

**华夏创新未来混合型
证券投资基金（LOF）
2023 年中期报告
2023 年 6 月 30 日**

基金管理人：华夏基金管理有限公司

基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二三年八月三十日

§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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 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 2023 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	13
§6 中期报告财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	18
§7 投资组合报告	48
7.1 期末基金资产组合情况	48
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	48
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	49
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	52
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	53
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	54
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	54
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	54
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	54
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	54
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	54
7.12 投资组合报告附注	55
§8 基金份额持有人信息	55
§9 开放式基金份额变动	56
§10 重大事件揭示	56
§11 影响投资者决策的其他重要信息	59
§12 备查文件目录	59

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华夏创新未来混合型证券投资基金（LOF）
基金简称	华夏创新未来混合（LOF）
场内简称	华夏创新（扩位证券简称：华夏创新未来 LOF）
基金主代码	501207
交易代码	501207
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020 年 10 月 13 日
基金管理人	华夏基金管理有限公司
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	5,462,457,231.63 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2021 年 1 月 21 日

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的前提下，力求实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	<p>主要投资策略包括资产配置策略、股票投资策略、战略配售股票投资策略、固定收益品种投资策略、股指期货投资策略、股票期权投资策略、国债期货投资策略、融资及转融通证券出借投资策略等。在股票投资策略上，本基金所指的创新未来主题涵盖了把创新发展作为企业核心发展计划，通过产品创新、技术创新、模式创新、制度创新等方式，坚持面向新经济主战场，面向国家重大需求，符合国家战略、突破关键核心技术、市场认可度高的优质上市企业。本基金将重点关注新一代信息技术、高端装备、新材料、新能源、节能环保、生物医药以及新兴服务等领域的投资机会。</p> <p>封闭运作期届满转为开放式运作后，为了保证组合具有较高的流动性，方便投资人安排投资，本基金将在遵守有关投资限制与投资比例的前提下，主要投资于具有较高流动性的投资品种，通过合理配置组合期限结构等方式，积极防范流动性风险，在满足组合流动性需求的同时，尽量减小基金净值的波动。</p>
业绩比较基准	中证 800 指数收益率*70%+经汇率调整的恒生指数收益率*10%+上证国债指数收益率*20%。
风险收益特征	本基金为混合型基金，理论上其长期平均风险和预期收益率低于股票基金，高于债券基金、货币市场基金。本基金资产投资于科创板，会面临科创板机制下因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括但不限于流动性风险、退市风险、投资集中风险、投资战略配售股票风险等。本基金将投资港股通标的的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华夏基金管理有限公司	上海浦东发展银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李彬	朱萍
	联系电话	400-818-6666	021-31888888
	电子邮箱	service@ChinaAMC.com	zhup02@spdb.com.cn
客户服务电话		400-818-6666	95528
传真		010-63136700	021-63602540
注册地址		北京市顺义区安庆大街甲3号院	上海市中山东一路12号
办公地址		北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座8层	上海市博成路1388号浦银中心A栋
邮政编码		100033	200126
法定代表人		杨明辉	郑杨

2.5 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
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

2.6 其他相关资料

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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	-316,924,615.72
本期利润	-587,613,215.73
加权平均基金份额本期利润	-0.1048
本期加权平均净值利润率	-13.48%
本期基金份额净值增长率	-13.09%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023年6月30日)
期末可供分配利润	-1,595,944,125.71
期末可供分配基金份额利润	-0.2922
期末基金资产净值	3,866,513,105.92
期末基金份额净值	0.7078
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-29.22%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	1.75%	1.15%	1.12%	0.71%	0.63%	0.44%
过去三个月	-7.93%	1.18%	-3.58%	0.65%	-4.35%	0.53%
过去六个月	-13.09%	1.14%	0.43%	0.66%	-13.52%	0.48%
过去一年	-27.32%	1.31%	-8.64%	0.78%	-18.68%	0.53%
自基金合同生效起至今	-29.22%	1.57%	-11.78%	0.88%	-17.44%	0.69%

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

华夏创新未来混合型证券投资基金（LOF）

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

(2020 年 10 月 13 日至 2023 年 6 月 30 日)



§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

华夏基金管理有限公司成立于 1998 年 4 月 9 日，是经中国证监会批准成立的首批全国性基金管理公司之一。公司总部设在北京，在北京、上海、深圳、成都、南京、杭州、广州、青岛、武汉、沈阳设有分公司，在香港、深圳、上海设有子公司。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 2023 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：在养老目标风险 FOF(权益资产 0-30%)(A 类)中，华夏保守养老一年持有混合（FOF）(A 类)排名第 1/59；在对冲策略绝对收益目标基金(A 类)中，华夏安泰对冲策略 3 个月定开混合排名第 1/22；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 1/11；在低碳环保行业股票型基金(A 类)中，华夏节能环保股票(A 类)排名第 2/10；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 2/66、华夏新兴消费混合(A 类)排名第 9/66；在 QDII 混合基金(A 类)中，华夏全球科技先锋混合（QDII）排名第 3/43；在偏债型基金(A 类)中，华夏磐泰混合（LOF）(A 类)排名前 2%(13/619)、华夏睿磐泰盛混合排名前 3%(19/619)、华夏永利一年持有混合(A 类)排名前 10%(61/619)；在灵活配置型基金(基准股票比例 30%-60%)(A 类)中，华夏稳增混合排名前 3%(14/440)、华夏新锦绣混合(A 类)排名前 4%(18/440)；在标准股票型基金(A 类)中，华夏智

胜先锋股票（LOF）（A 类）排名前 4%(13/317)、华夏智胜价值成长股票(A 类)排名前 6%(20/317)；在偏股型基金(股票上限 95%)(A 类)中，华夏磐利一年定开混合(A 类)排名前 5%(11/214)、华夏磐锐一年定开混合(A 类)排名前 10%(21/214)；在偏股型基金(股票上下限 60%-95%)(A 类)中，华夏核心制造混合(A 类)排名前 9%(126/1403)、华夏价值精选混合排名前 9%(133/1403)。

固收与固收+产品：在 QDII 债券型基金(A 类)中，华夏大中华信用债券（QDII）（A 类）排名第 1/24、华夏收益债券（QDII）（A 类）排名第 3/24；在短期纯债债券型基金(A 类)中，华夏 30 天滚动短债债券发起式(A 类)排名第 8/108；在长期纯债债券型基金(A 类)中，华夏鼎隆债券(A 类)排名前 6%(71/1228)、华夏鼎航债券(A 类)排名前 6%(76/1228)、华夏鼎英债券(A 类)排名前 7%(87/1228)；在普通债券型基金(可投转债)(A 类)中，华夏鼎禄三个月定开债券(A 类)排名前 9%(32/376)；在普通债券型基金(二级)(A 类)中，华夏恒融债券排名前 8%(30/368)。

指数与量化产品：在增强规模指数股票型基金(A 类)中，华夏中证 500 指数增强(A 类)排名第 1/132、华夏中证 500 指数智选增强(A 类)排名第 2/132；在主题指数股票 ETF 联接基金(A 类)中，华夏中证动漫游戏 ETF 发起式联接(A 类)排名第 1/110；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 2/16；在 QDII 跨境股票 ETF 基金中，华夏纳斯达克 100ETF（QDII）排名第 2/33、华夏野村日经 225ETF 排名第 7/33；在 QDII 跨境股票 ETF 联接基金(A 类)中，华夏恒生 ETF 联接(A 类)排名第 3/10；在主题指数股票 ETF 基金中，华夏中证动漫游戏 ETF 排名第 1/313、华夏中证云计算与大数据主题 ETF 排名第 6/313、华夏中证大数据产业 ETF 排名前 5%(15/313)、华夏中证文化传媒 ETF 排名前 6%(18/313)、华夏中证金融科技主题 ETF 排名前 10%(30/313)；在规模指数股票 ETF 基金中，华夏沪港通恒生 ETF 排名第 4/136；在规模指数股票 ETF 联接基金(A 类)中，华夏沪港通恒生 ETF 联接(A 类)排名第 4/102；在行业指数股票 ETF 联接基金(A 类)中，华夏中证银行 ETF 联接(A 类)排名第 6/30。

