润	72,939,545.38	30,093,973.13
期末可供分配基金份额利润	0.2965	0.2823
期末基金资产净值	334,631,513.43	143,398,020.48
期末基金份额净值	1.3604	1.3453
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)	
	华夏智胜价值成长股票 A	华夏智胜价值成长股票 C
基金份额累计净值增长率	40.90%	48.68%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华夏智胜价值成长股票 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	-5.78%	1.02%	-6.55%	0.91%	0.77%	0.11%
过去三个月	-4.51%	1.14%	-6.16%	1.09%	1.65%	0.05%
过去六个月	-9.52%	1.51%	-8.46%	1.53%	-1.06%	-0.02%
过去一年	-13.32%	1.18%	-16.71%	1.21%	3.39%	-0.03%
过去三年	-4.82%	1.13%	-20.13%	1.13%	15.31%	0.00%
自基金转型起至今	40.90%	1.21%	-6.40%	1.15%	47.30%	0.06%

华夏智胜价值成长股票 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	-5.80%	1.02%	-6.55%	0.91%	0.75%	0.11%
过去三个月	-4.56%	1.14%	-6.16%	1.09%	1.60%	0.05%
过去六个月	-9.63%	1.51%	-8.46%	1.53%	-1.17%	-0.02%
过去一年	-13.53%	1.18%	-16.71%	1.21%	3.18%	-0.03%
过去三年	-5.53%	1.13%	-20.13%	1.13%	14.60%	0.00%
2019 年 12 月 24 日起至今	48.68%	1.21%	-4.26%	1.13%	52.94%	0.08%

注：2018 年 3 月 6 日至 2018 年 12 月 25 日，2019 年 1 月 7 日至 2019 年 12 月 23 日期间，华夏智胜价值成长股票 C 类基金份额为零。

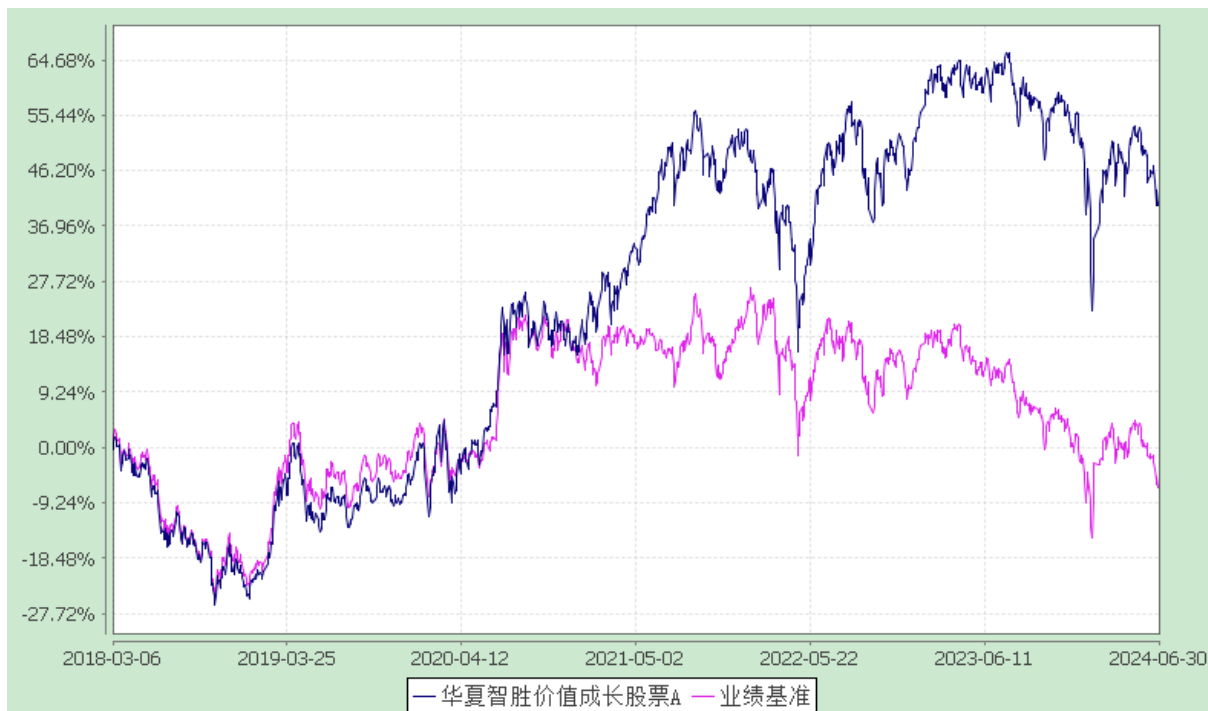
3.2.2 自基金转型以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金

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

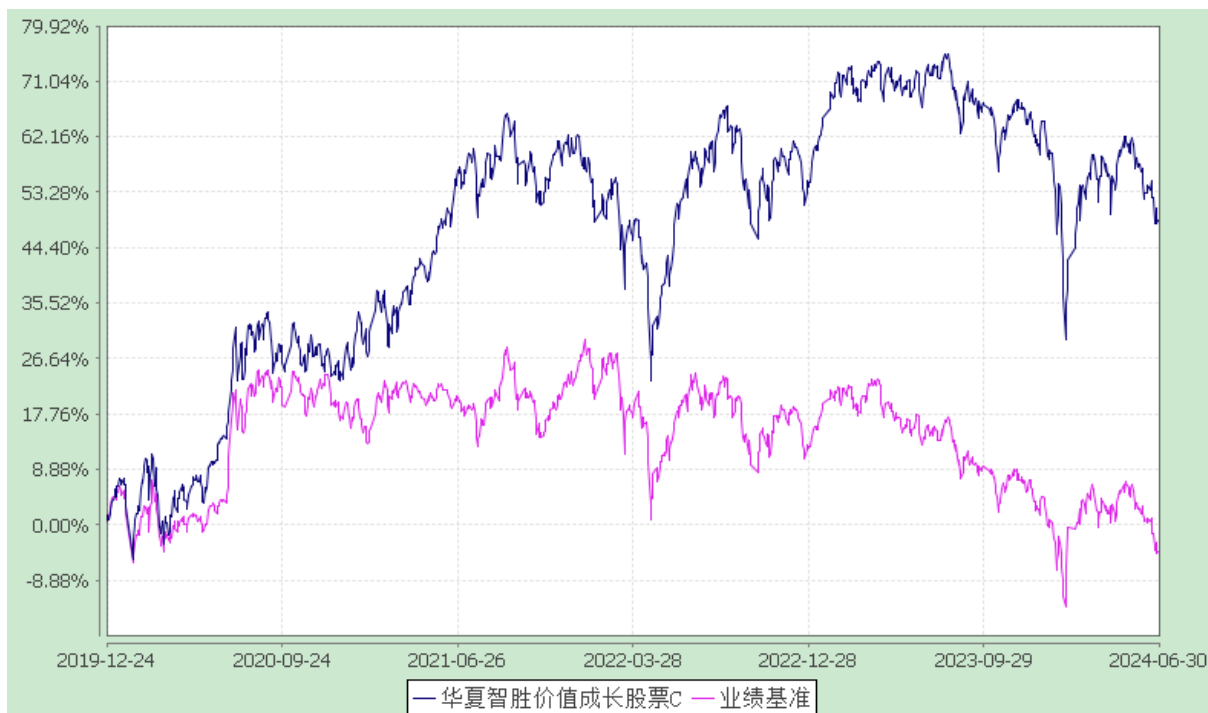
(2018 年 3 月 6 日至 2024 年 6 月 30 日)

华夏智胜价值成长股票 A



注：本基金自 2018 年 3 月 6 日起由“华夏新锦源灵活配置混合型证券投资基金”转型而来。

华夏智胜价值成长股票 C



注：2018 年 3 月 6 日至 2018 年 12 月 25 日，2019 年 1 月 7 日至 2019 年 12 月 23 日期间，华夏智胜价值成长股票 C 类基金份额为零。

§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)中华夏收益债券(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)中华夏亚债中国指数(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		
孙蒙	本基金的 基金经理	2020-03-17	-	10 年	硕士。曾任中信建投证券股份有限公司研究员、投资经理等。2017 年 7 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。
孙然晔	本基金的 基金经理	2022-07-04	-	10 年	博士。曾任美国银行企业投资部资深量化研究员,美国 AQR 资本管理公司量化研究员。2019 年 8 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。
叶津佐	本基金的 基金经理 助理	2023-03-28	-	7 年	博士。2017 年 7 月加入华夏基金管理有限公司。历任数量投资部研究员。

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

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，本基金管理人旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 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

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，行业间表现分化较大：银行、煤炭、公用事业等高股息特征行业表现较好，而计算机、商业贸易、社会服务等成长、消费行业表现较差。市场风格期间保持稳定，低估值、盈利等因

子表现较好，而小市值、反转等因子表现较差，量化策略整体表现较好。

基金投资运作方面，本基金以多因子量化投资策略为主，我们在依据量化模型进行股票投资决策之外，还积极参与了科创板、创业板新股申购，获取较为确定性的收益增厚机会。同时，本基金秉承尽职尽责的态度，认真应对投资者日常申购、赎回等工作。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2024 年 6 月 30 日，华夏智胜价值成长股票 A 基金份额净值为 1.3604 元，本报告期份额净值增长率为-9.52%；华夏智胜价值成长股票 C 基金份额净值为 1.3453 元，本报告期份额净值增长率为-9.63%，同期业绩比较基准增长率为-8.46%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，政府财政支出预计加快，经济增长速度基本实现设定目标，这将带动 A 股上市公司盈利恢复小幅增长，但是 M2 增速处于较低水平，市场难有大幅上涨行情。预计市场继续区间震荡，风格将呈现轮动特征，建议均衡配置。

