

---

# 华夏智胜先锋股票型证券投资基金（LOF）

## 2022 年年度报告

2022 年 12 月 31 日

基金管理人：华夏基金管理有限公司

基金托管人：华夏银行股份有限公司

送出日期：二〇二三年三月三十日

## §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。本年度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。

基金托管人华夏银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 3 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。

本报告中的财务资料经审计，安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2022 年 1 月 1 日起至 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况 .....	4
3.1 主要会计数据和财务指标.....	4
3.2 基金净值表现.....	5
3.3 过去三年基金的利润分配情况 .....	7
§4 管理人报告.....	8
§5 托管人报告.....	13
§6 审计报告.....	14
§7 年度财务报表.....	16
7.1 资产负债表.....	16
7.2 利润表.....	17
7.3 净资产（基金净值）变动表.....	18
7.4 报表附注.....	20
§8 投资组合报告.....	50
8.1 期末基金资产组合情况.....	50
8.3 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 .....	51
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	62
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	64
8.6 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 .....	64
8.7 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 .....	64
8.8 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 .....	64
8.9 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 .....	65
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	65
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	65
8.12 投资组合报告附注.....	65
§9 基金份额持有人信息.....	66
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	66
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	66
9.4 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 .....	66
§10 开放式基金份额变动.....	67
§11 重大事件揭示.....	67
§12 影响投资者决策的其他重要信息 .....	70
§13 备查文件目录.....	70

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华夏智胜先锋股票型证券投资基金（LOF）	
基金简称	华夏智胜先锋股票（LOF）	
场内简称	智胜先锋（扩位证券简称：智胜先锋 LOF）	
基金主代码	501219	
交易代码	501219	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 12 月 15 日	
基金管理人	华夏基金管理有限公司	
基金托管人	华夏银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	421,897,017.32 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	2022 年 2 月 9 日	
下属分级基金的基金简称	华夏智胜先锋股票（LOF）A	华夏智胜先锋股票 C
下属分级基金的交易代码	501219	014198
报告期末下属分级基金的份额总额	166,239,703.81 份	255,657,313.51 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在合理控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报，力求实现基金资产的稳健增值。
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、国债期货投资策略、股指期货投资策略、股票期权投资策略等。在股票投资策略上，本基金在股票投资方面主要采用量化模型选股、基本面选股等多种策略构建投资组合，同时运用数量化方法优化组合交易并控制组合风险，实现超额收益。
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	本基金为股票型基金，80%-95%的基金资产投资于股票，其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

### 2.3 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	华夏银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李彬	郑鹏
	联系电话	400-818-6666	010-85238667
	电子邮箱	service@ChinaAMC.com	zhengpeng@hxb.com.cn
客户服务电话		400-818-6666	95577
传真		010-63136700	010-85238680
注册地址		北京市顺义区安庆大街甲3号院	北京市东城区建国门内大街22号（100005）
办公地址		北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座8层	北京市东城区建国门内大街22号（100005）

邮政编码	100033	100005
法定代表人	杨明辉	李民吉

## 2.4 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》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.ChinaAMC.com
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层
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、基金净值表现及利润分配情况

## 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	2022 年		2021 年 12 月 15 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日	
	华夏智胜先锋股票（LOF）A	华夏智胜先锋股票 C	华夏智胜先锋股票（LOF）A	华夏智胜先锋股票 C
本期已实现收益	-1,428,431.68	-2,020,180.87	-40,936.18	-53,429.92
本期利润	-10,467,476.89	-6,551,403.47	3,822,772.99	2,302,123.23
加权平均基金份额本期利润	-0.0537	-0.0438	0.0144	0.0142
本期加权平均净值利润率	-5.53%	-4.47%	1.44%	1.42%
本期基金份额净值增长率	-0.32%	-0.71%	1.44%	1.42%
3.1.2 期末数据和指标	2022 年末		2021 年末	
	华夏智胜先锋股票（LOF）A	华夏智胜先锋股票 C	华夏智胜先锋股票（LOF）A	华夏智胜先锋股票 C
期末可供分配利润	1,853,675.19	1,780,346.74	-40,936.18	-53,429.92
期末可供分配基金份额利润	0.0112	0.0070	-0.0002	-0.0003
期末基金资产净值	168,093,379.00	257,437,660.25	269,869,782.98	164,525,174.94
期末基金	1.0112	1.0070	1.0144	1.0142

份额净值				
3.1.3 累计期末指标	2022 年末		2021 年末	
	华夏智胜先锋股票（LOF）A	华夏智胜先锋股票 C	华夏智胜先锋股票（LOF）A	华夏智胜先锋股票 C
基金份额累计净值增长率	1.12%	0.70%	1.44%	1.42%

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

华夏智胜先锋股票（LOF）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
过去三个月	4.71%	1.08%	2.52%	0.97%	2.19%	0.11%
过去六个月	0.37%	1.09%	-8.66%	1.04%	9.03%	0.05%
过去一年	-0.32%	1.37%	-19.30%	1.31%	18.98%	0.06%
自基金合同生效起至今	1.12%	1.34%	-18.93%	1.28%	20.05%	0.06%

华夏智胜先锋股票 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
过去三个月	4.61%	1.08%	2.52%	0.97%	2.09%	0.11%
过去六个月	0.16%	1.09%	-8.66%	1.04%	8.82%	0.05%
过去一年	-0.71%	1.37%	-19.30%	1.31%	18.59%	0.06%
自基金合同生效起至今	0.70%	1.34%	-18.93%	1.28%	19.63%	0.06%

#### 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

华夏智胜先锋股票型证券投资基金（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

(2021 年 12 月 15 日至 2022 年 12 月 31 日)