在《中国证券报》第十九届中国基金业金牛奖评选中，华夏基金荣获“被动投资金牛基金公司”，成为业内连续 7 年获此殊荣的基金公司。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中，华夏基金凭借卓越的投资实力以及优秀的中长期业绩回报，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》主办的第十九届“金基金”奖评选活动上，华夏基金将三大基金奖项收入囊中：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，华夏能源革新股票荣获“金基金 投资回报基金奖”，华夏沪深 300ETF 荣获“金基金 指数基金三年期奖”。

在客户服务方面，2023 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）华夏基金直销渠道优化页面显示，升级搜索及查询功能，给客户更方便直观的

使用体验；（2）华夏基金管家客户端优化“忘记密码”功能及定投模块，从客户投资需求出发，进一步提升操作体验；（3）与华润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“帮你问了 ChatGPT”、“华夏基金户口本”、“指数攻防值来啦！”、“亲子财商 36 计”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		
周克平	本基金的 基金经 理、投委 会成员	2020-10-13	-	9 年	硕士。2014 年 7 月加入华夏基金管理有限公司。历任机构权益投资部研究员、投资经理助理。

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《证券业从业人员资格管理办法》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 90 次，均为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。

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

去年年底，我们认为随着疫情的放开，中国经济将重回一轮向上的周期，而我们在去年 4 月和 10 月的两个底部逐步将组合配置到了我们认为的这一轮 3-5 年经济发展的主要增量方向上，主要就是新能源，半导体，航空航天，生物医药和云计算软件这 5 个行业，同时我们认为这几个行业将梯次展开他们的行情。

而我们的组合表现，也大体分为两个阶段，从去年疫情放开之后到今年春节，我们组合大部分股票都实现了 45 度甚至 60 度斜率上涨，包括我们重点持有的港股软件医药、模拟芯片、医疗器械、刀具、人力资源服务等行业，新能源汽车产业链也在进入今年之后实现了较好的反弹，我们的组合在春节前表现出来了较好的弹性，我们之前预期的新半军医云梯次展开的判断在当时超预期的得到了市场的正面回馈，我们整个组合在 1 月表现非常好，一度也让我们踌躇满志。

但是春节之后，我们的组合开始表现不佳，4-5 月非常糟糕，6 月之后有所好转。整体上我们的组合沿着中国经济复苏与转型来做布局，并且我们一直认为在这一轮 3-5 年向上周期中跑得快的不一定跑得远，我们力求在这一轮周期中跑的足够远，因此在我们的组合表达上，做了一些深思熟虑和反思，具体表现在：

在新能源方面，我们通过持有新能源产业链的相关具备极强竞争力的龙头公司和新技术创新的公司，希望能够通过自身的阿尔法来抵抗阶段性产能周期的 BETA，在组合效果上，我们持有的新泉股份、宁德时代表现还不错，取得了年内正收益，但是华友钴业、恩捷股份表现不佳给我们造成了较大的拖累，这里我们一个比较大的教训就是，在一轮产能周期中，机构投资者往往通过深度研究下注在竞争出清之后的胜者赢家，希望以此来穿越周期的影响，但实际上上一轮产能周期中如果叠加经济周期和资本市场周期，即使我们选对了最后的赢家，中间的投资体验过程也并不好，在这个方面需要在下注仓位上做更多的灵活性选择。

在电子半导体方面，我们一直持有具备全球竞争力的硬件创新平台型公司，同时持有了在汽车、工业、新能源方面布局较多的模拟集成电路公司。从结果上看，去年四季度的反弹更多的是对于复苏预期定价，而在二季度的经济再次探底去库存过程中，我们这些看的更长的模拟芯片公司遭遇了阶段的最后景气的负向贝塔影响。在半导体方面，我们做了适度的减持，我们认为 Q3 前后应该是这一轮的最后底部，我们依然对我们选择的这些能够跑得远的公司充满信心。

在军工方面，我们选择的公司基本上在今年上半年呈现震荡走势，包括航发产业链、3D 打印和航空装备的公司，这些公司的业绩都表现出来了非常强的稳定性，着眼于未来 3 年，这些公司的技术储备、管线分布都有巨大的潜力和空间，我们在这些公司上做了一定的波段操作来增厚收益，随着这些公司在 23 年的业绩兑现，下半年切换到 24 年估值都进入了历史估值区间下限，而 24 年开始

可能他们的业绩增速都要加速，这是我们认为组合中最确定的部分压舱石，随着进入到下半年，对于这些持仓我们将减少波段操作，更多的以逢低增持为主，力求享受到 24-25 年的加速期。

在医药方面，我们对组合做了一定的调整。我们减持了细胞基因治疗的 CXO，基于我们对于产能周期相对不确定性的担忧，对连续血糖仪公司三诺生物做了一定的波段减持，同时我们大幅增持了内窥镜龙头澳华内镜和中医医疗服务公司固生堂。整体上医药组合今年上半年也是呈现出震荡走势，但是我们看到了中医医疗服务的商业模式升级和快速复苏，内窥镜龙头的产品升级以及在医院的口碑迅速建立，因此我们将仓位更多地集中到了确定性更高的标的上。经过上半年的震荡，我们看到这些公司的估值也得到了一定的消化，展望下半年和 24 年，我们认为随着业绩的释放和市场认知的提升，我们有可能在医药配置上迎来收获期。

在软件和服务上面，我们重点持有了金蝶国际和科锐国际，这两个公司在去年四季度到春节前实现了非常好的反弹，然而春节后随着大家对于宏观经济的担忧，这些公司都又跌去了之前的涨幅，6 月之后基本上企稳实现了一定的恢复，我们类似的持仓是两个刀具。这些公司都有着非常明确的结构增长，但是在上半年的经济去库存周期中，依然在业绩和估值上都受到了一定的周期性的挑战，但是现在可以看到的是它们的估值已经极度便宜，而企业竞争力在持续增加，缺的只是一个真正的周期性复苏的来临，我们确信经营的底部已经非常明确，环比改善的趋势非常明显。

整体上，我们的组合的经济顺周期属性比较明显，同时我们也看到，由于容量的受限，以及经济体量的增长，之前可以脱离经济周期的成长性行业，比如新能源、半导体、医药、军工等等，在业绩和估值方面或多或少的还是会受到一定的影响。在上半年的组合上，新能源电池材料公司、半导体芯片、CXO 受制于产能周期，负向贝塔掩盖了个股的阿尔法，同时我们去年 Q4 反弹较多的软件服务、刀具、模拟集成电路出现了预期重塑的过程，以上是给我们组合造成损失回撤的主要来源。另一方面，医疗器械、医疗服务、汽车零部件、航空航天产业链，基本上呈现出震荡消化估值的走势，因此形成了我们组合 1 月反弹，3-5 月调整，6 月开始企稳回升的净值曲线。

对于今年的两个特殊产业主题，中特估和 AI 生成式人工智能，我们也有一些思考。

首先对于中特估，我们认为更多的是对于致力改善之后的传统行业央企国企的价值重估。我们看到大量的传统行业在完成供给侧改革之后，进入了需求平稳收缩和供给平稳收缩的共振期，随着这些公司的资本开支和现金投入的减少，更多的充当全体国民的现金补充的可能性在提升，这在运营商、电力、煤炭等行业体现的非常明显，很多公司的分红率已经接近 100%，我们认为这些公司将有可能构成未来中国红利型自强的主力军。当然由于他们是红利型自强的，因此如果估值太贵，他们的股息收益率就会降低，因此我们认为这类资产更多的是获取稳定的较低收益，与我们希望获得超