珍惜基金份额持有人的每一份投资和每一份信任，本基金将继续奉行华夏基金管理有限公司“为信任奉献回报”的经营理念，规范运作，审慎投资，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求长期、稳定的回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及基金合同约定，本基金管理人作为准确、及时进行基金估值和份额净值计价，制定了基金估值和份额净值计价的业务管理制度，建立了估值委员会，使用可靠的估值业务系统，设有完善的风险监测、控制和报告机制。本基金托管人审阅本基金管理人采用的估值原则及技术，并复核、审查基金资产净值和基金份额申购、赎回价格。会计师事务所对估值调整导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上时对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性发表专业意见。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明

托管人声明:

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度, 我行在履行托管职责中, 严格遵守有关法律法规、托管协议的规定, 尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款, 对托管产品的投资行为进行监督, 并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则, 独立地设置、登录和保管本产品的全套账册, 进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本中期报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确, 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：华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金

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
资产：			
货币资金	6.4.7.1	24,724,362.72	60,677,087.31
结算备付金		5,879,701.55	6,003,889.68
存出保证金		597,384.27	940,981.41
交易性金融资产	6.4.7.2	449,467,390.15	1,025,226,668.90
其中：股票投资		449,467,390.15	1,024,648,781.35
基金投资		-	-
债券投资		-	577,887.55
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		10,648,560.90	3,864,612.15
应收股利		-	-
应收申购款		430,693.98	3,944,965.26
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		491,748,093.57	1,100,658,204.71
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	2,667,393.91
应付赎回款		12,441,953.28	8,165,015.74
应付管理人报酬		421,019.36	937,936.07
应付托管费		84,203.86	187,587.22
应付销售服务费		32,702.08	145,938.25
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	1.93
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	738,681.08	500,020.90
负债合计		13,718,559.66	12,603,894.02
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	352,565,299.98	728,069,364.71
未分配利润	6.4.7.8	125,464,233.93	359,984,945.98
净资产合计		478,029,533.91	1,088,054,310.69
负债和净资产总计		491,748,093.57	1,100,658,204.71

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，华夏智胜价值成长股票 A 基金份额净值 1.3604 元，华夏智胜价值成长股票 C 基金份额净值 1.3453 元；华夏智胜价值成长股票基金份额总额 352,565,299.98 份（其中 A 类 245,971,925.01 份，C 类 106,593,374.97 份）。

6.2 利润表

会计主体：华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金

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
----	-----	--	---

一、营业总收入		-103,184,008.97	58,271,069.92
1.利息收入		127,401.79	128,384.87
其中：存款利息收入	6.4.7.9	127,401.79	128,384.87
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）		-96,073,345.66	59,369,054.35
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-102,005,589.39	49,901,677.60
基金投资收益	6.4.7.11	-	-
债券投资收益	6.4.7.12	90,936.39	281,955.85
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	-540,784.40	31,509.87
股利收益	6.4.7.16	6,382,091.74	9,153,911.03
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-7,639,222.64	-1,589,734.55
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	401,157.54	363,365.25
减：二、营业总支出		4,678,571.18	5,492,514.79
1.管理人报酬		3,479,139.78	3,897,238.21
2.托管费		695,827.99	779,447.70
3.销售服务费		406,179.56	723,069.67
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		0.28	307.76
8.其他费用	6.4.7.21	97,423.57	92,451.45
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-107,862,580.15	52,778,555.13
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-107,862,580.15	52,778,555.13
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-107,862,580.15	52,778,555.13

6.3 净资产变动表

会计主体：华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金

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	728,069,364.71	359,984,945.98	1,088,054,310.69
二、本期期初净资产	728,069,364.71	359,984,945.98	1,088,054,310.69
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-375,504,064.73	-234,520,712.05	-610,024,776.78
（一）、综合收益总额	-	-107,862,580.15	-107,862,580.15
（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）	-375,504,064.73	-126,658,131.90	-502,162,196.63
其中：1.基金申购款	189,607,874.51	69,894,556.43	259,502,430.94
2.基金赎回款	-565,111,939.24	-196,552,688.33	-761,664,627.57
（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	352,565,299.98	125,464,233.93	478,029,533.91
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	256,154,243.99	103,727,863.59	359,882,107.58
二、本期期初净资产	256,154,243.99	103,727,863.59	359,882,107.58
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	432,506,054.34	282,431,466.60	714,937,520.94
（一）、综合收益总额	-	52,778,555.13	52,778,555.13
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净	432,506,054.34	229,652,911.47	662,158,965.81

资产减少以“-”号填列)			
其中：1.基金申购款	709,439,214.63	381,759,901.45	1,091,199,116.08
2.基金赎回款	-276,933,160.29	-152,106,989.98	-429,040,150.27
(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	688,660,298.33	386,159,330.19	1,074,819,628.52

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

根据原华夏新锦源灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“华夏新锦源混合”）基金份额持有人大会审议通过的《关于华夏新锦源灵活配置混合型证券投资基金转型为华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金有关事项的议案》以及相关法律法规的规定，并向中国证券监督管理委员会备案，华夏新锦源混合于 2018 年 3 月 6 日转型为华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）。本基金为契约型开放式，存续期限为不定期。本基金的基金管理人为华夏基金管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

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，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括创业板、存托凭证及其他中国证监会注册或核准上市的股票）、港股通标的股票、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、衍生品（包括股指期货、国债期货、期权等）、货币市场工具（含同业存单）、资产支持证券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。

本基金可根据相关法律法规和《基金合同》的约定，参与融资业务。

本基金投资组合比例为：股票投资占基金资产的比例为 80%–95%，港股通标的股票投资占股票资产的比例为 0-50%，每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货、期权合约需缴纳的交易保证金

后，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布和修订的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则(以下合称“企业会计准则”)、中国证券投资基金业协会(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	24,724,362.72
等于：本金	24,721,771.29
加：应计利息	2,591.43
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	24,724,362.72

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		464,866,288.33	-	449,467,390.15	-15,398,898.18
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		464,866,288.33	-	449,467,390.15	-15,398,898.18

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	3,228,400.00	-	-	-
其中：股指期货	3,228,400.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	3,228,400.00	-	-	-

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
IC2412	中证 500 期 货 IC2412 合约	3	2,900,280.00	-328,120.00
合计	-	-	-	-328,120.00
减：可抵销期货暂收 款	-	-	-	-328,120.00
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	20,384.92
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	628,788.56
其中：交易所市场	628,788.56
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	89,507.60
合计	738,681.08

6.4.7.7 实收基金

华夏智胜价值成长股票 A

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	账面金额
上年度末	278,848,250.97	278,848,250.97
本期申购	64,333,839.89	64,333,839.89
本期赎回（以“-”号填列）	-97,210,165.85	-97,210,165.85
本期末	245,971,925.01	245,971,925.01

华夏智胜价值成长股票 C

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	账面金额
上年度末	449,221,113.74	449,221,113.74
本期申购	125,274,034.62	125,274,034.62
本期赎回（以“-”号填列）	-467,901,773.39	-467,901,773.39
本期末	106,593,374.97	106,593,374.97

6.4.7.8 未分配利润

华夏智胜价值成长股票 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	133,698,344.44	6,740,789.80	140,439,134.24
本期期初	133,698,344.44	6,740,789.80	140,439,134.24
本期利润	-47,157,052.16	8,608,328.48	-38,548,723.68
本期基金份额交易产生的变动数	-13,601,746.90	370,924.76	-13,230,822.14

其中：基金申购款	21,465,998.65	1,110,695.92	22,576,694.57
基金赎回款	-35,067,745.55	-739,771.16	-35,807,516.71
本期已分配利润	-	-	-
本期末	72,939,545.38	15,720,043.04	88,659,588.42

华夏智胜价值成长股票 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	208,940,111.44	10,605,700.30	219,545,811.74
本期期初	208,940,111.44	10,605,700.30	219,545,811.74
本期利润	-53,066,305.35	-16,247,551.12	-69,313,856.47
本期基金份额交易产生的变动数	-125,779,832.96	12,352,523.20	-113,427,309.76
其中：基金申购款	39,395,936.47	7,921,925.39	47,317,861.86
基金赎回款	-165,175,769.43	4,430,597.81	-160,745,171.62
本期已分配利润	-	-	-
本期末	30,093,973.13	6,710,672.38	36,804,645.51

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	78,290.34
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	47,384.76
其他	1,726.69
合计	127,401.79

6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	4,781,684,725.57
减：卖出股票成本总额	4,879,844,069.40
减：交易费用	3,846,245.56
买卖股票差价收入	-102,005,589.39

6.4.7.11 基金投资收益

无。

6.4.7.12 债券投资收益

6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
债券投资收益——利息收入	74.27
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	90,862.12
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	90,936.39

6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	653,533.88
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	562,500.00
减：应计利息总额	145.64
减：交易费用	26.12
买卖债券差价收入	90,862.12

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	-540,784.40

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	6,382,091.74
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	6,382,091.74

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	-7,560,862.64
——股票投资	-7,545,544.14
——债券投资	-15,318.50
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-78,360.00
——权证投资	-
——期货投资	-78,360.00
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	-7,639,222.64

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	401,157.54
合计	401,157.54

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	29,835.26
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行费用	7,913.95
存托服务费	2.02
合计	97,423.57