华夏智胜先锋股票（LOF）A



华夏智胜先锋股票 C



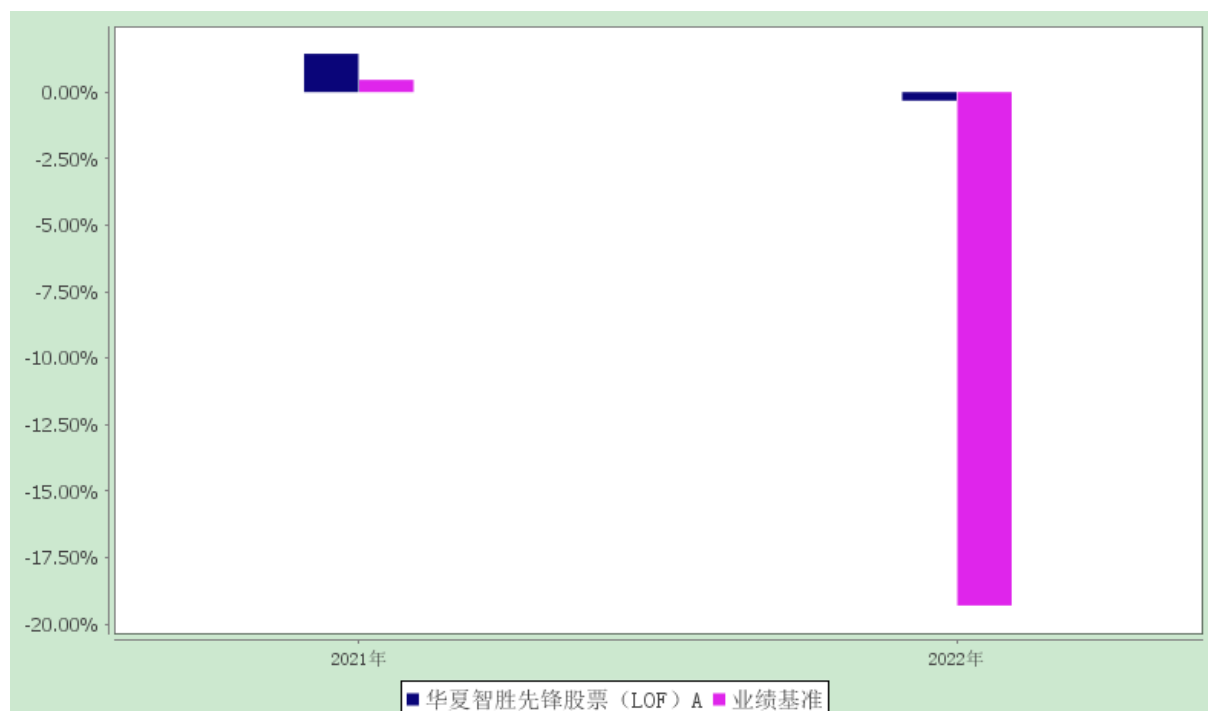
注：根据本基金的基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同中投资范围、投资限制的有关约定。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

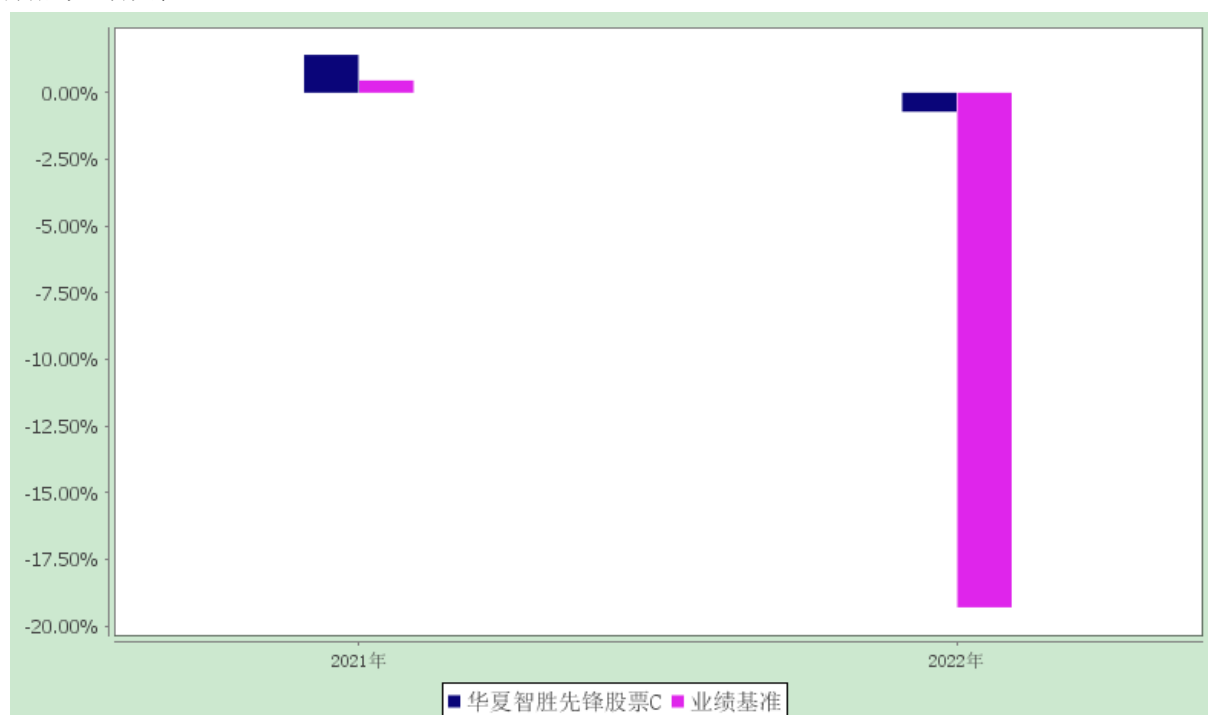
#### 华夏智胜先锋股票型证券投资基金（LOF）

自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图

### 华夏智胜先锋股票（LOF）A



### 华夏智胜先锋股票 C



注：本基金合同于 2021 年 12 月 15 日生效，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自基金合同生效以来无利润分配事项。



## §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、广州和青岛设有分公司，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、Smart Beta 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 2022 年 12 月 31 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 TMT 与信息技术行业偏股型基金(A 类)中华夏互联网龙头混合(A 类)排名第 2/22；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 TMT 与信息技术行业股票型基金(A 类)中华夏科技成长股票排名第 4/20；在医药医疗健康行业偏股型基金(A 类)中华夏逸享健康混合(A 类)排名第 8/60、华夏乐享健康混合(A 类)排名第 17/60；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 12/61；在标准股票型基金(A 类)中华夏智胜价值成长股票(A 类)排名第 12/307；在灵活配置型基金(基准股票比例 30%-60%)(A 类)中华夏新锦绣混合(A 类)排名第 12/451、华夏新锦升混合(A 类)排名第 18/451、华夏新趋势混合(A 类)排名第 78/451；在偏股型基金(股票上限 80%)(A 类)中华夏经典混合排名第 18/148；在偏股型基金(股票上限 95%)(A 类)中华夏新兴经济一年持有混合(A 类)排名第 17/211、华夏磐利一年定开混合(A 类)排名第 38/211、