越经济增长的成长收益并不匹配，因此虽然我们也看好这类资产的长期价值，但是没有纳入我们的投资视野。

对于 AI 生成式人工智能，我们在 3 月底察觉到了行业的变化，但是我们对于这轮 AI 的变革级别的理解，认为还没有跨过 0 到 1 阶段，更多是在一个产业主题演进的过程中，更多的类似于 2013 年特斯拉 ModelS 诞生的时刻，而我们知道真正的新能源汽车大爆发是在 2019 年 Model3 大量规模量产。在生成式人工智能这个领域，我们认为今年错过的机会是对于算力端也就是光模块和服务器的投资，从投资范式上说，与我们 19 年投资 ETC 产业链，20-21 年的锂电池产业链并无本质区别，去年户储微逆行情的逻辑演绎也基本一致，都是来自于阶段性的供需失衡带来的极致景气，更加本质一点就是周期股的一波流行情，从结果上看这些公司大部分都呈现出 A 字型走势。我们复盘了一下，在 3 月底参与 AI，只有光模块和服务器领域少数公司能够赚到钱，大部分很难赚到钱，而受限于我们组合的流动性管理，以及我们对于跑得快不一定跑得远的判断，我们基本上没有参与这一轮 AI 行情，从经验教训上看，我们认为是值得反思的，应该给组合流动性留有更多的余地，早参与是可以把握的。当然从现在的视角，我们认为基本上长期的加单也好，美好的故事也好，基本上已经被透支完，算力板块短期内不会再进入我们的投资视野。在 AI 的另一端是应用，我们看到 Chatgpt 有一定的突破，但是体验之后我们并没有认为这个是一个惊艳的突破，而我们看到国内的以计算机和传媒为代表的大模型公司，既没有可以说服大家的技术实力，又没有可以落地的场景和模式，因此我们认为这个完全是一个产业主题性机会，我们也看到这类公司的高点基本上就是 3 月底，拒绝这个诱惑对我们而言并不是很难，当然相应的也避免了追高的损失。从更远一点的角度，我们是看人工智能的长期发展的，但是我们认为以现有的算力技术框架和应用场景，AI 还远没有达到 iPhone 4 时刻或者 Model3 时刻，我们认为 AI 会是下一轮康波繁荣期的核心驱动力，但是这个故事对我们 3 年左右的思考周期而言有点过于遥远，但我们会时刻关注，也许在机器人、自动驾驶等方面，人工智能可以率先实现大规模的商业化，那个时候可能是我们大规模介入 AI 的好时机。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2023 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 0.7078 元，本报告期份额净值增长率为-13.09%，同期业绩比较基准增长率为 0.43%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

整体上而言，我们对市场依然相对乐观，心平气和而非躺平，可能能够更多地描绘出我们目前的心态。从去年年底的大家认为经济要 60 度复苏，所有人都想大干一场，到二季度之后我们看到经济复苏不及预期，大家又悲观至极，把很多周期性问题放大成长期结构性问题，我们认为更多的是预期与基本面的再平衡的过程。从我们的角度，我们认为高质量发展并非空话，对于长期转型而言，

可能是最大的长期利好，市场预期从 60 度复苏调整到 10-15 度复苏之后，我们认为可能反而行稳致远。

让我们乐观的因素我主要归结于以下几个方面：

首先是我们大的转型，我们认为已经走过来接近一半。事实上从 18 年以来，我们通过严格地方财政纪律、地方债务摸排，以及地产的严格调控，让我们的地方债务和地产泡沫风险没有顶部放量，而是采取了一个逐步锁量缩量排雷的方法。我们看到今天银行系统给地方政府提供了 25 甚至 30 年期限的超长期贷款，同时利率可能是突破了我们常规范式的形式，我们有理由相信我们已经进入去土地财政，去地产化和债务化解的第二阶段，中国实质性的量化宽松可能已经悄悄开启，中央银行的扩表我们认为将会逐步开始，我们的居民和企业的所谓资产负债表收缩，只是周期性的调整，会在回归合理水平之后再次进入扩张周期。

其次，是我们的经济发展阶段的自然约束，主要表现在随着土地财政的弱化，我们认为地方政府对于经济的干预能力会下降，更多的将回归公共服务职能。而我们知道，我们过去的很多制造业产能过剩就是来自于地方政府的过量财政补贴，而随着政府职能的转型，我们认为产能过剩的压力也会减少，而真正具备可持续竞争力的先进制造业龙头上市公司，有望从产能过剩的泥沼中走出来，行业实现集中度提升和出清。这一点，我们认为的高质量发展的应有之义，也是中国制造业从大变强的必经之路，事实上也是我们对上市公司龙头企业的重要信心之一。

最后，是我们的规模优势依然很巨大。我们看到我们在制造业上巨大的规模效应已经非常明显，在出口的结构变化上体现明确，比如我们新能源，比如汽车、工程机械、造船，甚至部分芯片都已经实现了全球的竞争力抬升，更早是在 IT 行业和家电行业，这个得益于我们巨大的规模优势和生态创新能力，未来我们认为会在新材料、芯片、航空航天、医疗器械等领域继续发扬光大。另一方面，我们的服务业，有一个结构调整的过程和最终再通胀的过程。首先我们认为最近三年的人口下滑并不可持续，更多是疫情的扰动，同时也倒逼了我们的经济转型，人口的反弹和企稳我们认为更多的会是转型的结果，会在未来几年体现。其次，我们看到虽然新生人口有压力，但是我们的每年新进入的年轻劳动力依然保持在高位，另一方面我们今年开始也进入退休高峰期，这种高质量人口红利新陈代谢我们还有 5-10 年的红利期，至于后续是否能持续，取决于我们整体转型进度，对此我持相对乐观的态度。

最后是我们实际购买力，我们以特斯拉为例，Model3 和 ModelY 在中国有全球最低售价，换个角度实际上是人民币具备制造业产品最强的购买力，这种实际购买力随着我们制造业的升级会更明显。而这之后随着我们全球产业链地位的抬升，服务业的通胀将不可避免，今天在酒店航空等行业已经明显，随着资产负债表的修复，三年疫情叠加去地产化带来的伤痕效应逐步减弱，我们系统性

低估的服务业人力成本，将重新进入扩张区间，但是中间可能要经历挤泡沫和伤痕修复的过程。

因此，我们认为今天我们的很多问题，更多的是来自于三年疫情，还有去地产化转型的周期性的因素，市场目前显然过于悲观线性外推，将此刻当作永恒，而根据我们的尝试与观察，此刻绝非永恒，我们结构性的优势依然明显，而伴随着疫情伤痕逐步减弱，同时实质性 QE 开启，债务风险化解，经济冷启动将逐步展开，高质量发展伴随的从 60 度的急促发展转向 15 度的可持续而温和的复苏，也许对我们而言是更好的选择，心平气和，积极选股，是我们未来一段时间的应对策略。

珍惜基金份额持有人的每一分投资和每一份信任，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遵规守信情况声明

本报告期内，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对华夏创新未来混合型证券投资基金（LOF）的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对华夏创新未来混合型证券投资基金（LOF）的投资运作进行了监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支以及利润分配等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告期内，由华夏基金管理有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§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：华夏创新未来混合型证券投资基金（LOF）