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
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	基金托管人
中信证券股份有限公司（“中信证券”）	基金管理人的股东
上海华夏财富投资管理有限公司（“华夏财富”）	基金管理人的子公司
中信证券华南股份有限公司（“中信证券（华南）”）	基金管理人第一大股东的子公司
中信期货有限公司（“中信期货”）	基金管理人第一大股东的子公司
中信证券(山东)有限责任公司（“中信证券（山东）”）	基金管理人第一大股东的子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

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	9,092,164,523.78	100.00%	1,219,834,049.96	23.79%

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 债券交易

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	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
中信证券	653,533.88	100.00%	201,998.58	14.54%

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	871,927.83	100.00%	468,230.41	74.47%
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	437,438.34	20.60%	210,434.87	13.63%

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	3,479,139.78	3,897,238.21
其中：应支付销售机构的客户维护费	727,388.67	579,146.66
应支付基金管理人的净管理费	2,751,751.11	3,318,091.55

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 1.00%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×1.00%/当年天数。

③客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用按照代销机构所代销基金的份额保有量作为基数进行计算，从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 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托管费	695,827.99	779,447.70

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 0.20%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×0.20%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的 各关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华夏智胜价值成长股 票 A	华夏智胜价值成长股票 C	合计
华夏基金管理有限公司	-	66,485.68	66,485.68
招商银行	-	26,266.71	26,266.71
中信证券	-	8,061.29	8,061.29
华夏财富	-	4,276.78	4,276.78
中信证券（山东）	-	564.62	564.62
中信证券（华南）	-	192.77	192.77
中信期货	-	57.96	57.96
合计	-	105,905.81	105,905.81
获得销售服务费的 各关联方名称	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华夏智胜价值成长股 票 A	华夏智胜价值成长股票 C	合计
华夏基金管理有限公司	-	346,575.04	346,575.04
招商银行	-	8,826.34	8,826.34

中信证券	-	7,017.31	7,017.31
华夏财富	-	254.32	254.32
中信证券（山东）	-	125.78	125.78
中信期货	-	75.79	75.79
中信证券（华南）	-	44.04	44.04
合计	-	362,918.62	362,918.62

注：①支付基金销售机构的基金销售服务费按 C 类基金份额前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给基金管理人，再由基金管理人计算并支付给各基金销售机构。

②基金销售服务费计算公式为：C 类日基金销售服务费 = 前一日 C 类基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

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	
	华夏智胜价值成长 股票A	华夏智胜价值成长 股票C	华夏智胜价值成长 股票A	华夏智胜价值成长 股票C
期初持有的基金份额	10,608,423.83	-	10,608,423.83	-
期间申购/买入总份 额	-	-	-	-
期间因拆分变动份额	-	-	-	-
减：期间赎回/卖出总 份额	-	-	-	-
期末持有的基金份额	10,608,423.83	-	10,608,423.83	-
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	4.31%	-	4.26%	-

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		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
招商银行活期存款	24,724,362.72	78,290.34	65,627,322.29	92,776.38

注：本基金的活期银行存款由基金托管人招商银行保管，按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期					
2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
中信证券	601033	永兴股份	新股发行	12,577	203,747.40
中信证券	688584	上海合晶	新股发行	8,659	196,212.94
中信证券	001359	平安电工	新股发行	1,833	31,875.87
上年度可比期间					
2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
中信证券	688343	云天励飞	新股发行	10,484	460,457.28
中信证券	001286	陕西能源	新股发行	37,667	361,603.20
中信证券	688146	中船特气	新股发行	7,317	264,509.55
中信证券	688581	安杰思	新股发行	1,629	204,928.20
中信证券	688539	高华科技	新股发行	5,334	203,865.48
中信证券	688522	纳睿雷达	新股发行	3,836	179,064.48
中信证券	301439	泓淋电力	新股发行	7,083	141,589.17
中信证券	688523	航天环宇	新股发行	4,717	103,113.62
中信证券	301293	三博脑科	新股发行	3,324	98,390.40
中信证券	301323	新莱福	新股发行	2,277	88,939.62
中信证券	688631	莱斯信息	新股发行	3,357	84,864.96
中信证券	301170	锡南科技	新股发行	2,496	84,864.00
中信证券	301157	华塑科技	新股发行	1,498	84,637.00
中信证券	601133	柏诚股份	新股发行	6,632	77,329.12
中信证券	301261	恒工精密	新股发行	1,973	72,803.70
中信证券	603281	江瀚新材	新股发行	863	30,714.17

中信证券	001367	海森药业	新股发行	549	24,419.52
中信证券	001324	长青科技	新股发行	1,131	21,353.28
中信证券	603162	海通发展	新股发行	523	19,481.75

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

无。

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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688717	艾罗能源	2023-12-26	6 个月	新发流通受限	55.66	47.02	11,303	629,124.98	531,467.06	-
301589	诺瓦星云	2024-02-01	6 个月	新发流通受限	126.89	188.01	1,244	87,680.99	233,884.44	含证券送配
688692	达梦数据	2024-06-04	6 个月	新发流通受限	86.96	174.93	175	15,218.00	30,612.75	-
603285	键邦股份	2024-06-28	1 个月内(含)	新发流通	18.65	18.65	1,158	21,596.70	21,596.70	-

				受限						
601033	永兴股份	2024-01-11	6 个月	新发流通受限	16.20	15.96	1,258	20,379.60	20,077.68	-
603350	安乃达	2024-06-26	1 个月内(含)	新发流通受限	20.56	20.56	945	19,429.20	19,429.20	-
301536	星宸科技	2024-03-20	6 个月	新发流通受限	16.16	32.27	481	7,772.96	15,521.87	-
688584	上海合晶	2024-02-01	6 个月	新发流通受限	22.66	15.89	866	19,623.56	13,760.74	-
301538	骏鼎达	2024-03-13	6 个月	新发流通受限	55.82	91.24	150	5,972.74	13,686.00	含 证 券 送 配
301565	中仑新材	2024-06-13	6 个月	新发流通受限	11.88	18.98	711	8,446.68	13,494.78	-
603341	龙旗科技	2024-02-23	6 个月	新发流通受限	26.00	37.49	298	7,748.00	11,172.02	-

688691	灿芯股份	2024-04-02	6 个月	新发流通受限	19.86	42.51	247	4,905.42	10,499.97	-
301566	达利凯普	2023-12-22	6 个月	新发流通受限	8.90	16.97	576	5,126.40	9,774.72	-
301392	汇成真空	2024-05-28	6 个月	新发流通受限	12.20	41.66	219	2,671.80	9,123.54	-
301591	肯特股份	2024-02-20	6 个月	新发流通受限	19.43	36.98	219	4,255.17	8,098.62	-
301587	中瑞股份	2024-03-27	6 个月	新发流通受限	21.73	25.26	306	6,649.38	7,729.56	-
001389	广合科技	2024-03-26	6 个月	新发流通受限	17.43	34.56	222	3,869.46	7,672.32	-
301539	宏鑫科技	2024-04-03	6 个月	新发流通受限	10.64	19.82	361	3,841.04	7,155.02	-
688695	中创股份	2024-03-06	6 个月	新发	22.43	31.55	186	4,171.98	5,868.30	-

				流通受限						
688530	欧莱新材	2024-04-29	6 个月	新发流通受限	9.60	16.10	344	3,302.40	5,538.40	-
301588	美新科技	2024-03-06	6 个月	新发流通受限	14.50	21.25	257	3,726.50	5,461.25	-
301502	华阳智能	2024-01-26	6 个月	新发流通受限	28.01	37.83	138	3,865.38	5,220.54	-
603325	博隆技术	2024-01-03	6 个月	新发流通受限	72.46	68.06	66	4,782.36	4,491.96	-
603381	永臻股份	2024-06-19	6 个月	新发流通受限	23.35	25.13	178	4,156.30	4,473.14	-
001359	平安电工	2024-03-19	6 个月	新发流通受限	17.39	20.60	184	3,199.76	3,790.40	-
603312	西典新能	2024-01-04	6 个月	新发流通	29.02	25.36	130	3,772.60	3,296.80	-

				受限						
603082	北自科技	2024-01-23	6 个月	新发流通受限	21.28	29.49	107	2,276.96	3,155.43	-
001379	腾达科技	2024-01-11	6 个月	新发流通受限	16.98	13.48	213	3,616.74	2,871.24	-
603375	盛景微	2024-01-17	6 个月	新发流通受限	38.18	38.90	72	2,748.96	2,800.80	-
603285	键邦股份	2024-06-28	6 个月	新发流通受限	18.65	18.65	129	2,405.85	2,405.85	-
603350	安乃达	2024-06-26	6 个月	新发流通受限	20.56	20.56	106	2,179.36	2,179.36	-

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

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

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

④基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的设定限售期的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的

约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

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。

本基金管理人通过限制投资集中度来管理投资品种变现的流动性风险。除在“6.4.12 期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限制的情况外，本基金所投资的证券均能及时变现。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

在资产端，本基金主要投资于基金合同约定的具有良好流动性的金融工具。基金管理人持续监测本基金持有资产的市场交易量、交易集中度等涉及资产流动性水平的风险指标，并定期开展压力测试，详细评估在不同的压力情景下资产变现情况的变化。

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

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

本基金管理人定期对组合中债券投资部分面临的利率风险进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

截至本期末，综合考虑利率债、信用债、同业存单、资产支持证券等资产占基金资产净值的比例，利率变动对于本基金资产净值无重大影响。

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。

本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险。此外，本基金管理人对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法进行风险度量和分析，以对风险进行跟踪和控制。

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	449,467,390.15	94.03	1,024,648,781.35	94.17
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	577,887.55	0.05
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	449,467,390.15	94.03	1,025,226,668.90	94.23