华夏蓝筹混合(LOF)(A 类)排名第 44/211、华夏磐锐一年定开混合(A 类)排名第 45/211、华夏兴华混合(A 类)排名第 49/211；在灵活配置型基金(基准股票比例 60%-100%)(A 类)中华夏圆和混合(A 类)排名第 28/461；在偏债型基金(A 类)中华夏睿磐泰盛混合排名第 30/532、华夏磐泰混合(LOF)(A 类)排名第 43/532；在偏股型基金(股票上下限 60%-95%)(A 类)中华夏价值精选混合排名第 60/1177。

固收与固收+产品：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 2/14；在普通债券型基金(二级)(A 类)中华夏恒融债券排名第 6/336、华夏稳健增利 4 个月债券(A 类)排名第 16/336；在利率债指数债券型基金(A 类)中华夏中债 1-3 年政金债指数(A 类)排名第 21/107；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)排名第 33/357；在长期纯债债券型基金(A 类)中华夏鼎隆债券(A 类)排名第 59/1158、华夏鼎英债券(A 类)排名第 60/1158。

指数与量化产品：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 1/23；在规模指数股票 ETF 基金中华夏沪港通恒生 ETF 排名第 1/131、华夏中证沪港深 500ETF 排名第 26/131、华夏上证 50ETF 排名第 30/131；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 1/92、华夏上证 50ETF 联接(A 类)排名第 25/92；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 2/28、华夏中证全指房地产 ETF 联接(A 类)排名第 7/28；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 2/123、华夏中证 500 指数智选增强(A 类)排名第 4/123、华夏沪深 300 指数增强(A 类)排名第 38/123；在行业指数股票 ETF 基金中华夏中证银行 ETF 排名第 6/51、华夏中证全指房地产 ETF 排名第 16/51；在主题指数股票 ETF 基金中华夏金融 ETF 发起式排名第 11/257、华夏中证浙江国资创新发展 ETF 排名第 37/257、华夏中证细分食品饮料产业主题 ETF 排名第 40/257、华夏中证央企 ETF 排名第 47/257、华夏中证细分有色金属产业主题 ETF 排名第 67/257；在主题指数股票 ETF 联接基金(A 类)中华夏中证浙江国资创新发展 ETF 联接(A 类)排名第 21/89、华夏中证央企 ETF 联接(A 类)排名第 27/89。

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十七届中国基金业明星基金奖评选活动中，在“年度十大明星基金公司奖”评选中，华夏基金成功获奖。此外，华夏基金还获得“三年海外投资明星基金公司奖”。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，2022 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）华夏基金直销上线北京银行、广发银行快捷等支付方式，拓展支付渠道的同时交易额度也得到进一步提升，满足客户支付需求；（2）华夏基金管家客户端优化资料上传、定投收益展示等功能，增加客户操作便利性；养老专区升级，为个人养老金账户的开立、充值及交易提供一站式服务，提升客户整体操作感受；（3）与兰州银行、晋商银行、成都银行、九州证券、瑞银基金销售等代销机构合作，拓展更加丰富的客户理财渠道；（4）开展“压岁钱手账”、“基金视力表”、“童言童语话理财”、“寻找代言人”、“成为首批 Y 星人”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	2021-12-15	-	8 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。

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。

#### 4.1.3 基金经理薪酬机制

本基金管理人旗下基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的，不存在基金经理薪酬激励与其在管私募资产管理计划浮动管理费或产品业绩表现挂钩的情况。

#### 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 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规制定了《华夏基金管理有限公司公平交易制度》。公司通过科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制

制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时，通过监察稽核、事后分析和信息披露来保证公平交易过程和结果的监督。

#### 4.3.2 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。

##### 4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

本基金管理人一贯严格执行公平交易原则，对兼任基金经理的交易情况进行持续监测。本年度所有相关组合的交易行为均符合法规、制度和流程要求，未发现违反公平交易原则的情况。本年度同一基金经理管理的不同组合在邻近交易日的同向和反向交易，交易时机和交易价差均可合理解释，未发现异常。

本基金管理人根据《基金经理兼任私募资产管理计划投资经理工作指引（试行）》要求，针对同经理管理多个组合间的收益率差异进行归因分析，本年度各组合间收益率差异均属正常情况，主要原因为业绩基准不同、投资策略不同，收益率差异可以合理解释。

#### 4.3.3 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 113 次，其中 110 次为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易，其余 3 次为投资策略需要所致，不同基金经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易，有关基金经理已根据公司管理要求提供决策依据。

#### 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

2022 年，国际环境风高浪急，地缘政治冲突、疫情蔓延和能源食品危机等多重超预期因素冲击全球经济。美联储激进加息，在高通胀和高利率双重压力下，美国消费者支出减少，就业市场放缓；欧元区受到能源价格飙升的影响更加显著，核心通胀压力持续，对通胀预期上升的担忧超过了对经济衰退的恐惧；日本央行受困于国内需求疲软、经济复苏乏力，一直坚持超宽松货币政策。国内方面，在受到疫情散发多发、极端高温天气等多重超预期因素反复冲击的情况下，国民经济顶住压力持续发展，经济总量再上新台阶，经济增速仍快于多数主要经济体；随着稳经济一揽子政策和接续政策落地显效，消费规模持续扩大，投资关键作用有效发挥，净出口较快增长，三大需求共同发力；消费价格温和上涨，就业保持总体稳定。

2022 年，A 股市场下跌后涨、再跌再涨，呈现“W 型”走势，行业、风格轮动明显，宽基指数表现相对均衡，其中沪深 300 指数下跌 21.63%，中证 500 指数下跌 20.31%，中证 1000 指数下跌 21.58%。行业方面，煤炭及消费相关行业表现较好，而科技成长行业表现较差。量化因子表现同样呈现轮动特征，整体上估值、反转因子表现较好，而盈利、成长表现较差，量化策略表现处于历史平均水平。

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 2022 年 12 月 31 日，华夏智胜先锋股票（LOF）A 基金份额净值为 1.0112 元，本报告期份额净值增长率为-0.32%；华夏智胜先锋股票 C 基金份额净值为 1.0070 元，本报告期份额净值增长率为-0.71%，同期业绩比较基准增长率为-19.30%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

发展经济成为政府工作重心，货币政策将继续保持宽松，财政政策将处于积极状态，各种产业政策陆续出台，预计中国经济迎来复苏。受经济复苏的影响，整体 A 股上市公司盈利增速方向向上，但是增速幅度存在不确定。展望 2023 年，市场预计震荡上行，行业或者风格板块呈现轮动特征，建议均衡配置。