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	85,970,855.26	302,563,633.25
结算备付金		489,160.08	51,598,847.46
存出保证金		181,927.18	791,812.20
交易性金融资产	6.4.7.2	3,807,893,549.86	4,397,004,404.95
其中：股票投资		3,605,816,070.41	4,397,004,404.95
基金投资		-	-
债券投资		202,077,479.45	-
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		11,529,803.17	-
应收股利		-	-
应收申购款		1,012,224.43	705,147.62
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		3,907,077,519.98	4,752,663,845.48
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 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		27,013,766.43	5,669,209.72
应付赎回款		4,657,589.02	8,680,878.45
应付管理人报酬		4,752,576.91	6,062,314.42
应付托管费		633,676.92	808,308.59
应付销售服务费		1,267,353.84	1,616,617.15
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	2,239,450.94	3,796,217.09
负债合计		40,564,414.06	26,633,545.42
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	5,462,457,231.63	5,803,385,014.35
未分配利润	6.4.7.8	-1,595,944,125.71	-1,077,354,714.29
净资产合计		3,866,513,105.92	4,726,030,300.06
负债和净资产总计		3,907,077,519.98	4,752,663,845.48

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.7078 元，基金份额总额 5,462,457,231.63 份。

6.2 利润表

会计主体：华夏创新未来混合型证券投资基金（LOF）

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-541,917,858.84	-1,510,005,596.95
1.利息收入		323,896.66	1,200,044.08
其中：存款利息收入	6.4.7.9	323,896.66	1,128,042.53
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		-	72,001.55
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-271,842,501.70	-682,663,183.22
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-284,297,631.70	-695,140,505.01

基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	1,438,747.26	792,119.43
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	-	-
股利收益	6.4.7.14	11,016,382.74	11,685,202.36
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	-270,688,600.01	-829,300,903.58
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	289,346.21	758,445.77
减：二、营业总支出		45,695,356.89	70,366,311.06
1.管理人报酬		32,530,033.33	50,131,684.57
2.托管费		4,337,337.84	6,684,224.69
3.销售服务费		8,674,675.55	13,368,449.13
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	6.4.7.17	-	-
7.税金及附加		-	3.13
8.其他费用	6.4.7.18	153,310.17	181,949.54
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-587,613,215.73	-1,580,371,908.01
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-587,613,215.73	-1,580,371,908.01
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-587,613,215.73	-1,580,371,908.01

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：华夏创新未来混合型证券投资基金（LOF）

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益(若有)	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	5,803,385,014.35	-	-1,077,354,714.29	4,726,030,300.06
二、本期期初净资产（基金净值）	5,803,385,014.35	-	-1,077,354,714.29	4,726,030,300.06

三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-340,927,782.72	-	-518,589,411.42	-859,517,194.14
（一）、综合收益总额	-	-	-587,613,215.73	-587,613,215.73
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-340,927,782.72	-	69,023,804.31	-271,903,978.41
其中：1.基金申购款	321,431,447.88	-	-77,357,534.25	244,073,913.63
2.基金赎回款	-662,359,230.60	-	146,381,338.56	-515,977,892.04
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	5,462,457,231.63	-	-1,595,944,125.71	3,866,513,105.92
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	7,837,218,649.33	-	1,131,399,516.31	8,968,618,165.64
二、本期期初净资产（基金净值）	7,837,218,649.33	-	1,131,399,516.31	8,968,618,165.64
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-1,302,317,606.04	-	-1,302,052,232.47	-2,604,369,838.51
（一）、综合收益总额	-	-	-1,580,371,908.01	-1,580,371,908.01
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-1,302,317,606.04	-	278,319,675.54	-1,023,997,930.50
其中：1.基金申购款	191,546,387.07	-	-31,536,164.63	160,010,222.44
2.基金赎回款	-1,493,863,993.11	-	309,855,840.17	-1,184,008,152.94
（三）、本期向基	-	-	-	-

金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）				
四、本期期末净资产（基金净值）	6,534,901,043.29	-	-170,652,716.16	6,364,248,327.13

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：杨明辉，主管会计工作负责人：朱威，会计机构负责人：朱威

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华夏创新未来 18 个月封闭运作混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）已获中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2020]2280 号《关于准予华夏创新未来 18 个月封闭运作混合型证券投资基金注册的批复》，由华夏基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《华夏创新未来 18 个月封闭运作混合型证券投资基金基金合同》及其他有关法律法规负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限为不定期。本基金于 2020 年 9 月 25 日至 2020 年 10 月 8 日 19:30 募集 11,999,998,431.04 元（不含认购资金利息），业经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）安永华明（2020）验字第 60739337_A61 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华夏创新未来 18 个月封闭运作混合型证券投资基金基金合同》于 2020 年 10 月 13 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 12,003,147,875.79 份基金份额，其中认购资金利息折合 3,149,444.75 份基金份额。本基金的基金管理人为华夏基金管理有限公司，基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

根据基金管理人于 2021 年 1 月 9 日发布的《华夏基金管理有限公司关于华夏创新未来 18 个月封闭运作混合型证券投资基金修订基金合同、开通跨系统转托管及基金份额上市相关安排的公告》，本基金变更登记机构、增加基金份额上市安排等，并修订了基金合同。

根据基金管理人于 2022 年 4 月 7 日发布的《华夏基金管理有限公司关于华夏创新未来 18 个月封闭运作混合型证券投资基金封闭运作期届满及后续相关安排的公告》，本基金封闭运作期将于 2022 年 4 月 12 日届满，本基金自 2022 年 4 月 13 日起不再以封闭方式运作，基金名称变更为“华夏创新未来混合型证券投资基金（LOF）”。

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（包括科创板、创业板、中小板及其他经中国证监会注册或核准上市的股票）、港股通标的股票、债券（包括国内依法发行和上市交易的国

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、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、货币市场工具（含同业存单）、资产支持证券、股指期货、国债期货、股票期权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（但须符合中国证监会相关规定）。

其中，股票投资部分可采取战略配售方式进行投资，除战略配售方式以外，本基金也可以通过中国证监会允许的其他方式进行股票投资。采取战略配售方式投资的股票锁定期不得超过本基金的剩余封闭运作期。

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。在封闭运作期内，本基金可根据法律法规的规定参与转融通证券出借业务。

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、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(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》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。

（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 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	85,970,855.26
等于：本金	85,964,121.11
加：应计利息	6,734.15
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	85,970,855.26

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	4,459,692,187.63	-	3,605,816,070.41	-853,876,117.22
贵金属投资-金交	-	-	-	-

所黄金合约					
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	199,843,600.00	1,637,479.45	202,077,479.45	596,400.00
	合计	199,843,600.00	1,637,479.45	202,077,479.45	596,400.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		4,659,535,787.63	1,637,479.45	3,807,893,549.86	-853,279,717.22

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

无。

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 2023 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1,246.06
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	2,139,025.93
其中：交易所市场	2,139,025.93
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	99,178.95
合计	2,239,450.94

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
----	---------------------------------------

	基金份额（份）	账面金额
上年度末	5,803,385,014.35	5,803,385,014.35
本期申购	321,431,447.88	321,431,447.88
本期赎回（以“-”号填列）	-662,359,230.60	-662,359,230.60
本期末	5,462,457,231.63	5,462,457,231.63

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-741,725,313.11	-335,629,401.18	-1,077,354,714.29
本期利润	-316,924,615.72	-270,688,600.01	-587,613,215.73
本期基金份额交易产生的变动数	46,815,755.49	22,208,048.82	69,023,804.31
其中：基金申购款	-45,283,707.38	-32,073,826.87	-77,357,534.25
基金赎回款	92,099,462.87	54,281,875.69	146,381,338.56
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,011,834,173.34	-584,109,952.37	-1,595,944,125.71