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 300 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%	-28,276,004.75	-43,065,453.93
	+5%	28,276,004.75	43,065,453.93

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	448,440,854.41
第二层次	45,611.11
第三层次	980,924.63
合计	449,467,390.15

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	449,467,390.15	91.40
	其中：股票	449,467,390.15	91.40
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	30,604,064.27	6.22
8	其他各项资产	11,676,639.15	2.37
9	合计	491,748,093.57	100.00

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	958,542.00	0.20
B	采矿业	33,248,759.95	6.96
C	制造业	264,016,275.96	55.23
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	17,271,177.72	3.61
E	建筑业	4,012,497.00	0.84
F	批发和零售业	17,951,771.04	3.76
G	交通运输、仓储和邮政业	11,611,571.80	2.43
H	住宿和餐饮业	49,140.00	0.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	23,094,334.48	4.83
J	金融业	56,775,237.08	11.88
K	房地产业	1,224,610.00	0.26
L	租赁和商务服务业	1,498,379.00	0.31
M	科学研究和技术服务业	3,489,724.00	0.73
N	水利、环境和公共设施管理业	1,915,873.12	0.40
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	984,275.00	0.21
Q	卫生和社会工作	7,002,410.00	1.46
R	文化、体育和娱乐业	4,362,812.00	0.91
S	综合	-	-
	合计	449,467,390.15	94.03

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	601688	华泰证券	895,200	11,091,528.00	2.32
2	000426	兴业银锡	776,200	10,540,796.00	2.21
3	001332	锡装股份	370,270	8,819,831.40	1.85
4	600519	贵州茅台	6,000	8,804,340.00	1.84
5	601318	中国平安	207,800	8,594,608.00	1.80
6	600711	盛屯矿业	1,994,300	7,319,081.00	1.53

7	002212	天融信	1,396,900	6,802,903.00	1.42
8	301309	万得凯	235,300	6,014,268.00	1.26
9	000725	京东方 A	1,461,800	5,978,762.00	1.25
10	605555	德昌股份	317,400	5,906,814.00	1.24
11	603688	石英股份	182,050	5,390,500.50	1.13
12	000709	河钢股份	2,674,500	5,188,530.00	1.09
13	300573	兴齐眼药	31,400	5,149,600.00	1.08
14	002608	江苏国信	660,300	5,117,325.00	1.07
15	601989	中国重工	1,017,700	5,017,261.00	1.05
16	301015	百洋医药	210,200	4,946,006.00	1.03
17	601128	常熟银行	652,550	4,939,803.50	1.03
18	002371	北方华创	14,000	4,478,460.00	0.94
19	000516	国际医学	924,700	4,327,596.00	0.91
20	600009	上海机场	124,700	4,021,575.00	0.84
21	600511	国药股份	126,100	3,882,619.00	0.81
22	605018	长华集团	420,300	3,807,918.00	0.80
23	603393	新天然气	97,700	3,394,098.00	0.71
24	300308	中际旭创	24,580	3,389,090.40	0.71
25	300122	智飞生物	119,000	3,335,570.00	0.70
26	603505	金石资源	117,100	3,270,603.00	0.68
27	002947	恒铭达	90,900	3,199,680.00	0.67
28	603766	隆鑫通用	460,900	3,124,902.00	0.65
29	000776	广发证券	256,334	3,119,584.78	0.65
30	300857	协创数据	54,084	3,082,788.00	0.64
31	003019	宸展光电	119,935	3,037,953.55	0.64
32	600704	物产中大	697,900	3,028,886.00	0.63
33	603583	捷昌驱动	143,600	2,926,568.00	0.61
34	000589	贵州轮胎	568,900	2,884,323.00	0.60
35	601825	沪农商行	416,900	2,801,568.00	0.59
36	300492	华图山鼎	29,600	2,788,320.00	0.58
37	002837	英维克	128,930	2,757,812.70	0.58
38	300124	汇川技术	50,100	2,570,130.00	0.54
39	601838	成都银行	160,400	2,436,476.00	0.51
40	301219	腾远钴业	63,300	2,421,858.00	0.51
41	300059	东方财富	229,100	2,419,296.00	0.51
42	002645	华宏科技	370,600	2,357,016.00	0.49
43	300779	惠城环保	46,420	2,246,728.00	0.47
44	300274	阳光电源	36,160	2,243,004.80	0.47
45	600919	江苏银行	300,500	2,232,715.00	0.47
46	300251	光线传媒	247,600	2,082,316.00	0.44
47	000521	长虹美菱	270,900	2,053,422.00	0.43
48	301239	普瑞眼科	53,700	1,897,221.00	0.40
49	002948	青岛银行	546,900	1,843,053.00	0.39

50	300953	震裕科技	33,576	1,819,819.20	0.38
51	002073	软控股份	243,100	1,796,509.00	0.38
52	600066	宇通客车	69,300	1,787,940.00	0.37
53	603039	泛微网络	56,200	1,784,912.00	0.37
54	301391	卡莱特	40,740	1,783,597.20	0.37
55	601916	浙商银行	635,700	1,754,532.00	0.37
56	300502	新易盛	16,500	1,741,575.00	0.36
57	002128	电投能源	81,100	1,711,210.00	0.36
58	300182	捷成股份	459,900	1,706,229.00	0.36
59	300910	瑞丰新材	38,700	1,691,964.00	0.35
60	300287	飞利信	997,700	1,666,159.00	0.35
61	600225	卓朗科技	953,000	1,658,220.00	0.35
62	002229	鸿博股份	150,200	1,658,208.00	0.35
63	300693	盛弘股份	78,500	1,643,790.00	0.34
64	002053	云南能投	135,600	1,639,404.00	0.34
65	600038	中直股份	38,500	1,582,735.00	0.33
66	002544	普天科技	83,500	1,560,615.00	0.33
67	601702	华峰铝业	85,400	1,559,404.00	0.33
68	301222	浙江恒威	62,500	1,547,500.00	0.32
69	300896	爱美客	8,940	1,538,574.00	0.32
70	688188	柏楚电子	8,300	1,531,765.00	0.32
71	300394	天孚通信	17,200	1,520,824.00	0.32
72	600497	驰宏锌锗	281,100	1,501,074.00	0.31
73	000423	东阿阿胶	23,700	1,483,620.00	0.31
74	600219	南山铝业	385,200	1,467,612.00	0.31
75	600362	江西铜业	61,700	1,461,056.00	0.31
76	601818	光大银行	457,458	1,450,141.86	0.30
77	600999	招商证券	102,700	1,428,557.00	0.30
78	301030	仕净科技	58,000	1,427,960.00	0.30
79	002020	京新药业	131,500	1,376,805.00	0.29
80	002884	凌霄泵业	71,600	1,374,720.00	0.29
81	605365	立达信	86,600	1,374,342.00	0.29
82	603985	恒润股份	110,900	1,319,710.00	0.28
83	600480	凌云股份	130,600	1,283,798.00	0.27
84	601169	北京银行	206,000	1,203,040.00	0.25
85	603568	伟明环保	57,400	1,181,292.00	0.25
86	301017	漱玉平民	119,700	1,177,848.00	0.25
87	600871	石化油服	635,300	1,105,422.00	0.23
88	688169	石头科技	2,700	1,060,020.00	0.22
89	600170	上海建工	487,300	1,047,695.00	0.22
90	002318	久立特材	44,600	1,040,518.00	0.22
91	603408	建霖家居	78,400	1,034,096.00	0.22
92	603786	科博达	16,100	1,032,815.00	0.22

93	002978	安宁股份	37,000	1,030,820.00	0.22
94	300842	帝科股份	26,460	1,026,648.00	0.21
95	000786	北新建材	34,500	1,023,270.00	0.21
96	002595	豪迈科技	26,800	1,022,956.00	0.21
97	603699	纽威股份	59,200	1,013,504.00	0.21
98	001236	弘业期货	142,400	1,012,464.00	0.21
99	600886	国投电力	55,500	1,012,320.00	0.21
100	688510	航亚科技	54,800	1,008,868.00	0.21
101	603501	韦尔股份	10,100	1,003,637.00	0.21
102	600566	济川药业	31,500	998,865.00	0.21
103	002832	比音勒芬	40,500	978,885.00	0.20
104	600760	中航沈飞	24,200	970,420.00	0.20
105	688516	奥特维	22,800	953,268.00	0.20
106	300218	安利股份	61,800	931,944.00	0.19
107	601058	赛轮轮胎	65,800	921,200.00	0.19
108	002961	瑞达期货	83,300	912,135.00	0.19
109	002563	森马服饰	155,500	903,455.00	0.19
110	002028	思源电气	13,400	896,460.00	0.19
111	600926	杭州银行	68,500	893,925.00	0.19
112	603871	嘉友国际	50,060	885,561.40	0.19
113	000598	兴蓉环境	115,000	864,800.00	0.18
114	002532	天山铝业	106,500	863,715.00	0.18
115	605333	沪光股份	30,800	857,780.00	0.18
116	603489	八方股份	31,600	852,568.00	0.18
117	002035	华帝股份	135,900	846,657.00	0.18
118	300453	三鑫医疗	132,200	844,758.00	0.18
119	002125	湘潭电化	85,000	827,050.00	0.17
120	002007	华兰生物	52,300	825,817.00	0.17
121	600177	雅戈尔	114,400	814,528.00	0.17
122	601717	郑煤机	54,700	809,560.00	0.17
123	603979	金诚信	15,900	803,427.00	0.17
124	300001	特锐德	39,900	802,788.00	0.17
125	601668	中国建筑	149,900	795,969.00	0.17
126	603983	丸美股份	28,800	792,864.00	0.17
127	600582	天地科技	113,466	781,780.74	0.16
128	000403	派林生物	29,100	775,806.00	0.16
129	601555	东吴证券	130,500	769,950.00	0.16
130	300769	德方纳米	26,900	758,580.00	0.16
131	300389	艾比森	61,300	752,764.00	0.16
132	300866	安克创新	10,390	739,871.90	0.15
133	603681	永冠新材	57,600	734,400.00	0.15
134	601899	紫金矿业	41,700	732,669.00	0.15
135	603516	淳中科技	23,200	732,424.00	0.15