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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人持续加强合规管理、风险控制和监察稽核工作。在合规管理方面，公司通过合规审核、合规检查、合规咨询、合规宣传与合规培训等对合规风险进行管理，确保公司合规体系高效运行，合规风险有效控制。公司不断强化合规制度建设，在投资者适当性管理和员工投资行为合规管理等方面修订多项管理制度。持续强化合规队伍专业能力建设，提升合规人员解读政策法律、预判防控合规风险的能力。公司通过法律法规答题、合规培训、合规谈话等形式，多措并举厚植合规经营文化。公司严格落实信息披露法规要求，依法合规开展信息披露工作。在风险控制方面，公司秉承数字化管理理念，持续完善内部风险管理系统建设，稳步夯实投资风险管理体系基础。在严格管控基金日常投资运作风险的同时，持续完善风险管理制度建设，提升基金流动性风险、市场风险、合规风险、操作风险等关键风险的管控水平，努力保障各项风险管理措施落实到位。在监

察稽核方面，公司定期和不定期开展内部稽核及离任审计工作，排查业务风险隐患，促进公司整体业务合规运作、稳健经营。

报告期内，本基金管理人所管理的基金整体运作合法合规。本基金管理人将继续以风险控制为核心，坚持基金份额持有人利益优先的原则，提高监察稽核工作的科学性和有效性，切实保障基金合规稳健运作。

#### 4.7 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。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

#### 4.9 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

报告期内，本基金托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

#### 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

报告期内，基金管理人在投资运作、基金资产净值计算、利润分配、基金费用开支等方面，能够遵守有关法律法规，未发现有损害基金份额持有人利益的行为。报告期内，本基金利润分配情况真实、准确。

#### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

托管人认为，由基金管理人编制并经托管人复核的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、

财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

## §6 审计报告

安永华明（2023）审字第 60739337\_A130 号

华夏智胜先锋股票型证券投资基金（LOF）全体基金份额持有人：

### 6.1 审计意见

我们审计了华夏智胜先锋股票型证券投资基金（LOF）的财务报表，包括 2022 年 12 月 31 日的资产负债表，2022 年度的利润表、净资产（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。

我们认为，后附的华夏智胜先锋股票型证券投资基金（LOF）的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了华夏智胜先锋股票型证券投资基金（LOF）2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和净值变动情况。

### 6.2 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于华夏智胜先锋股票型证券投资基金（LOF），并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

### 6.3 其他信息

华夏智胜先锋股票型证券投资基金（LOF）管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。

我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。

结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。

基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。

### 6.4 管理层和治理层对财务报表的责任

管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时，管理层负责评估华夏智胜先锋股票型证券投资基金（LOF）的持续经营能

力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。

治理层负责监督华夏智胜先锋股票型证券投资基金（LOF）的财务报告过程。

## 6.5 注册会计师对财务报表审计的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

（2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

（3）评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

（4）对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对华夏智胜先锋股票型证券投资基金（LOF）持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致华夏智胜先锋股票型证券投资基金（LOF）不能持续经营。

（5）评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

中国注册会计师

蒋燕华 王海彦



北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层

2023 年 3 月 28 日

## §7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：华夏智胜先锋股票型证券投资基金（LOF）

报告截止日：2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	26,126,592.17	30,318,635.67
结算备付金		1,495,564.90	-
存出保证金		1,798,395.20	-
交易性金融资产	7.4.7.2	390,438,480.79	370,223,373.42
其中：股票投资		390,069,340.02	370,223,373.42
基金投资		-	-
债券投资		369,140.77	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	34,100,170.50
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		7,388,773.50	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	6,725.72
资产总计		427,247,806.56	434,648,905.31
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2021 年 12 月 31 日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		1,039,506.86	-
应付管理人报酬		342,946.30	187,899.43
应付托管费		68,589.26	37,579.88
应付销售服务费		82,364.29	28,468.08
应付投资顾问费		-	-
应交税费		3,272.91	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	180,087.69	-
负债合计		1,716,767.31	253,947.39
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.7	421,897,017.32	428,270,061.70
未分配利润	7.4.7.8	3,634,021.93	6,124,896.22
净资产合计		425,531,039.25	434,394,957.92
负债和净资产总计		427,247,806.56	434,648,905.31

注：①报告截止日 2022 年 12 月 31 日，华夏智胜先锋股票（LOF）A 基金份额净值 1.0112 元，华夏智胜先锋股票 C 基金份额净值 1.0070 元；华夏智胜先锋股票（LOF）基金份额总额 421,897,017.32 份（其中 A 类 166,239,703.81 份，C 类 255,657,313.51 份）。

②本基金合同于 2021 年 12 月 15 日生效，上年度可比期间自 2021 年 12 月 15 日至 2021 年 12 月 31 日。

③以下比较数据已根据本年《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>》中的资产负债表格式的要求进行列示：2021 年年度报告资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目的“本期末”余额合并列示在 2022 年年度报告资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额，2021 年年度报告资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在 2022 年年度报告资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额。

## 7.2 利润表

会计主体：华夏智胜先锋股票型证券投资基金（LOF）

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 12 月 15 日 (基金合同生效日) 至 2021 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		-12,234,208.99	6,497,905.09
1.利息收入		165,301.08	124,371.59
其中：存款利息收入	7.4.7.9	75,064.20	47,743.73
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		90,236.88	76,627.86
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		260,940.45	154,271.18
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-4,405,139.98	154,271.18
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	136,348.38	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.12	-	-

贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.13	96,365.67	-
股利收益	7.4.7.14	4,433,366.38	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.15	-13,570,267.81	6,219,262.32
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	909,817.29	-
<b>减：二、营业总支出</b>		4,784,671.37	373,008.87
1.管理人报酬		3,352,651.19	187,899.43
2.托管费		670,530.24	37,579.88
3.销售服务费		580,738.68	28,468.08
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	7.4.7.17	-	-
7.税金及附加		351.26	-
8.其他费用	7.4.7.18	180,400.00	119,061.48
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-17,018,880.36	6,124,896.22
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-17,018,880.36	6,124,896.22
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-17,018,880.36	6,124,896.22

注：①本基金合同于 2021 年 12 月 15 日生效，上年度可比期间自 2021 年 12 月 15 日至 2021 年 12 月 31 日。

②以下比较数据已根据本年《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>》中的利润表格式的要求进行列示：2021 年年度报告利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在 2022 年年度报告利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

### 7.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：华夏智胜先锋股票型证券投资基金（LOF）

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	428,270,061.70	-	6,124,896.22	434,394,957.92
二、本期期初净资产（基金净值）	428,270,061.70	-	6,124,896.22	434,394,957.92