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	291,963.46
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	27,495.53
其他	4,437.67
合计	323,896.66

6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	1,172,026,881.66
减：卖出股票成本总额	1,453,245,968.75
减：交易费用	3,078,544.61
买卖股票差价收入	-284,297,631.70

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2023年1月1日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	1,439,397.26
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-650.00
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	1,438,747.26

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	-
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	-
减：交易费用	650.00
买卖债券差价收入	-650.00

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.13 衍生工具收益

6.4.7.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.13.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资产生的股利收益	11,016,382.74
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	11,016,382.74

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
------	----

	2023年1月1日至2023年6月30日
1.交易性金融资产	-270,688,600.01
——股票投资	-271,285,000.01
——债券投资	596,400.00
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	-270,688,600.01

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
基金赎回费收入	289,346.21
合计	289,346.21

6.4.7.17 信用减值损失

无。

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
审计费用	39,671.58
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	7,300.40
银行间账户维护费	18,000.00
证券组合费	28,230.82
其他	600.00
合计	153,310.17

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

根据华夏基金管理有限公司于 2023 年 1 月 6 日发布的公告，华夏基金管理有限公司股权结构变更为中信证券（出资比例 62.2%）、MACKENZIE FINANCIAL CORPORATION（出资比例 27.8%）、天津海鹏科技咨询有限公司（出资比例 10%）。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华夏基金管理有限公司	基金管理人
上海浦东发展银行股份有限公司（“浦发银行”）	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
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 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022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	1,327,578,608.35	63.59%	539,734,193.85	6.99%

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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	989,640.16	64.02%	989,640.16	46.27%

关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022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	398,010.70	6.98%	398,010.70	6.07%

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 2023年1月1日至2023年6月 30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30 日
当期发生的基金应支付的管理费	32,530,033.33	50,131,684.57
其中：支付销售机构的客户维护费	15,535,680.89	23,750,515.62

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 1.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

②基金管理人报酬计算公式为：日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×1.50%/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 2023年1月1日至2023年6月 30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30 日
当期发生的基金应支付的托管费	4,337,337.84	6,684,224.69

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

	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
华夏基金管理有限公司	137,299.69
中信证券	9,590.26
中信证券（山东）	1,556.08
中信证券（华南）	108.57
合计	148,554.60
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
华夏基金管理有限公司	236,130.37
中信证券	24,998.60
中信证券（山东）	2,607.76
中信证券（华南）	165.89
合计	263,902.62

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

②基金销售服务费计算公式为：日基金销售服务费＝前一日基金资产净值×0.40%/当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022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

浦发银行活期存款	85,970,855.26	291,963.46	459,576,438.59	1,028,513.48
----------	---------------	------------	----------------	--------------

注：本基金的活期银行存款由基金托管人浦发银行保管，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 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	24,961	1,096,287.12
中信证券	688146	中船特气	新股发行	10,101	365,151.15
中信证券	001286	陕西能源	新股发行	37,667	361,603.20
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	301439	泓淋电力	新股发行	9,486	189,625.14
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	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
上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 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	688223	晶科能源	新股发行	213,000	1,065,000.00
中信证券	688326	经纬恒润	新股发行	6,832	826,672.00
中信证券	301200	大族数控	新股发行	8,566	655,812.96
中信证券	688302	海创药业	新股发行	13,082	561,479.44
中信证券	301109	军信股份	新股发行	12,250	426,422.50
中信证券	301302	华如科技	新股发行	4,651	241,991.53
中信证券	688150	莱特光电	新股发行	5,626	124,053.30
中信证券	688290	景业智能	新股发行	3,040	103,025.60
中信证券	600938	中国海油	新股发行	5,000	54,000.00
中信证券	603132	金徽股份	新股发行	1,342	14,493.60
中信证券	603191	望变电气	新股发行	1,149	13,627.14
中信证券	603209	兴通股份	新股发行	595	12,804.40

中信证券	001266	宏英智能	新股发行	247	9,536.67
中信证券	603215	比依股份	新股发行	575	7,187.50
中信证券	603051	鹿山新材	新股发行	272	7,014.88

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（2023 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
603105	芯能科技	2023-01-16	6 个月	大宗转让流通受限	16.29	16.51	1,000,000	16,290,000.00	16,510,000.00	-
301486	致尚科技	2023-06-30	1 个月内(含)	新发流通受限	57.66	57.66	4,338	250,129.08	250,129.08	-
688249	晶合集成	2023-04-24	6 个月	新发流通受限	19.86	18.06	7,405	147,063.30	133,734.30	-
301395	仁信	2023-06-21	1 个月内(含)	新发	26.68	26.68	4,676	124,755.68	124,755.68	-

	新材			流通受限						
688472	阿特斯	2023-06-02	6 个月	新发流通受限	11.10	17.04	6,261	69,497.10	106,687.44	-
301292	海科新源	2023-06-29	1 个月内(含)	新发流通受限	19.99	19.99	5,241	104,767.59	104,767.59	-
301488	豪恩汽电	2023-06-26	1 个月内(含)	新发流通受限	39.78	39.78	2,356	93,721.68	93,721.68	-
688443	智翔金泰	2023-06-13	6 个月	新发流通受限	37.88	29.49	3,033	114,890.04	89,443.17	-
688469	中芯集成	2023-04-28	6 个月	新发流通受限	5.69	5.41	13,800	78,522.00	74,658.00	-
301202	朗威股份	2023-06-28	1 个月内(含)	新发流通受限	25.82	25.82	2,754	71,108.28	71,108.28	-
688603	天承科技	2023-06-30	1 个月内(含)	新发流通	55.00	55.00	1,251	68,805.00	68,805.00	-

				受限						
301261	恒工精密	2023-06-29	1 个月内(含)	新发流通受限	36.90	36.90	1,775	65,497.50	65,497.50	-
688361	中科飞测	2023-05-12	6 个月	新发流通受限	23.60	64.67	831	19,611.60	53,740.77	-
688531	日联科技	2023-03-24	6 个月	新发流通受限	152.38	135.97	346	52,723.48	47,045.62	-
301325	曼恩斯特	2023-05-04	6 个月	新发流通受限	76.80	107.95	364	27,955.20	39,293.80	-
688146	中船特气	2023-04-13	6 个月	新发流通受限	36.15	38.13	1,011	36,547.65	38,549.43	-
301291	明阳电气	2023-06-21	6 个月	新发流通受限	38.13	31.03	1,206	45,984.78	37,422.18	-
688484	南芯科技	2023-03-28	6 个月	新发流通受限	39.99	36.71	1,008	40,309.92	37,003.68	-

001286	陕西能源	2023-03-31	6 个月	新发流通受限	9.60	9.41	3,767	36,163.20	35,447.47	-
001287	中电港	2023-03-30	6 个月	新发流通受限	11.88	21.02	1,386	16,465.68	29,133.72	-
688576	西山科技	2023-05-30	6 个月	新发流通受限	135.80	120.41	240	32,592.00	28,898.40	-
301246	宏源药业	2023-03-10	6 个月	新发流通受限	50.00	30.71	931	46,550.00	28,591.01	-
688352	颀中科技	2023-04-11	6 个月	新发流通受限	12.10	12.07	2,361	28,568.10	28,497.27	-
301486	致尚科技	2023-06-30	6 个月	新发流通受限	57.66	57.66	482	27,792.12	27,792.12	-
688507	索辰科技	2023-04-10	6 个月	新发流通受限	245.56	122.11	222	36,834.00	27,108.42	含 证 券 送 配
301310	鑫宏	2023-05-26	6 个月	新发	67.28	65.43	409	27,517.52	26,760.87	-