136	603277	银都股份	24,200	726,968.00	0.15
137	600348	华阳股份	72,908	726,163.68	0.15
138	300253	卫宁健康	122,500	722,750.00	0.15
139	688556	高测股份	60,600	720,534.00	0.15
140	601000	唐山港	152,112	714,926.40	0.15
141	600282	南钢股份	141,700	705,666.00	0.15
142	002019	亿帆医药	56,800	702,048.00	0.15
143	605305	中际联合	27,200	701,488.00	0.15
144	002236	大华股份	45,000	695,700.00	0.15
145	603369	今世缘	14,700	679,140.00	0.14
146	002138	顺络电子	24,700	678,262.00	0.14
147	603379	三美股份	17,200	673,208.00	0.14
148	603535	嘉诚国际	41,700	673,038.00	0.14
149	300724	捷佳伟创	12,400	669,724.00	0.14
150	000913	钱江摩托	42,100	663,496.00	0.14
151	600901	江苏金租	130,900	661,045.00	0.14
152	002372	伟星新材	42,800	659,976.00	0.14
153	603939	益丰药房	26,840	658,922.00	0.14
154	000513	丽珠集团	17,700	658,617.00	0.14
155	300679	电连技术	16,300	655,749.00	0.14
156	002267	陕天然气	86,700	655,452.00	0.14
157	603569	长久物流	94,600	648,956.00	0.14
158	600801	华新水泥	46,900	644,875.00	0.13
159	300969	恒帅股份	9,300	642,909.00	0.13
160	600618	氯碱化工	72,900	640,062.00	0.13
161	600941	中国移动	5,900	634,250.00	0.13
162	000999	华润三九	14,890	634,016.20	0.13
163	601969	海南矿业	99,800	632,732.00	0.13
164	002001	新和成	32,900	631,680.00	0.13
165	600498	烽火通信	39,700	631,230.00	0.13
166	000550	江铃汽车	28,900	627,419.00	0.13
167	603298	杭叉集团	31,860	625,730.40	0.13
168	600970	中材国际	51,800	624,708.00	0.13
169	000651	格力电器	15,800	619,676.00	0.13
170	000830	鲁西化工	51,800	600,362.00	0.13
171	000661	长春高新	6,500	596,505.00	0.12
172	000338	潍柴动力	36,600	594,384.00	0.12
173	603712	七一二	32,400	589,356.00	0.12
174	603883	老百姓	32,089	589,154.04	0.12
175	002088	鲁阳节能	48,600	587,574.00	0.12
176	603629	利通电子	31,800	587,028.00	0.12
177	300840	酷特智能	63,200	584,600.00	0.12
178	300529	健帆生物	21,400	582,294.00	0.12

179	002803	吉宏股份	52,300	582,099.00	0.12
180	002106	莱宝高科	53,400	582,060.00	0.12
181	002555	三七互娱	44,200	576,810.00	0.12
182	603882	金域医学	21,200	576,428.00	0.12
183	002752	昇兴股份	113,500	574,310.00	0.12
184	000166	申万宏源	132,200	569,782.00	0.12
185	000551	创元科技	64,600	563,958.00	0.12
186	000887	中鼎股份	45,700	559,368.00	0.12
187	300451	创业慧康	161,500	558,790.00	0.12
188	300972	万辰集团	26,400	557,832.00	0.12
189	002152	广电运通	53,100	555,426.00	0.12
190	002988	豪美新材	35,900	551,065.00	0.12
191	601857	中国石油	53,300	550,056.00	0.12
192	600372	中航机载	45,563	545,389.11	0.11
193	600458	时代新材	53,800	543,380.00	0.11
194	600183	生益科技	25,800	543,348.00	0.11
195	605499	东鹏饮料	2,500	539,375.00	0.11
196	600521	华海药业	31,600	538,780.00	0.11
197	600674	川投能源	28,700	538,125.00	0.11
198	601288	农业银行	123,300	537,588.00	0.11
199	600795	国电电力	89,600	536,704.00	0.11
200	601988	中国银行	116,000	535,920.00	0.11
201	600025	华能水电	49,600	534,688.00	0.11
202	600761	安徽合力	24,700	534,508.00	0.11
203	603993	洛阳钼业	62,800	533,800.00	0.11
204	688208	道通科技	22,102	533,542.28	0.11
205	600900	长江电力	18,400	532,128.00	0.11
206	601939	建设银行	71,900	532,060.00	0.11
207	688717	艾罗能源	11,303	531,467.06	0.11
208	002315	焦点科技	19,700	531,112.00	0.11
209	600019	宝钢股份	79,800	530,670.00	0.11
210	603978	深圳新星	59,200	529,840.00	0.11
211	300850	新强联	35,200	528,704.00	0.11
212	002713	东易日盛	240,300	528,660.00	0.11
213	605098	行动教育	12,400	528,488.00	0.11
214	605186	健麾信息	23,500	527,810.00	0.11
215	000975	银泰黄金	32,300	526,167.00	0.11
216	600285	羚锐制药	21,700	525,357.00	0.11
217	601628	中国人寿	16,900	524,745.00	0.11
218	603556	海兴电力	11,200	524,496.00	0.11
219	002472	双环传动	23,800	524,076.00	0.11
220	300415	伊之密	25,100	521,578.00	0.11
221	688598	金博股份	18,400	520,720.00	0.11

222	601101	昊华能源	56,500	519,235.00	0.11
223	002142	宁波银行	23,500	518,410.00	0.11
224	002352	顺丰控股	14,500	517,505.00	0.11
225	601336	新华保险	17,200	516,516.00	0.11
226	300130	新国都	31,000	515,840.00	0.11
227	601919	中远海控	33,300	515,817.00	0.11
228	601601	中国太保	18,500	515,410.00	0.11
229	000923	河钢资源	29,900	514,878.00	0.11
230	000001	平安银行	50,700	514,605.00	0.11
231	603558	健盛集团	51,700	514,415.00	0.11
232	605016	百龙创园	25,210	513,527.70	0.11
233	002034	旺能环境	39,400	512,594.00	0.11
234	600660	福耀玻璃	10,700	512,530.00	0.11
235	603195	公牛集团	6,630	511,305.60	0.11
236	600690	海尔智家	17,800	505,164.00	0.11
237	600050	中国联通	106,500	500,550.00	0.10
238	600007	中国国贸	22,700	498,492.00	0.10
239	002773	康弘药业	23,000	497,950.00	0.10
240	002422	科伦药业	16,000	485,280.00	0.10
241	300428	立中集团	26,100	485,199.00	0.10
242	000933	神火股份	23,900	483,497.00	0.10
243	605136	丽人丽妆	86,600	477,166.00	0.10
244	002729	好利科技	51,100	474,208.00	0.10
245	002801	微光股份	25,000	474,000.00	0.10
246	600366	宁波韵升	90,100	470,322.00	0.10
247	600557	康缘药业	29,900	469,430.00	0.10
248	003006	百亚股份	19,800	469,260.00	0.10
249	603056	德邦股份	35,800	468,980.00	0.10
250	688036	传音控股	6,100	466,894.00	0.10
251	002039	黔源电力	26,400	464,640.00	0.10
252	300973	立高食品	16,500	463,485.00	0.10
253	603355	莱克电气	21,200	457,920.00	0.10
254	002003	伟星股份	36,400	456,820.00	0.10
255	002607	中公教育	297,900	455,787.00	0.10
256	600018	上港集团	78,700	454,886.00	0.10
257	300072	海新能科	252,300	454,140.00	0.10
258	688475	萤石网络	13,300	453,663.00	0.09
259	300662	科锐国际	28,000	451,640.00	0.09
260	300783	三只松鼠	20,500	448,335.00	0.09
261	603949	雪龙集团	39,600	445,896.00	0.09
262	603337	杰克股份	16,900	444,808.00	0.09
263	603515	欧普照明	25,600	443,904.00	0.09
264	688388	嘉元科技	45,400	442,650.00	0.09