三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-6,373,044.38	-	-2,490,874.29	-8,863,918.67
（一）、综合收益总额	-	-	-17,018,880.36	-17,018,880.36
（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）	-6,373,044.38	-	14,528,006.07	8,154,961.69
其中：1.基金申购款	361,407,218.00	-	4,829,847.14	366,237,065.14
2.基金赎回款	-367,780,262.38	-	9,698,158.93	-358,082,103.45
（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）	421,897,017.32	-	3,634,021.93	425,531,039.25
项目	上年度可比期间 2021 年 12 月 15 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	428,270,061.70	-	-	428,270,061.70
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-	-	6,124,896.22	6,124,896.22
（一）、综合收益总额	-	-	6,124,896.22	6,124,896.22
（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）	-	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-	-
（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）	-	-	-	-

号填列)				
四、本期期末净资产（基金净值）	428,270,061.70	-	6,124,896.22	434,394,957.92

注：本基金合同于 2021 年 12 月 15 日生效，上年度可比期间自 2021 年 12 月 15 日至 2021 年 12 月 31 日。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4，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

#### 7.4 报表附注

##### 7.4.1 基金基本情况

华夏智胜先锋股票型证券投资基金（LOF）（以下简称“本基金”）已获中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2021]3192 号文《关于准予华夏智胜先锋股票型证券投资基金（LOF）注册的批复》，由华夏基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《华夏智胜先锋股票型证券投资基金（LOF）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。本基金自 2021 年 11 月 22 日至 2021 年 12 月 10 日共募集 427,963,517.83 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（2021）验字第 60739337\_A175 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华夏智胜先锋股票型证券投资基金（LOF）基金合同》于 2021 年 12 月 15 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 428,270,061.70 份基金份额，其中认购资金利息折合 306,543.87 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，基金托管人为华夏银行股份有限公司。

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，包括国内依法发行或上市的股票（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）、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、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）、衍生品（包括股指期货、国债期货、股票期权）、资产支持证券、货币市场工具（含同业存单）、债券回购、银行存款以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

本基金可根据相关法律法规和《基金合同》的约定，参与融资业务。

本基金的投资组合比例为：股票投资占基金资产的比例为 80%-95%；每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后保持不低于基金资产净值 5%的现金或

者到期日在一年以内的政府债券。其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

#### 7.4.2 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 7.4.4 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。

#### 7.4.3 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。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### I. 新金融工具准则(自 2022 年 1 月 1 日起适用)

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

###### 1、金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

###### (1) 债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成

本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益。基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资、资产支持证券投资 and 基金投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

## （2）权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

## 2、金融负债的分类

本基金的金融负债于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

## 3、衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

## II. 原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用)

### 1、金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金目前暂无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

### 2、金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债包括交易性金融负债及衍生金融负债等。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

##### I. 新金融工具准则(自 2022 年 1 月 1 日起适用)

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，其公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益。

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益。

本基金对以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础，进行减值处理并确认损失准备。本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违



约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况。当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产。当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

## II. 原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用)

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利、债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及金融负债按照公允价值进行后续计量，应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

1、存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

2、当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

3、如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。对于曾经实施份额拆分或折算的基金，由于基金份额拆分或折算引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日或基金份额折算日根据拆分前或折算前的基金份额数及确定的拆分或折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。对于已开放转换业务的基金，上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/（累计亏损）。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

##### I. 新金融工具准则(自 2022 年 1 月 1 日起适用)

境内基金投资在持有期间应取得的现金红利于除息日确认为投资收益；境外基金投资在持有期间应取得的基金分红收益扣除基金交易所在地适用的预缴所得税后的净额确认为投资收益。境内股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益；境外股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除股票交易所在地适用的预缴所得税后的净额确认为投资收益。境内债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。境外债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在交易所在地适用的预缴所得税及由基金管理人缴纳的增值税

后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；处置时其公允价值与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的按直线法近似计算。

## II. 原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用)

境内基金投资在持有期间应取得的现金红利于除息日确认为投资收益；境外基金投资在持有期间应取得的基金分红收益扣除基金交易所在地适用的预缴所得税后的净额确认投资收益。境内股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益；境外股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除股票交易所在地适用的预缴所得税后的净额确认为投资收益。境内债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。境外债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在交易所在地适用的预缴所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率或票面利率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；处置时其公允价值与初始确认金额之间的差额扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的按直线法近似计算。

### 7.4.4.10 费用的确认和计量

针对基金合同约定费率和计算方法的费用，本基金在费用涵盖期间按合同约定进行确认。

其他以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的按直线法近似计算。

### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

同一类别内的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，其中场外基金份额

持有人可选择现金红利或将现金红利按分红权益再投资日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资，场内基金份额持有人只能选择现金分红。期末可供分配利润指期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

由于本基金各基金份额类别在费用收取上不同，其对应的可分配收益可能有所不同。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

#### 7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

1、对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

2、对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6 号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》进行估值。

3、对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场交易的固定收益品种，按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

根据《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》、《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（统称“新金融工具准则”）、《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》、《关于印发《资产管理产品相关会计处理规定》的通知》(财会[2022]14 号)的规定和相关法律法规的要求，本基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。根据衔接规定，对可比期间信息不予调整， 首日执行新

金融工具准则的累积影响数调整本报告期期初未分配利润。

新金融工具准则改变了金融资产的分类和计量方式，将金融工具分类为以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。本基金考虑自身业务模式，以及金融资产的合同现金流特征进行上述分类。于 2021 年 12 月 31 日及 2022 年 1 月 1 日，本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

新金融工具准则要求对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于 2021 年 12 月 31 日，银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、交易性金融资产、卖出回购金融资产款等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”或“应付利息”科目中。于 2022 年 1 月 1 日，根据新金融工具准则下的计量类别，将上述应计利息分别转入银行存款、结算备付金、存出保证金、交易性金融资产、买入返售金融资产、卖出回购金融资产款等科目项下列示，同时以摊余成本法计量的金融资产按照预期信用损失为基准，计提损失准备 0.00 元，对本基金期初未分配利润无影响。

于 2022 年 1 月 1 日，本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下：

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、买入返售金融资产和应收利息，金额分别为 30,318,635.67 元、34,100,170.50 元和 6,725.72 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、买入返售金融资产和其他资产-应收利息，金额分别为 30,340,547.86 元、34,084,984.03 元和 0.00 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 370,223,373.42 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 370,223,373.42 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付管理人报酬、应付托管费和应付销售服务费，金额分别为 187,899.43 元、37,579.88 元和 28,468.08 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付管理人报酬、应付托管费和应付销售服务费，金额分别为 187,899.43 元、37,579.88 元和 28,468.08 元。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