	业			流通受限						
688582	芯动联科	2023-06-21	6 个月	新发流通受限	26.74	40.68	648	17,327.52	26,360.64	-
301293	三博脑科	2023-04-25	6 个月	新发流通受限	29.60	71.42	333	9,856.80	23,782.86	-
688552	航天南湖	2023-05-08	6 个月	新发流通受限	21.17	23.50	956	20,238.52	22,466.00	-
688570	天玛智控	2023-05-29	6 个月	新发流通受限	30.26	25.33	884	26,749.84	22,391.72	-
301307	美利信	2023-04-14	6 个月	新发流通受限	32.34	31.86	687	22,217.58	21,887.82	-
688543	国科军工	2023-06-14	6 个月	新发流通受限	43.67	53.05	410	17,904.70	21,750.50	-
688458	美芯晟	2023-05-15	6 个月	新发流通	75.00	90.76	221	16,575.00	20,057.96	-

				受限						
688581	安杰思	2023-05-12	6 个月	新发流通受限	125.80	118.03	163	20,505.40	19,238.89	-
301317	鑫磊股份	2023-01-12	6 个月	新发流通受限	20.67	26.17	694	14,344.98	18,161.98	-
301262	海看股份	2023-06-13	6 个月	新发流通受限	30.22	25.50	692	20,912.24	17,646.00	-
301383	天键股份	2023-05-31	6 个月	新发流通受限	46.16	35.72	493	22,756.88	17,609.96	-
688562	航天软件	2023-05-15	6 个月	新发流通受限	12.68	22.31	726	9,205.68	16,197.06	-
301439	泓淋电力	2023-03-10	6 个月	新发流通受限	19.99	16.90	949	18,970.51	16,038.10	-
688623	双元科技	2023-05-31	6 个月	新发流通受限	125.88	86.79	178	22,406.64	15,448.62	-

301332	德尔玛	2023-05-09	6 个月	新发流通受限	14.81	13.73	1,122	16,616.82	15,405.06	-
301399	英特科技	2023-05-16	6 个月	新发流通受限	43.99	51.57	293	12,889.07	15,110.01	-
301305	朗坤环境	2023-05-15	6 个月	新发流通受限	25.25	19.69	753	19,013.25	14,826.57	-
301397	溯联股份	2023-06-15	6 个月	新发流通受限	53.27	40.20	362	19,283.74	14,552.40	-
301387	光大同创	2023-04-10	6 个月	新发流通受限	58.32	45.36	307	17,904.24	13,925.52	-
301395	仁信新材	2023-06-21	6 个月	新发流通受限	26.68	26.68	520	13,873.60	13,873.60	-
301210	金杨股份	2023-06-21	6 个月	新发流通受限	57.88	49.17	281	16,264.28	13,816.77	-
688512	慧智	2023-05-08	6 个月	新发	20.92	19.16	721	15,083.32	13,814.36	-

	微			流通受限						
301382	蜂助手	2023-05-09	6 个月	新发流通受限	23.80	32.84	408	9,710.40	13,398.72	-
688433	华曙高科	2023-04-07	6 个月	新发流通受限	26.66	31.50	418	11,143.88	13,167.00	-
301360	荣旗科技	2023-04-17	6 个月	新发流通受限	71.88	92.60	134	9,631.92	12,408.40	-
301345	涛涛车业	2023-03-10	6 个月	新发流通受限	73.45	46.64	266	19,537.70	12,406.24	-
301292	海科新源	2023-06-29	6 个月	新发流通受限	19.99	19.99	583	11,654.17	11,654.17	-
688523	航天环宇	2023-05-26	6 个月	新发流通受限	21.86	23.85	472	10,317.92	11,257.20	-
603135	中重科技	2023-03-29	6 个月	新发流通	17.80	17.89	628	11,178.40	11,234.92	-

				受限						
301141	中科磁业	2023-03-27	6 个月	新发流通受限	41.20	42.69	262	10,794.40	11,184.78	-
301225	恒勃股份	2023-06-08	6 个月	新发流通受限	35.66	33.26	333	11,874.78	11,075.58	-
301429	森泰股份	2023-04-10	6 个月	新发流通受限	28.75	21.02	499	14,346.25	10,488.98	-
301488	豪恩汽电	2023-06-26	6 个月	新发流通受限	39.78	39.78	262	10,422.36	10,422.36	-
601065	江盐集团	2023-03-31	6 个月	新发流通受限	10.36	11.84	875	9,065.00	10,360.00	-
688631	莱斯信息	2023-06-19	6 个月	新发流通受限	25.28	29.87	336	8,494.08	10,036.32	-
688479	友车科技	2023-05-04	6 个月	新发流通受限	33.99	29.49	332	11,284.68	9,790.68	-

301232	飞沃科技	2023-06-08	6 个月	新发流通受限	72.50	58.42	165	11,962.50	9,639.30	-
301376	致欧科技	2023-06-14	6 个月	新发流通受限	24.66	22.51	420	10,357.20	9,454.20	-
301355	南王科技	2023-06-02	6 个月	新发流通受限	17.55	16.75	563	9,880.65	9,430.25	-
301357	北方长龙	2023-04-11	6 个月	新发流通受限	50.00	48.39	190	9,500.00	9,194.10	-
301386	未来电器	2023-03-21	6 个月	新发流通受限	29.99	23.79	378	11,336.22	8,992.62	-
301323	新莱福	2023-05-29	6 个月	新发流通受限	39.06	39.36	228	8,905.68	8,974.08	-
688429	时创能源	2023-06-20	6 个月	新发流通受限	19.20	25.53	346	6,643.20	8,833.38	-
301170	锡南	2023-06-16	6 个月	新发	34.00	34.93	250	8,500.00	8,732.50	-

	科技			流通受限						
688535	华海诚科	2023-03-28	6 个月	新发流通受限	35.00	51.23	161	5,635.00	8,248.03	-
601133	柏诚股份	2023-03-31	6 个月	新发流通受限	11.66	12.26	664	7,742.24	8,140.64	-
301202	朗威股份	2023-06-28	6 个月	新发流通受限	25.82	25.82	306	7,900.92	7,900.92	-
301295	美硕科技	2023-06-19	6 个月	新发流通受限	37.40	36.07	215	8,041.00	7,755.05	-
301203	国泰环保	2023-03-28	6 个月	新发流通受限	46.13	34.40	225	10,379.25	7,740.00	-
688603	天承科技	2023-06-30	6 个月	新发流通受限	55.00	55.00	140	7,700.00	7,700.00	-
300804	广康生化	2023-06-15	6 个月	新发流通	42.45	32.97	226	9,593.70	7,451.22	-

				受限						
301261	恒工精密	2023-06-29	6 个月	新发流通受限	36.90	36.90	198	7,306.20	7,306.20	-
301337	亚华电子	2023-05-16	6 个月	新发流通受限	32.60	30.37	232	7,563.20	7,045.84	-
301428	世纪恒通	2023-05-10	6 个月	新发流通受限	26.35	30.60	229	6,034.15	7,007.40	-
001380	华纬科技	2023-05-09	6 个月	新发流通受限	28.84	30.78	170	4,902.80	5,232.60	-
603125	常青科技	2023-03-30	6 个月	新发流通受限	25.98	24.53	160	4,156.80	3,924.80	-
001328	登康口腔	2023-03-29	6 个月	新发流通受限	20.68	25.49	145	2,998.60	3,696.05	-
001282	三联锻造	2023-05-15	6 个月	新发流通受限	27.93	33.03	105	2,932.65	3,468.15	-

001360	南矿集团	2023-03-31	6 个月	新发流通受限	15.38	14.87	177	2,722.26	2,631.99	-
001324	长青科技	2023-05-12	6 个月	新发流通受限	18.88	19.60	114	2,152.32	2,234.40	-
001367	海森药业	2023-03-30	6 个月	新发流通受限	44.48	39.48	55	2,446.40	2,171.40	-
603172	万丰股份	2023-04-28	6 个月	新发流通受限	14.58	16.13	122	1,778.76	1,967.86	-