265	601636	旗滨集团	68,200	439,890.00	0.09
266	000401	冀东水泥	106,600	432,796.00	0.09
267	688236	春立医疗	30,200	428,236.00	0.09
268	600028	中国石化	65,800	415,856.00	0.09
269	002291	遥望科技	96,600	415,380.00	0.09
270	301071	力量钻石	14,900	412,879.00	0.09
271	688551	科威尔	13,000	409,500.00	0.09
272	600664	哈药股份	154,200	407,088.00	0.09
273	603053	成都燃气	42,000	405,720.00	0.08
274	600548	深高速	38,100	405,003.00	0.08
275	002833	弘亚数控	22,100	403,104.00	0.08
276	002140	东华科技	52,000	403,000.00	0.08
277	603093	南华期货	46,400	401,824.00	0.08
278	603380	易德龙	20,000	401,600.00	0.08
279	603333	尚纬股份	129,100	401,501.00	0.08
280	603618	杭电股份	91,600	401,208.00	0.08
281	605296	神农集团	11,400	400,710.00	0.08
282	300673	佩蒂股份	30,400	398,848.00	0.08
283	601512	中新集团	52,300	398,526.00	0.08
284	000600	建投能源	62,900	396,270.00	0.08
285	002354	天娱数科	131,800	394,082.00	0.08
286	688231	隆达股份	27,515	392,363.90	0.08
287	603198	迎驾贡酒	6,800	391,000.00	0.08
288	002790	瑞尔特	43,200	390,096.00	0.08
289	600662	外服控股	97,000	388,970.00	0.08
290	603181	皇马科技	43,200	388,368.00	0.08
291	002984	森麒麟	16,100	387,849.00	0.08
292	605099	共创草坪	20,500	387,655.00	0.08
293	600820	隧道股份	59,200	386,576.00	0.08
294	601865	福莱特	19,200	385,920.00	0.08
295	688077	大地熊	24,300	384,669.00	0.08
296	688138	清溢光电	17,800	382,700.00	0.08
297	600818	中路股份	27,300	381,654.00	0.08
298	000921	海信家电	11,800	380,432.00	0.08
299	601231	环旭电子	23,700	380,385.00	0.08
300	300760	迈瑞医疗	1,300	378,183.00	0.08
301	300049	福瑞股份	7,500	377,550.00	0.08
302	601369	陕鼓动力	47,000	376,940.00	0.08
303	605183	确成股份	24,300	375,678.00	0.08
304	688018	乐鑫科技	3,800	374,984.00	0.08
305	600269	赣粤高速	72,400	374,308.00	0.08
306	000601	韶能股份	101,000	372,690.00	0.08
307	688315	诺禾致源	34,100	372,372.00	0.08

308	002823	凯中精密	30,500	372,100.00	0.08
309	605599	菜百股份	29,000	369,170.00	0.08
310	300758	七彩化学	34,200	367,650.00	0.08
311	600873	梅花生物	36,600	366,732.00	0.08
312	002777	久远银海	24,300	364,257.00	0.08
313	002855	捷荣技术	17,300	363,646.00	0.08
314	603666	亿嘉和	23,000	362,940.00	0.08
315	605155	西大门	39,600	362,340.00	0.08
316	300054	鼎龙股份	15,900	360,612.00	0.08
317	600016	民生银行	92,800	351,712.00	0.07
318	301291	明阳电气	11,700	351,585.00	0.07
319	603711	香飘飘	25,200	349,020.00	0.07
320	688100	威胜信息	8,954	341,595.10	0.07
321	301109	军信股份	22,800	340,860.00	0.07
322	601985	中国核电	31,900	340,054.00	0.07
323	603579	荣泰健康	21,820	337,337.20	0.07
324	002635	安洁科技	21,800	336,592.00	0.07
325	300628	亿联网络	9,100	334,607.00	0.07
326	600126	杭钢股份	81,300	334,143.00	0.07
327	001872	招商港口	17,300	333,025.00	0.07
328	688033	天宜上佳	55,400	332,400.00	0.07
329	001288	运机集团	11,900	329,392.00	0.07
330	000972	中基健康	147,000	327,810.00	0.07
331	688055	龙腾光电	103,051	326,671.67	0.07
332	603729	龙韵股份	24,600	326,196.00	0.07
333	300328	宜安科技	75,900	324,852.00	0.07
334	600770	综艺股份	141,000	322,890.00	0.07
335	002273	水晶光电	18,900	320,922.00	0.07
336	002697	红旗连锁	69,300	320,859.00	0.07
337	600461	洪城环境	27,500	318,450.00	0.07
338	601728	中国电信	51,700	317,955.00	0.07
339	000596	古井贡酒	1,500	316,605.00	0.07
340	600233	圆通速递	20,000	313,000.00	0.07
341	002439	启明星辰	17,900	308,954.00	0.06
342	603338	浙江鼎力	5,100	308,142.00	0.06
343	600026	中远海能	19,700	307,517.00	0.06
344	688616	西力科技	27,102	307,336.68	0.06
345	002430	杭氧股份	13,600	302,600.00	0.06
346	688375	国博电子	4,253	300,431.92	0.06
347	601319	中国人保	58,000	298,700.00	0.06
348	300408	三环集团	10,200	297,738.00	0.06
349	000155	川能动力	27,500	296,175.00	0.06
350	002453	华软科技	68,000	291,720.00	0.06

351	002311	海大集团	6,200	291,710.00	0.06
352	603025	大豪科技	20,900	288,838.00	0.06
353	601577	长沙银行	35,300	288,754.00	0.06
354	002463	沪电股份	7,900	288,350.00	0.06
355	600299	安迪苏	29,500	286,150.00	0.06
356	002615	哈尔斯	45,800	283,960.00	0.06
357	688586	江航装备	30,301	281,799.30	0.06
358	600612	老凤祥	4,800	279,312.00	0.06
359	301078	孩子王	55,100	278,806.00	0.06
360	603110	东方材料	25,000	278,250.00	0.06
361	300908	仲景食品	9,800	272,244.00	0.06
362	000576	甘化科工	44,900	269,400.00	0.06
363	688127	蓝特光学	14,600	268,494.00	0.06
364	603897	长城科技	15,200	266,760.00	0.06
365	002996	顺博合金	45,310	265,063.50	0.06
366	300396	迪瑞医疗	13,000	264,030.00	0.06
367	600938	中国海油	8,000	264,000.00	0.06
368	002270	华明装备	11,800	262,432.00	0.05
369	605033	美邦股份	21,100	262,062.00	0.05
370	688116	天奈科技	11,300	260,804.00	0.05
371	688590	新致软件	20,001	258,012.90	0.05
372	605166	聚合顺	24,300	254,907.00	0.05
373	000100	TCL 科技	59,000	254,880.00	0.05
374	688767	博拓生物	10,101	253,232.07	0.05
375	300750	宁德时代	1,400	252,042.00	0.05
376	001286	陕西能源	21,800	251,354.00	0.05
377	002519	银河电子	51,100	250,901.00	0.05
378	000510	新金路	90,200	249,854.00	0.05
379	300080	易成新能	85,900	247,392.00	0.05
380	300226	上海钢联	14,600	247,324.00	0.05
381	600989	宝丰能源	14,100	244,353.00	0.05
382	601077	渝农商行	47,200	236,944.00	0.05
383	301004	嘉益股份	2,600	236,600.00	0.05
384	688177	百奥泰	11,200	236,544.00	0.05
385	300652	雷迪克	11,900	235,977.00	0.05
386	688323	瑞华泰	23,400	235,638.00	0.05
387	301589	诺瓦星云	1,244	233,884.44	0.05
388	688098	申联生物	55,201	230,188.17	0.05
389	688617	惠泰医疗	501	228,506.10	0.05
390	688111	金山办公	1,001	227,727.50	0.05
391	002549	凯美特气	44,300	226,373.00	0.05
392	002139	拓邦股份	21,000	223,020.00	0.05
393	002300	太阳电缆	42,175	222,684.00	0.05

394	300832	新产业	3,300	222,552.00	0.05
395	603727	博迈科	16,900	222,404.00	0.05
396	002111	威海广泰	20,700	215,694.00	0.05
397	000738	航发控制	10,700	214,749.00	0.04
398	000060	中金岭南	49,300	209,032.00	0.04
399	002380	科远智慧	11,400	208,620.00	0.04
400	601696	中银证券	22,800	207,024.00	0.04
401	601500	通用股份	38,500	205,590.00	0.04
402	000626	远大控股	49,500	205,425.00	0.04
403	001296	长江材料	14,400	205,200.00	0.04
404	300559	佳发教育	21,400	204,798.00	0.04
405	601886	江河集团	41,600	203,008.00	0.04
406	002550	千红制药	37,500	202,125.00	0.04
407	002919	名臣健康	17,200	199,692.00	0.04
408	600831	广电网络	74,400	199,392.00	0.04
409	300767	震安科技	23,500	199,280.00	0.04
410	002524	光正眼科	63,100	198,765.00	0.04
411	600794	保税科技	62,200	197,174.00	0.04
412	688509	正元地信	68,000	196,520.00	0.04
413	300978	东箭科技	21,200	195,676.00	0.04
414	600603	广汇物流	38,500	194,040.00	0.04
415	300476	胜宏科技	6,000	193,560.00	0.04
416	000333	美的集团	3,000	193,500.00	0.04
417	002068	黑猫股份	26,900	190,990.00	0.04
418	000951	中国重汽	13,300	190,456.00	0.04
419	600809	山西汾酒	900	189,792.00	0.04
420	002203	海亮股份	23,600	188,328.00	0.04
421	300369	绿盟科技	36,800	188,048.00	0.04
422	688278	特宝生物	3,500	187,425.00	0.04
423	603112	华翔股份	17,800	187,078.00	0.04
424	300856	科思股份	5,800	185,658.00	0.04
425	000619	海螺新材	45,600	184,224.00	0.04
426	300955	嘉亨家化	14,400	182,448.00	0.04
427	600642	申能股份	20,400	180,132.00	0.04
428	300677	英科医疗	6,660	178,554.60	0.04
429	000848	承德露露	22,600	177,636.00	0.04
430	002705	新宝股份	12,300	173,061.00	0.04
431	000892	欢瑞世纪	67,200	168,000.00	0.04
432	000963	华东医药	6,000	166,860.00	0.03
433	300627	华测导航	5,500	164,175.00	0.03
434	000020	深华发 A	16,300	161,370.00	0.03
435	688776	国光电气	2,900	160,660.00	0.03
436	000027	深圳能源	22,000	160,600.00	0.03