#### 7.4.5.3 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。

#### 7.4.6 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。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
活期存款	2,010,955.93	4,295,893.24
等于：本金	2,010,498.91	4,295,893.24
加：应计利息	457.02	-
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	24,115,636.24	26,022,742.43
等于：本金	24,113,515.01	26,022,742.43
加：应计利息	2,121.23	-
合计	26,126,592.17	30,318,635.67

注：其他存款为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2022 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		397,108,098.84	-	390,069,340.02	-7,038,758.82
贵金属投资- 金交所黄金 合约		-	-	-	-
债券	交 易 所 市 场	369,100.00	40.77	369,140.77	-
	银 行 间 市 场	-	-	-	-
	合计	369,100.00	40.77	369,140.77	-
资产支持证 券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		397,477,198.84	40.77	390,438,480.79	-7,038,758.82
项目		上年度末 2021 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		364,004,111.10	-	370,223,373.42	6,219,262.32
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		364,004,111.10	-	370,223,373.42	6,219,262.32

## 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

## 7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 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	13,157,926.67	-	-	-
其中：股指期货	13,157,926.67	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	13,157,926.67	-	-	-
项目	上年度末 2021 年 12 月 31 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	-	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-	-	-	-

## 7.4.7.3.2 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
IC2306	中证 500 期货 IC2306 合约	6.00	6,971,280.00	-297,680.00
IC2303	中证 500 期货 IC2303 合约	5.00	5,874,400.00	-14,566.67
合计	-	-	-	-312,246.67
减：可抵销期货 暂收款	-	-	-	-312,246.67
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。

## 7.4.7.4 买入返售金融资产

## 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
合计	-	-
项目	上年度末 2021 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	34,100,170.50	-
银行间市场	-	-
合计	34,100,170.50	-

## 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

#### 7.4.7.5 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
应收利息	-	6,725.72
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
合计	-	6,725.72

#### 7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	87.69	-
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	-	-
其中：交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	180,000.00	-
合计	180,087.69	-

#### 7.4.7.7 实收基金

华夏智胜先锋股票（LOF）A

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	266,047,009.99	266,047,009.99
本期申购	68,985,525.29	68,985,525.29
本期赎回（以“-”号填列）	-168,792,831.47	-168,792,831.47
本期末	166,239,703.81	166,239,703.81

华夏智胜先锋股票 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	162,223,051.71	162,223,051.71
本期申购	292,421,692.71	292,421,692.71
本期赎回（以“-”号填列）	-198,987,430.91	-198,987,430.91
本期末	255,657,313.51	255,657,313.51

#### 7.4.7.8 未分配利润

##### 华夏智胜先锋股票（LOF）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	-40,936.18	3,863,709.17	3,822,772.99
本期利润	-1,428,431.68	-9,039,045.21	-10,467,476.89
本期基金份额交易产生的变动数	3,823,245.54	4,675,133.55	8,498,379.09
其中：基金申购款	622,612.72	-440,083.92	182,528.80
基金赎回款	3,200,632.82	5,115,217.47	8,315,850.29
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,353,877.68	-500,202.49	1,853,675.19

##### 华夏智胜先锋股票 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	-53,429.92	2,355,553.15	2,302,123.23
本期利润	-2,020,180.87	-4,531,222.60	-6,551,403.47
本期基金份额交易产生的变动数	4,634,846.84	1,394,780.14	6,029,626.98
其中：基金申购款	3,674,406.74	972,911.60	4,647,318.34
基金赎回款	960,440.10	421,868.54	1,382,308.64
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,561,236.05	-780,889.31	1,780,346.74

#### 7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 12 月 15 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	16,966.50	36,674.30
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	51,096.50	11,069.43
结算备付金利息收入	6,820.13	-
其他	181.07	-
合计	75,064.20	47,743.73

注：其他存款利息收入为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金产生的利息收入。

#### 7.4.7.10 股票投资收益

##### 7.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 12 月 15 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
股票投资收益——买卖股票差	-4,405,139.98	154,271.18

价收入		
股票投资收益——赎回差价收入	-	-
股票投资收益——申购差价收入	-	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-	-
合计	-4,405,139.98	154,271.18

## 7.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 12 月 15 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	2,529,940,767.31	3,489,011.67
减：卖出股票成本总额	2,530,206,441.34	3,334,740.49
减：交易费用	4,139,465.95	-
买卖股票差价收入	-4,405,139.98	154,271.18

## 7.4.7.11 债券投资收益

## 7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年12月15日（基金合同生效日）至2021年12月31日
债券投资收益——利息收入	220.76	-
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	136,127.62	-
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	136,348.38	-

## 7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年12月15日（基金合同生效日）至2021年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	904,246.17	-
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	767,600.00	-
减：应计利息总额	186.22	-
减：交易费用	332.33	-
买卖债券差价收入	136,127.62	-

## 7.4.7.12 资产支持证券投资收益

无。

#### 7.4.7.13 衍生工具收益

##### 7.4.7.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

##### 7.4.7.13.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间收益金额 2021年12月15日（基金合同生效日）至2021年12月31日
股指期货投资收益	96,365.67	-

#### 7.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年12月15日（基金合同生效日）至2021年12月31日
股票投资产生的股利收益	4,433,366.38	-
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	4,433,366.38	-

#### 7.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年12月15日（基金合同生效日）至2021年12月31日
1.交易性金融资产	-13,258,021.14	6,219,262.32
——股票投资	-13,258,021.14	6,219,262.32
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	-312,246.67	-
——权证投资	-	-
——期货投资	-312,246.67	-
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	-13,570,267.81	6,219,262.32

#### 7.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年12月15日（基金合同生效日）至2021年12月31日
基金赎回费收入	909,817.29	-
合计	909,817.29	-

#### 7.4.7.17 信用减值损失

无。

#### 7.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年12月15日（基金合同生效日）至2021年12月31日
审计费用	60,000.00	-
信息披露费	120,000.00	-
证券出借违约金	-	-
其他	400.00	119,061.48
合计	180,400.00	119,061.48

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无或有事项。

##### 7.4.8.2 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。

#### 7.4.9 关联方关系

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
华夏银行股份有限公司（“华夏银行”）	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
MACKENZIE FINANCIAL CORPORATION	基金管理人的股东
天津海鹏科技咨询有限公司	基金管理人的股东
POWER CORPORATION OF CANADA	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(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
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