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

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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	合计
银行存款	85,970,855.26	-	-	85,970,855.26
结算备付金	489,160.08	-	-	489,160.08
结算保证金	181,927.18	-	-	181,927.18
债券投资	202,077,479.45	-	-	202,077,479.45
资产支持证券	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-
应收直销申购款	33,678.00	-	-	33,678.00
卖出回购金融资产款	-	-	-	-

注：本表所示为本基金生息资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	利率下降 25 个基点	330,987.50	-
	利率上升 25 个基点	-329,906.89	-

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。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
银行存款	-	-	-	-
交易性金融资产	-	526,721,033.61	-	526,721,033.61
衍生金融资产	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产合计	-	526,721,033.61	-	526,721,033.61
以外币计价的负债				
应付在途资金	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-
应付换汇款	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-
应付赎回费	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
项目	上年度末 2022年12月31日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
银行存款	-	-	-	-

交易性金融资产	-	816,093,513.11	-	816,093,513.11
衍生金融资产	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产合计	-	816,093,513.11	-	816,093,513.11
以外币计价的负债				
应付在途资金	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-
应付换汇款	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-
应付赎回费	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	港币相对人民币升值 5%	26,336,051.68	40,804,675.66
	港币相对人民币贬值 5%	-26,336,051.68	-40,804,675.66

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 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 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	3,605,816,070.41	93.26	4,397,004,404.95	93.04
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-

衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	3,605,816,070.41	93.26	4,397,004,404.95	93.04

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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	-5%	-148,215,037.70	-203,895,788.70
	+5%	148,215,037.70	203,895,788.70

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 2023 年 6 月 30 日
第一层次	3,586,909,357.20
第二层次	202,942,913.63
第三层次	18,041,279.03
合计	3,807,893,549.86

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 2023 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	3,605,816,070.41	92.29
	其中：股票	3,605,816,070.41	92.29
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	202,077,479.45	5.17
	其中：债券	202,077,479.45	5.17
	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	86,460,015.34	2.21
8	其他各项资产	12,723,954.78	0.33
9	合计	3,907,077,519.98	100.00

注：本基金本报告期末通过港股通机制投资香港股票的公允价值为 526,721,033.61 元，占基金资产净值比例为 13.62%。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	-	-

B	采矿业	-	-
C	制造业	2,686,672,249.77	69.49
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	35,447.47	0.00
E	建筑业	8,140.64	0.00
F	批发和零售业	38,587.92	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	221,933,589.80	5.74
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	163,339,827.21	4.22
M	科学研究和技术服务业	7,020,844.56	0.18
N	水利、环境和公共设施管理业	22,566.57	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	23,782.86	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	3,079,095,036.80	79.63

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
信息技术	281,048,786.08	7.27
保健	245,672,247.53	6.35
必需消费品	-	-
材料	-	-
房地产	-	-
非必需消费品	-	-
工业	-	-
公用事业	-	-
金融	-	-
能源	-	-
通讯服务	-	-
合计	526,721,033.61	13.62

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

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	300750	宁德时代	1,472,873	336,978,613.67	8.72
2	603799	华友钴业	6,573,419	301,785,666.29	7.81
3	00268	金蝶国际	29,087,000	281,048,786.08	7.27

4	603179	新泉股份	6,300,255	276,518,191.95	7.15
5	688212	澳华内镜	3,722,121	252,732,015.90	6.54
6	02273	固生堂	5,361,400	245,672,247.53	6.35
7	300855	图南股份	6,753,881	238,547,076.92	6.17
8	300662	科锐国际	4,618,033	163,339,827.21	4.22
9	688598	金博股份	949,458	162,832,047.00	4.21
10	002475	立讯精密	5,016,491	162,785,132.95	4.21
11	002812	恩捷股份	1,673,432	161,235,173.20	4.17
12	300298	三诺生物	5,487,122	148,371,778.88	3.84
13	603105	芯能科技	7,764,000	130,753,960.00	3.38
14	002985	北摩高科	2,804,981	123,755,761.72	3.20
15	688536	思瑞浦	520,133	113,388,994.00	2.93
16	688052	纳芯微	684,453	108,396,821.61	2.80
17	688333	铂力特	951,109	100,570,265.66	2.60
18	688005	容百科技	1,483,021	80,112,794.42	2.07
19	688059	华锐精密	929,389	77,836,328.75	2.01
20	688308	欧科亿	1,900,676	76,027,040.00	1.97
21	002709	天赐材料	940,536	38,740,677.84	1.00
22	688523	航天环宇	357,620	9,614,966.92	0.25
23	688238	和元生物	621,864	7,020,844.56	0.18
24	688433	华曙高科	120,830	4,107,175.00	0.11
25	301291	明阳电气	12,054	391,066.98	0.01
26	301486	致尚科技	4,820	277,921.20	0.01
27	688443	智翔金泰	6,718	203,346.52	0.01
28	688489	三未信安	2,953	186,777.25	0.00
29	301397	溯联股份	3,618	152,606.80	0.00
30	301210	金杨股份	2,801	143,168.37	0.00
31	301395	仁信新材	5,196	138,629.28	0.00
32	301360	荣旗科技	1,340	138,170.08	0.00
33	688249	晶合集成	7,405	133,734.30	0.00
34	301292	海科新源	5,824	116,421.76	0.00
35	688472	阿特斯	6,261	106,687.44	0.00
36	301488	豪恩汽电	2,618	104,144.04	0.00
37	688533	上声电子	1,963	91,730.99	0.00
38	301202	朗威股份	3,060	79,009.20	0.00
39	300804	广康生化	2,257	77,134.83	0.00
40	688603	天承科技	1,391	76,505.00	0.00
41	688469	中芯集成	13,800	74,658.00	0.00
42	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	0.00
43	301262	海看股份	2,117	57,189.75	0.00
44	688361	中科飞测	831	53,740.77	0.00
45	688531	日联科技	346	47,045.62	0.00
46	301325	曼恩斯特	364	39,293.80	0.00

47	688146	中船特气	1,011	38,549.43	0.00
48	688484	南芯科技	1,008	37,003.68	0.00
49	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.00
50	001287	中电港	1,386	29,133.72	0.00
51	688576	西山科技	240	28,898.40	0.00
52	301246	宏源药业	931	28,591.01	0.00
53	688352	硕中科技	2,361	28,497.27	0.00
54	688507	索辰科技	222	27,108.42	0.00
55	301310	鑫宏业	409	26,760.87	0.00
56	688582	芯动联科	648	26,360.64	0.00
57	301293	三博脑科	333	23,782.86	0.00
58	688552	航天南湖	956	22,466.00	0.00
59	688570	天玛智控	884	22,391.72	0.00
60	301307	美利信	687	21,887.82	0.00
61	688543	国科军工	410	21,750.50	0.00
62	688458	美芯晟	221	20,057.96	0.00
63	688581	安杰思	163	19,238.89	0.00
64	301317	鑫磊股份	694	18,161.98	0.00
65	301383	天键股份	493	17,609.96	0.00
66	688562	航天软件	726	16,197.06	0.00
67	301439	泓淋电力	949	16,038.10	0.00
68	688623	双元科技	178	15,448.62	0.00
69	301332	德尔玛	1,122	15,405.06	0.00
70	301399	英特科技	293	15,110.01	0.00
71	300782	卓胜微	155	14,977.65	0.00
72	301305	朗坤环境	753	14,826.57	0.00
73	301387	光大同创	307	13,925.52	0.00
74	688512	慧智微	721	13,814.36	0.00
75	301382	蜂助手	408	13,398.72	0.00
76	301345	涛涛车业	266	12,406.24	0.00
77	603135	中重科技	628	11,234.92	0.00
78	301141	中科磁业	262	11,184.78	0.00
79	301225	恒勃股份	333	11,075.58	0.00
80	301429	森泰股份	499	10,488.98	0.00
81	601065	江盐集团	875	10,360.00	0.00
82	688631	莱斯信息	336	10,036.32	0.00
83	688479	友车科技	332	9,790.68	0.00
84	301232	飞沃科技	165	9,639.30	0.00
85	301376	致欧科技	420	9,454.20	0.00
86	301355	南王科技	563	9,430.25	0.00
87	301357	北方长龙	190	9,194.10	0.00
88	301386	未来电器	378	8,992.62	0.00
89	301323	新莱福	228	8,974.08	0.00