437	688571	杭华股份	30,103	159,244.87	0.03
438	688010	福光股份	10,200	158,814.00	0.03
439	002132	恒星科技	74,700	158,364.00	0.03
440	300813	泰林生物	9,100	154,245.00	0.03
441	601995	中金公司	5,200	153,972.00	0.03
442	300743	天地数码	11,200	151,648.00	0.03
443	603728	鸣志电器	3,700	148,851.00	0.03
444	002558	巨人网络	15,700	148,208.00	0.03
445	600663	陆家嘴	16,800	148,176.00	0.03
446	688468	科美诊断	23,402	148,134.66	0.03
447	603297	永新光学	2,400	145,176.00	0.03
448	603197	保隆科技	4,600	144,900.00	0.03
449	000728	国元证券	23,700	143,622.00	0.03
450	601019	山东出版	12,100	143,022.00	0.03
451	300286	安科瑞	6,600	142,824.00	0.03
452	688021	奥福环保	15,300	140,760.00	0.03
453	600810	神马股份	22,600	140,120.00	0.03
454	002252	上海莱士	17,700	138,414.00	0.03
455	688153	唯捷创芯	3,700	136,900.00	0.03
456	002192	融捷股份	4,500	135,090.00	0.03
457	603087	甘李药业	2,900	134,328.00	0.03
458	300820	英杰电气	3,400	133,756.00	0.03
459	688151	华强科技	10,701	133,227.45	0.03
460	300284	苏交科	16,400	132,512.00	0.03
461	600750	江中药业	5,700	131,727.00	0.03
462	002223	鱼跃医疗	3,500	131,600.00	0.03
463	002749	国光股份	8,700	130,848.00	0.03
464	301011	华立科技	8,400	129,444.00	0.03
465	002583	海能达	31,800	129,426.00	0.03
466	000065	北方国际	12,400	128,588.00	0.03
467	300034	钢研高纳	8,060	128,073.40	0.03
468	688023	安恒信息	3,200	128,032.00	0.03
469	688186	广大特材	13,100	127,463.00	0.03
470	000599	青岛双星	36,000	127,080.00	0.03
471	000657	中钨高新	13,900	127,046.00	0.03
472	000955	欣龙控股	43,200	126,576.00	0.03
473	002993	奥海科技	3,400	126,480.00	0.03
474	688210	统联精密	5,700	126,255.00	0.03
475	603995	甬金股份	7,200	126,144.00	0.03
476	688371	菲沃泰	12,500	125,500.00	0.03
477	600998	九州通	25,700	125,416.00	0.03
478	300639	凯普生物	27,200	125,120.00	0.03
479	000758	中色股份	24,600	124,968.00	0.03

480	600800	渤海化学	62,500	124,375.00	0.03
481	688237	超卓航科	6,200	124,310.00	0.03
482	601607	上海医药	6,500	124,215.00	0.03
483	000757	浩物股份	49,400	123,994.00	0.03
484	300113	顺网科技	12,100	123,904.00	0.03
485	002909	集泰股份	30,000	123,000.00	0.03
486	002928	华夏航空	19,400	122,996.00	0.03
487	600552	凯盛科技	13,000	122,590.00	0.03
488	601163	三角轮胎	8,000	121,760.00	0.03
489	600562	国睿科技	8,900	121,574.00	0.03
490	600887	伊利股份	4,700	121,448.00	0.03
491	002991	甘源食品	2,000	121,300.00	0.03
492	603917	合力科技	11,200	121,184.00	0.03
493	002249	大洋电机	25,600	121,088.00	0.03
494	600623	华谊集团	20,900	120,802.00	0.03
495	002966	苏州银行	16,000	120,000.00	0.03
496	603303	得邦照明	10,400	119,392.00	0.02
497	603676	卫信康	14,900	119,349.00	0.02
498	603279	景津装备	5,500	119,295.00	0.02
499	002265	建设工业	13,800	119,094.00	0.02
500	002276	万马股份	16,600	119,022.00	0.02
501	600610	中毅达	29,900	119,002.00	0.02
502	605566	福莱蒾特	7,800	118,794.00	0.02
503	601038	一拖股份	7,500	118,575.00	0.02
504	688435	英方软件	4,700	117,312.00	0.02
505	300379	东方通	14,500	117,160.00	0.02
506	300382	斯莱克	19,800	117,018.00	0.02
507	002123	梦网科技	16,600	116,698.00	0.02
508	002585	双星新材	23,500	116,560.00	0.02
509	603239	浙江仙通	8,400	115,164.00	0.02
510	600398	海澜之家	12,400	114,576.00	0.02
511	002706	良信股份	16,700	114,562.00	0.02
512	301486	致尚科技	2,700	114,237.00	0.02
513	002653	海思科	3,700	113,590.00	0.02
514	603008	喜临门	6,500	112,645.00	0.02
515	000949	新乡化纤	33,000	112,200.00	0.02
516	002449	国星光电	15,700	111,784.00	0.02
517	603192	汇得科技	8,300	111,469.00	0.02
518	301028	东亚机械	12,400	108,748.00	0.02
519	600650	锦江在线	15,100	106,908.00	0.02
520	600965	福成股份	29,300	106,652.00	0.02
521	000795	英洛华	19,000	105,260.00	0.02
522	601966	玲珑轮胎	5,700	104,709.00	0.02

523	001914	招商积余	10,400	104,208.00	0.02
524	603806	福斯特	7,000	102,900.00	0.02
525	002901	大博医疗	3,900	100,737.00	0.02
526	002343	慈文传媒	19,300	100,360.00	0.02
527	002691	冀凯股份	22,200	97,458.00	0.02
528	300626	华瑞股份	12,800	95,872.00	0.02
529	605198	安德利	3,600	95,040.00	0.02
530	600391	航发科技	6,200	94,550.00	0.02
531	002867	周大生	7,100	92,726.00	0.02
532	002048	宁波华翔	6,900	89,286.00	0.02
533	300940	南极光	7,000	89,180.00	0.02
534	300131	英唐智控	20,000	89,000.00	0.02
535	002441	众业达	11,500	87,170.00	0.02
536	002858	力盛体育	8,300	86,320.00	0.02
537	300071	福石控股	40,700	84,249.00	0.02
538	300818	耐普矿机	3,300	84,150.00	0.02
539	002545	东方铁塔	12,300	83,763.00	0.02
540	600741	华域汽车	5,100	83,538.00	0.02
541	300687	赛意信息	6,000	83,520.00	0.02
542	000997	新大陆	6,000	83,460.00	0.02
543	600184	光电股份	9,800	83,398.00	0.02
544	002026	山东威达	9,900	82,170.00	0.02
545	601018	宁波港	24,100	81,940.00	0.02
546	300515	三德科技	8,300	81,921.00	0.02
547	603713	密尔克卫	1,500	80,280.00	0.02
548	300873	海晨股份	5,300	77,274.00	0.02
549	601595	上海电影	3,800	75,164.00	0.02
550	605208	永茂泰	12,000	74,760.00	0.02
551	000636	风华高科	5,700	74,442.00	0.02
552	300323	华灿光电	16,100	70,035.00	0.01
553	600559	老白干酒	3,700	67,266.00	0.01
554	600988	赤峰黄金	4,100	66,994.00	0.01
555	002056	横店东磁	5,300	66,091.00	0.01
556	600787	中储股份	13,700	65,897.00	0.01
557	688091	上海谊众	2,800	63,252.00	0.01
558	300181	佐力药业	4,100	61,992.00	0.01
559	002920	德赛西威	700	60,963.00	0.01
560	600416	湘电股份	6,100	60,634.00	0.01
561	688683	莱尔科技	3,700	59,237.00	0.01
562	002591	恒大高新	15,800	57,828.00	0.01
563	000720	新能泰山	23,800	57,358.00	0.01
564	000708	中信特钢	4,200	56,994.00	0.01
565	002295	精艺股份	10,700	56,924.00	0.01

566	300867	圣元环保	5,300	56,233.00	0.01
567	000045	深纺织 A	7,000	56,140.00	0.01
568	002916	深南电路	500	52,885.00	0.01
569	600406	国电南瑞	2,100	52,416.00	0.01
570	300522	世名科技	4,700	51,935.00	0.01
571	603855	华荣股份	2,300	50,853.00	0.01
572	301073	君亭酒店	2,700	49,140.00	0.01
573	002782	可立克	4,400	48,752.00	0.01
574	600819	耀皮玻璃	11,500	48,530.00	0.01
575	300296	利亚德	10,600	47,700.00	0.01
576	000035	中国天楹	10,500	47,565.00	0.01
577	002521	齐峰新材	3,700	43,475.00	0.01
578	300188	国投智能	3,800	42,218.00	0.01
579	688619	罗普特	6,002	42,194.06	0.01
580	600908	无锡银行	7,900	42,028.00	0.01
581	601727	上海电气	11,000	40,700.00	0.01
582	000883	湖北能源	6,700	40,267.00	0.01
583	601881	中国银河	3,700	40,182.00	0.01
584	600252	中恒集团	18,300	39,711.00	0.01
585	002768	国恩股份	2,100	39,270.00	0.01
586	002500	山西证券	8,300	39,010.00	0.01
587	301360	荣旗科技	900	38,925.00	0.01
588	300005	探路者	7,700	38,577.00	0.01
589	601187	厦门银行	6,800	36,244.00	0.01
590	601998	中信银行	5,400	36,180.00	0.01
591	600423	柳化股份	15,400	35,574.00	0.01
592	603893	瑞芯微	600	35,502.00	0.01
593	603605	珀莱雅	300	33,297.00	0.01
594	600828	茂业商业	13,700	32,469.00	0.01
595	002189	中光学	2,300	32,062.00	0.01
596	603617	君禾股份	5,200	30,680.00	0.01
597	688692	达梦数据	175	30,612.75	0.01
598	002498	汉缆股份	9,200	30,268.00	0.01
599	002379	宏创控股	5,100	29,886.00	0.01
600	301327	华宝新能	500	28,650.00	0.01
601	603160	汇顶科技	400	27,500.00	0.01
602	601827	三峰环境	3,200	27,168.00	0.01
603	000678	襄阳轴承	7,200	27,072.00	0.01
604	002100	天康生物	3,900	27,027.00	0.01
605	000633	合金投资	6,400	25,216.00	0.01
606	603285	键邦股份	1,287	24,002.55	0.01
607	002933	新兴装备	1,000	22,910.00	0.00
608	600039	四川路桥	2,900	22,881.00	0.00