注：①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%）。

②下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年12月31日		上年度可比期间 2021年12月15日（基金合同生效日）至2021年12月31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	5,074,473,548.14	100.00%	370,827,863.26	100.00%

##### 7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年12月31日		上年度可比期间 2021年12月15日（基金合同生效日）至2021年12月31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	904,246.17	100.00%	-	-

##### 7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年12月31日		上年度可比期间 2021年12月15日（基金合同生效日）至2021年12月31日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
中信证券	676,100,000.00	100.00%	722,200,000.00	100.00%

##### 7.4.10.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年12月31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	1,147,295.62	100.00%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2021年12月15日（基金合同生效日）至2021年12月31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	-	-	-	-

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。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年12月15日（基金合同生效日）至2021年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	3,352,651.19	187,899.43
其中：支付销售机构的客户维护费	1,194,143.66	64,083.09

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。

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年12月15日（基金合同生效日）至2021年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	670,530.24	37,579.88

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。

##### 7.4.10.2.3 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 2022年1月1日至2022年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华夏智胜先锋股票（LOF）A	华夏智胜先锋股票 C	合计



中信 证券 （华 南）	-	252,386.42	252,386.42
中信 证券	-	193,291.74	193,291.74
华夏 基金 管理 有限 公司	-	5,764.84	5,764.84
华夏 财富	-	5,120.42	5,120.42
华夏 银行	-	2,752.89	2,752.89
中信 证券 （山 东）	-	586.25	586.25
合计	-	459,902.56	459,902.56
获得 销售 服务 费的 各关 联方 名称	上年度可比期间 2021年12月15日（基金合同生效日）至2021年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华夏智胜先锋股票 （LOF）A	华夏智胜先锋股票 C	合计
中信 证券 （华 南）	-	14,733.19	14,733.19
中信 证券	-	8,460.12	8,460.12
华夏 银行	-	116.94	116.94
华夏 基金 管理 有限 公司	-	70.45	70.45
中信 证券 （山 东）	-	46.62	46.62
合计	-	23,427.32	23,427.32

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 0.40%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：C 类日基金销售服务费 = 前一日 C 类基金资产净值 × 0.40% / 当年天数。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

#### 7.4.10.4 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

##### 7.4.10.4.1 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。

##### 7.4.10.4.2 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。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

##### 7.4.10.5.2 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。

#### 7.4.10.6 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 2022年1月1日至2022年12月31日		上年度可比期间 2021年12月15日（基金合同生效日）至2021年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
华夏银行活期存款	2,010,955.93	16,966.50	4,295,893.24	36,674.30
中信证券（华南）券商存款	24,115,636.24	51,096.50	26,022,742.43	11,069.43

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

中信证券（华南）存款为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金，按银行同业利率或约定利率计息。

#### 7.4.10.7 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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 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	600938	中国海油	新股发行	120,005	1,296,054.00
中信证券	688302	海创药业	新股发行	8,431	361,858.52
中信证券	688382	益方生物	新股发行	12,179	220,683.48
中信证券	688326	经纬恒润	新股发行	1,442	174,482.00
中信证券	688141	杰华特	新股发行	4,475	171,213.50
中信证券	301109	军信股份	新股发行	4,471	155,635.51
中信证券	688380	中微半导	新股发行	4,725	145,813.50
中信证券	301302	华如科技	新股发行	2,801	145,736.03
中信证券	301335	天元宠物	新股发行	2,907	145,291.86
中信证券	301377	鼎泰高科	新股发行	5,387	123,254.56
中信证券	301165	锐捷网络	新股发行	3,790	122,720.20
中信证券	688426	康为世纪	新股发行	2,481	121,519.38
中信证券	688061	灿瑞科技	新股发行	1,059	119,338.71
中信证券	688432	有研硅	新股发行	10,864	107,662.24
中信证券	301269	华大九天	新股发行	3,254	106,373.26
中信证券	688290	景业智能	新股发行	3,040	103,025.60
中信证券	301230	泓博医药	新股发行	2,463	98,520.00
中信证券	688114	华大智造	新股发行	1,108	96,595.44
中信证券	688370	从麟科技	新股发行	1,586	94,779.36
中信证券	688252	天德钰	新股发行	4,198	91,012.64
中信证券	301349	信德新材	新股发行	621	86,244.48
中信证券	301171	易点天下	新股发行	4,364	79,337.52
中信证券	688525	佰维存储	新股发行	4,614	64,549.86
中信证券	603235	天新药业	新股发行	572	21,095.36
中信证券	001330	博纳影业	新股发行	3,564	17,926.92
中信证券	001322	箭牌家居	新股发行	1,175	14,899.00
中信证券	001339	智微智能	新股发行	812	13,690.32
中信证券	603191	望变电气	新股发行	1,149	13,627.14
中信证券	603151	邦基科技	新股发行	535	9,603.25
中信证券	603051	鹿山新材	新股发行	272	7,014.88
上年度可比期间 2021 年 12 月 15 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 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	-	-	-	-	-

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

##### 7.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配事项。

#### 7.4.12 期末（2022 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 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

## 7.4.12.1.1 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(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688428	诺诚健华	2022-09-14	6 个月	新发流通受限	11.03	12.83	35,491	391,465.73	455,349.53	-
688031	星环科技	2022-10-11	6 个月	新发流通受限	47.34	78.80	3,307	156,553.38	260,591.60	-
688506	百利天恒	2022-12-28	1 个月内(含)	新发流通受限	24.70	24.70	9,150	226,005.00	226,005.00	-
688380	中微半导	2022-07-29	6 个月	新发流通受限	30.86	26.44	4,725	145,813.50	124,929.00	-
688184	帕瓦股份	2022-09-09	6 个月	新发流通受限	51.88	33.82	2,156	111,853.28	72,915.92	-
301269	华大九天	2022-07-21	6 个月	新发流通受限	32.69	87.94	326	10,656.94	28,668.44	-
301267	华夏眼科	2022-10-26	6 个月	新发流通受限	50.88	66.20	234	11,905.92	15,490.80	-
301308	江波龙	2022-07-27	6 个月	新发流通受限	55.67	56.72	271	15,086.57	15,371.12	-
301338	凯格精机	2022-08-08	6 个月	新发流通受限	46.33	48.99	253	11,721.49	12,394.47	-
301165	锐捷网络	2022-11-14	6 个月	新发流通受限	32.38	31.61	379	12,272.02	11,980.19	-
301230	泓博医药	2022-10-21	6 个月	新发流通受限	40.00	48.32	247	9,880.00	11,935.04	-
301396	宏景科技	2022-11-04	6 个月	新发流通受限	40.13	31.90	370	14,848.10	11,803.00	-
301391	卡莱特	2022-11-24	6 个月	新发流通受限	96.00	80.97	144	13,824.00	11,659.68	-
301277	新天地	2022-11-09	6 个月	新发流通受限	27.00	25.78	439	11,853.00	11,317.42	-
301152	天力锂能	2022-08-19	6 个月	新发流通受限	57.00	46.64	226	12,882.00	10,540.64	-
301273	瑞晨	2022-	6 个月	新发	37.89	37.79	277	10,495.53	10,467.83	-