90	688429	时创能源	346	8,833.38	0.00
91	301170	锡南科技	250	8,732.50	0.00
92	688535	华海诚科	161	8,248.03	0.00
93	601133	柏诚股份	664	8,140.64	0.00
94	301295	美硕科技	215	7,755.05	0.00
95	301203	国泰环保	225	7,740.00	0.00
96	301337	亚华电子	232	7,045.84	0.00
97	301428	世纪恒通	229	7,007.40	0.00
98	001380	华纬科技	170	5,232.60	0.00
99	300122	智飞生物	117	5,171.40	0.00
100	603125	常青科技	160	3,924.80	0.00
101	001328	登康口腔	145	3,696.05	0.00
102	001282	三联锻造	105	3,468.15	0.00
103	001360	南矿集团	177	2,631.99	0.00
104	001324	长青科技	114	2,234.40	0.00
105	300813	泰林生物	78	2,228.46	0.00
106	001367	海森药业	55	2,171.40	0.00
107	603172	万丰股份	122	1,967.86	0.00
108	300562	乐心医疗	78	764.40	0.00

注：所用证券代码采用当地市场代码。

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	603179	新泉股份	105,198,791.63	2.23
2	002475	立讯精密	90,833,027.99	1.92
3	002985	北摩高科	90,381,562.22	1.91
4	002709	天赐材料	86,974,805.02	1.84
5	02273	固生堂	85,882,777.79	1.82
6	688598	金博股份	85,315,187.29	1.81
7	688052	纳芯微	67,097,330.49	1.42
8	300855	图南股份	55,880,976.97	1.18
9	603799	华友钴业	41,805,117.70	0.88
10	603105	芯能科技	38,753,221.00	0.82
11	300298	三诺生物	33,141,179.33	0.70
12	688212	澳华内镜	31,746,232.27	0.67
13	300750	宁德时代	31,718,429.01	0.67
14	002812	恩捷股份	27,424,307.00	0.58
15	688523	航天环宇	9,886,441.84	0.21
16	01548	金斯瑞生物科技	9,116,874.97	0.19

17	688059	华锐精密	9,110,307.75	0.19
18	688308	欧科亿	5,355,218.18	0.11
19	688333	铂力特	4,971,589.13	0.11
20	688433	华曙高科	3,979,707.79	0.08

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	01548	金斯瑞生物科技	170,533,842.28	3.61
2	002291	遥望科技	132,916,084.35	2.81
3	002475	立讯精密	129,009,600.27	2.73
4	300450	先导智能	125,840,433.98	2.66
5	688333	铂力特	85,630,483.28	1.81
6	688536	思瑞浦	76,839,218.98	1.63
7	300750	宁德时代	67,427,500.00	1.43
8	300298	三诺生物	58,125,574.40	1.23
9	002709	天赐材料	47,249,047.94	1.00
10	688052	纳芯微	46,411,696.55	0.98
11	002985	北摩高科	40,458,377.44	0.86
12	688005	容百科技	34,526,350.99	0.73
13	688238	和元生物	33,627,545.51	0.71
14	688598	金博股份	32,537,880.51	0.69
15	300855	图南股份	20,327,157.02	0.43
16	603105	芯能科技	19,600,943.00	0.41
17	688059	华锐精密	8,741,730.70	0.18
18	300662	科锐国际	8,610,477.00	0.18
19	01477	欧康维视生物—B	7,845,256.84	0.17
20	688308	欧科亿	4,986,518.61	0.11

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	933,342,634.22
卖出股票收入（成交）总额	1,172,026,881.66

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	202,077,479.45	5.23
	其中：政策性金融债	202,077,479.45	5.23
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	202,077,479.45	5.23

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	230401	23 农发 01	2,000,000	202,077,479.45	5.23
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末无股指期货投资。

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 报告期内，本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求，未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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	181,927.18
2	应收清算款	11,529,803.17
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,012,224.43
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	12,723,954.78

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
1,620,963	3,369.88	3,860,820.43	0.07%	5,458,596,411.20	99.93%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	苏伟	3,002,250.00	1.80%
2	叶挺	2,001,300.00	1.20%
3	吴跃	1,812,687.00	1.09%
4	汕头市艺思贸易有限公司	1,682,000.00	1.01%
5	孙玉	1,291,951.00	0.78%
6	何宝岁	1,256,576.00	0.75%
7	温璐	1,226,388.00	0.74%
8	姚钢	1,058,904.00	0.64%
9	石春燕	1,047,332.00	0.63%
10	劳荣欢	1,047,102.00	0.63%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	6,683,325.64	0.12%

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	>100

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2020 年 10 月 13 日）基金份额总额	12,003,147,875.79
本报告期期初基金份额总额	5,803,385,014.35
本报告期基金总申购份额	321,431,447.88
减：本报告期基金总赎回份额	662,359,230.60
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	5,462,457,231.63

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期未发生影响基金管理人经营或基金运营业务的诉讼。

本报告期无涉及基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

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

报告期内，未发生基金托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情形。

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	1	1,327,578,608.35	63.59%	989,640.16	64.02%	-
甬兴证券	1	341,960,053.12	16.38%	250,073.52	16.18%	-
方正证券	1	257,474,287.02	12.33%	188,523.27	12.20%	-
中金公司	1	160,754,530.06	7.70%	117,554.13	7.60%	-

注：①为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择券商的标准，即：

i 经营行为规范。

ii 公司财务状况良好。

iii有良好的内控制度，在业内有良好的声誉。

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

v 建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯和服务。

②券商专用交易单元选择程序：

i 本基金管理人根据上述标准进行评估并确定选用的券商。

ii 本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议/证券经纪服务协议。

③除本表列示外，本基金还选择了东吴证券、银河证券、粤开证券、中国银河证券、中信建投证券的交易单元作为本基金交易单元，本报告期无股票交易及应付佣金。

④在上述租用的券商交易单元中，甬兴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	-	-	-	-	-	-	-	-
甬兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华夏基金管理有限公司公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-01-06
2	华夏创新未来混合型证券投资基金（LOF）暂停申购、赎回、定期定额申购业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-01-16
3	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-01-19
4	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关	中国证监会指定报刊及	2023-03-11

	联方承销证券的公告	网站	
5	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-03-30
6	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-04-01
7	华夏创新未来混合型证券投资基金（LOF）暂停申购、赎回、定期定额申购业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-04-04
8	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-04-13
9	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-04-15
10	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-04-27
11	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-05-13
12	华夏创新未来混合型证券投资基金（LOF）暂停申购、赎回、定期定额申购业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-05-23
13	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-05-27
14	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-05-31

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予基金注册的文件；
- 2、《华夏创新未来混合型证券投资基金（LOF）基金合同》；
- 3、《华夏创新未来混合型证券投资基金（LOF）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

二〇二三年八月三十日