609	601963	重庆银行	2,900	22,475.00	0.00
610	603350	安乃达	1,051	21,608.56	0.00
611	000543	皖能电力	2,300	20,355.00	0.00
612	601033	永兴股份	1,258	20,077.68	0.00
613	600185	格力地产	4,200	17,850.00	0.00
614	601872	招商轮船	2,100	17,745.00	0.00
615	600643	爱建集团	4,700	17,719.00	0.00
616	301536	星宸科技	481	15,521.87	0.00
617	605007	五洲特纸	1,200	15,156.00	0.00
618	300187	永清环保	3,500	14,665.00	0.00
619	002824	和胜股份	1,100	14,036.00	0.00
620	688584	上海合晶	866	13,760.74	0.00
621	301538	骏鼎达	150	13,686.00	0.00
622	301565	中仑新材	711	13,494.78	0.00
623	601975	招商南油	3,700	13,283.00	0.00
624	603341	龙旗科技	298	11,172.02	0.00
625	603368	柳药集团	600	10,500.00	0.00
626	688691	灿芯股份	247	10,499.97	0.00
627	002032	苏泊尔	200	10,020.00	0.00
628	301566	达利凯普	576	9,774.72	0.00
629	000557	西部创业	2,500	9,400.00	0.00
630	301392	汇成真空	219	9,123.54	0.00
631	601375	中原证券	2,500	8,525.00	0.00
632	301591	肯特股份	219	8,098.62	0.00
633	002475	立讯精密	200	7,862.00	0.00
634	301587	中瑞股份	306	7,729.56	0.00
635	001389	广合科技	222	7,672.32	0.00
636	301539	宏鑫科技	361	7,155.02	0.00
637	601156	东航物流	300	6,105.00	0.00
638	301578	辰奕智能	154	6,093.78	0.00
639	688695	中创股份	186	5,868.30	0.00
640	688530	欧莱新材	344	5,538.40	0.00
641	301588	美新科技	257	5,461.25	0.00
642	301502	华阳智能	138	5,220.54	0.00
643	300841	康华生物	100	5,064.00	0.00
644	002444	巨星科技	200	4,940.00	0.00
645	002955	鸿合科技	200	4,676.00	0.00
646	603325	博隆技术	66	4,491.96	0.00
647	603381	永臻股份	178	4,473.14	0.00
648	002646	天佑德酒	400	4,092.00	0.00
649	601311	骆驼股份	500	4,010.00	0.00
650	600386	北巴传媒	1,400	3,906.00	0.00
651	001359	平安电工	184	3,790.40	0.00

652	603312	西典新能	130	3,296.80	0.00
653	603228	景旺电子	100	3,180.00	0.00
654	603082	北自科技	107	3,155.43	0.00
655	001323	慕思股份	100	2,877.00	0.00
656	001379	腾达科技	213	2,871.24	0.00
657	603375	盛景微	72	2,800.80	0.00
658	600161	天坛生物	108	2,635.20	0.00
659	600377	宁沪高速	200	2,520.00	0.00
660	600956	新天绿能	300	2,451.00	0.00
661	000768	中航西飞	100	2,403.00	0.00
662	300244	迪安诊断	200	2,400.00	0.00
663	301061	匠心家居	50	2,348.00	0.00
664	601298	青岛港	200	1,912.00	0.00
665	002648	卫星化学	100	1,798.00	0.00
666	301519	舜禹股份	99	1,639.44	0.00
667	600861	北京人力	100	1,632.00	0.00
668	601811	新华文轩	100	1,401.00	0.00
669	601225	陕西煤业	51	1,314.27	0.00
670	300768	迪普科技	100	1,185.00	0.00
671	002017	东信和平	115	957.95	0.00
672	002911	佛燃能源	98	895.72	0.00
673	000567	海德股份	154	863.94	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	601688	华泰证券	44,992,200.00	4.14
2	600919	江苏银行	37,907,603.00	3.48
3	000776	广发证券	31,381,458.00	2.88
4	000426	兴业银锡	30,170,078.00	2.77
5	002947	恒铭达	28,579,612.00	2.63
6	601989	中国重工	25,531,176.00	2.35
7	300122	智飞生物	23,048,603.00	2.12
8	603393	新天然气	23,039,434.14	2.12
9	002252	上海莱士	22,709,301.00	2.09
10	601318	中国平安	21,993,567.00	2.02
11	601818	光大银行	21,715,023.92	2.00
12	000166	申万宏源	21,516,660.00	1.98
13	002203	海亮股份	21,501,165.00	1.98
14	300251	光线传媒	21,232,402.00	1.95
15	002978	安宁股份	20,210,153.40	1.86

16	301015	百洋医药	20,090,698.00	1.85
17	601211	国泰君安	19,548,006.00	1.80
18	603977	国泰集团	19,322,947.00	1.78
19	600519	贵州茅台	18,402,271.00	1.69
20	601686	友发集团	18,303,393.30	1.68

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	600919	江苏银行	37,217,560.00	3.42
2	601688	华泰证券	36,566,567.00	3.36
3	000776	广发证券	26,955,042.00	2.48
4	002947	恒铭达	26,423,553.00	2.43
5	601211	国泰君安	25,111,645.42	2.31
6	002252	上海莱士	25,085,460.00	2.31
7	000426	兴业银锡	23,419,332.00	2.15
8	601989	中国重工	23,245,514.00	2.14
9	603993	洛阳钼业	21,925,657.00	2.02
10	000166	申万宏源	21,377,315.00	1.96
11	603393	新天然气	20,561,853.06	1.89
12	601818	光大银行	20,440,198.00	1.88
13	002978	安宁股份	20,273,647.00	1.86
14	002203	海亮股份	20,110,312.11	1.85
15	601318	中国平安	19,183,838.20	1.76
16	603977	国泰集团	19,179,639.00	1.76
17	300251	光线传媒	18,941,291.00	1.74
18	300122	智飞生物	18,841,354.00	1.73
19	603087	甘李药业	18,506,850.70	1.70
20	601686	友发集团	17,102,537.90	1.57

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	4,312,208,222.34
卖出股票收入（成交）总额	4,781,684,725.57

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

本基金在风险可控的前提下，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，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，盛屯矿业集团股份有限公司出现在本报告期被监管部门立案调查的情况。本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

7.12.2 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	597,384.27
2	应收清算款	10,648,560.90
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	430,693.98
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	11,676,639.15
---	----	---------------

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

份额 级 别	持有 人户 数(户)	户均持 有的基 金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
华夏智胜价值成长股票 A	45,478	5,408.59	154,810,052.75	62.94%	91,161,872.26	37.06%
华夏智胜价值成长股票 C	29,038	3,670.82	43,721,337.53	41.02%	62,872,037.44	58.98%
合计	74,516	4,731.40	198,531,390.28	56.31%	154,033,909.70	43.69%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	华夏智胜价值成长股票 A	657,697.77	0.27%
	华夏智胜价值成长股票 C	57,029.86	0.05%
	合计	714,727.63	0.20%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	华夏智胜价值成长股票 A	0~10
	华夏智胜价值成长股票 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	华夏智胜价值成长股票 A	0
	华夏智胜价值成长股票 C	0
	合计	0

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

截至 2021 年 3 月 6 日，华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金的基金合同生效届满三年。

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华夏智胜价值成长股票 A	华夏智胜价值成长股票 C
基金合同生效日（2018 年 3 月 6 日）基金份额总额	10,903,772.92	-
本报告期期初基金份额总额	278,848,250.97	449,221,113.74
本报告期基金总申购份额	64,333,839.89	125,274,034.62
减：本报告期基金总赎回份额	97,210,165.85	467,901,773.39
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	245,971,925.01	106,593,374.97

§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，基金托管人无重大人事变动。

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。

本报告期内，无涉及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没有受到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	
中信证券	11	9,092,164,523.78	100.00%	871,927.83	100.00%	-

注：①为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择券商的标准，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，本基金还选择了财通证券、长江证券、第一创业证券、东北证券、东方证券、东吴证券、方正证券、光大证券、广发证券、国金证券、国联证券、国泰君安证券、国信证券、海通证券、华泰证券、华西证券、江海证券、金元证券、联储证券、平安证券、上海证券、申万宏源证券、西部证券、兴业证券、招商证券、中金公司、中泰证券、中信建投证券、中银国际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，财通证券、方正证券、广发证券、招商证券的部分交易单元、国金证券、国信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
中信证券	653,533.88	100.00%	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金调整申购、定期定额申购及转换转入业务上限的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024-02-08
2	华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金调整申购、定期定额申购及转换转入业务上限的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024-03-01

§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	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比

		间					
机构	1	2024-05-16 至 2024-06-30	76,962,792.11	-	-	76,962,792.11	21.83%
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转型的文件；
- 2、《华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《华夏智胜价值成长股票型发起式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