	环保	10-11		流通受限						
301335	天元宠物	2022-11-11	6 个月	新发流通受限	49.98	33.82	291	14,544.18	9,841.62	-
301363	美好医疗	2022-09-28	6 个月	新发流通受限	30.66	37.85	259	7,940.94	9,803.15	-
301121	紫建电子	2022-08-01	6 个月	新发流通受限	61.07	49.77	193	11,786.51	9,605.61	-
301377	鼎泰高科	2022-11-11	6 个月	新发流通受限	22.88	17.63	539	12,332.32	9,502.57	-
301328	维峰电子	2022-08-30	6 个月	新发流通受限	78.80	76.96	122	9,613.60	9,389.12	-
301265	华新环保	2022-12-08	6 个月	新发流通受限	13.28	11.40	819	10,876.32	9,336.60	-
301139	元道通信	2022-06-30	6 个月	新发流通受限	38.46	25.31	362	13,922.52	9,162.22	-
301306	西测测试	2022-07-19	6 个月	新发流通受限	43.23	42.29	197	8,516.31	8,331.13	-
301326	捷邦科技	2022-09-09	6 个月	新发流通受限	51.72	36.62	227	11,740.44	8,312.74	-
301176	逸豪新材	2022-09-21	6 个月	新发流通受限	23.88	16.89	460	10,984.80	7,769.40	-
301171	易点天下	2022-08-10	6 个月	新发流通受限	18.18	17.72	437	7,944.66	7,743.64	-
301366	一博科技	2022-09-19	6 个月	新发流通受限	65.35	45.09	171	11,174.85	7,710.39	-
301398	星源卓镁	2022-12-08	6 个月	新发流通受限	34.40	28.94	255	8,772.00	7,379.70	-
301313	凡拓数创	2022-09-22	6 个月	新发流通受限	25.25	29.14	247	6,236.75	7,197.58	-
301349	信德新材	2022-08-30	6 个月	新发流通受限	138.88	103.52	63	8,749.44	6,521.76	-
301388	欣灵电气	2022-10-26	6 个月	新发流通受限	25.88	21.60	292	7,556.96	6,307.20	-
301368	丰立	2022-	6 个月	新发	22.33	18.52	337	7,525.21	6,241.24	-

	智能	12-07		流通受限						
301319	唯特偶	2022-09-22	6 个月	新发流通受限	47.75	53.27	115	5,491.25	6,126.05	-
301270	汉仪股份	2022-08-19	6 个月	新发流通受限	25.68	28.37	210	5,392.80	5,957.70	-
301318	维海德	2022-08-03	6 个月	新发流通受限	64.68	41.74	130	8,408.40	5,426.20	-
301276	嘉曼服饰	2022-09-01	6 个月	新发流通受限	40.66	22.61	239	9,717.74	5,403.79	-
301316	慧博云通	2022-09-29	6 个月	新发流通受限	7.60	14.32	359	2,728.40	5,140.88	-
301309	万得凯	2022-09-08	6 个月	新发流通受限	39.00	24.46	178	6,942.00	4,353.88	-
7.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
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(单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
127078	优彩转债	2022-12-14	1 个月内（含）	新发流通受限	100.00	100.02	1,461	146,100.00	146,123.06	期末估值单价为含息价格
110091	合力转债	2022-12-13	1 个月内（含）	新发流通受限	100.00	100.01	1,240	124,000.00	124,010.33	期末估值单价为含息价格
118029	富淼转债	2022-12-15	1 个月内（含）	新发流通受限	100.00	100.01	990	99,000.00	99,007.38	期末估值

										单 价 为 含 息 价 格
--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	---------------------------------

注：①本基金通过大宗交易方式受让的原上市公司大股东减持或者特定股东减持的股份，在受让后 6 个月内，不得转让所受让的股份。本基金所认购非公开发行股份，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股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期为自发行人股票上市之日起 6 个月。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根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于 6 个月的限售期。

⑤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。

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 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。

#### 7.4.13.2 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。

#### 7.4.13.3 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“7.4.12 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。

##### 7.4.13.3.1 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。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 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。

##### 7.4.13.4.2 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。

##### 7.4.13.4.3 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。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日		上年度末 2021 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	390,069,340.02	91.67	370,223,373.42	85.23
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	369,140.77	0.09	-	-
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	390,438,480.79	91.75	370,223,373.42	85.23

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。

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中证 500 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 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
	-5%	-18,862,086.71	-17,328,574.44
	+5%	18,862,086.71	17,328,574.44

#### 7.4.14 公允价值

##### 7.4.14.1 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。

##### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

##### 7.4.14.2.1 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 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	388,605,356.17	370,223,373.42
第二层次	595,145.77	-
第三层次	1,237,978.85	-
合计	390,438,480.79	370,223,373.42

##### 7.4.14.2.2 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。

##### 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

##### 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	1,150,009.86	1,150,009.86
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	87,968.99	87,968.99
其中：计入损益的利得或损失	-	87,968.99	87,968.99
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	1,237,978.85	1,237,978.85
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	87,968.99	87,968.99

#### 7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	1,237,978.85	平均价格亚式期权模型	预期年化波动率	0.1891-2.4756	负相关

#### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

截至 2022 年 12 月 31 日止，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

#### 7.4.14.4 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。

#### 7.4.15 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。

## §8 投资组合报告

### 8.1 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	390,069,340.02	91.30
	其中：股票	390,069,340.02	91.30
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	369,140.77	0.09
	其中：债券	369,140.77	0.09
	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	27,622,157.07	6.47
8	其他各项资产	9,187,168.70	2.15
9	合计	427,247,806.56	100.00

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 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	2,475,605.00	0.58
B	采矿业	14,138,557.40	3.32
C	制造业	249,292,746.76	58.58
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,514,253.00	1.30
E	建筑业	9,879,232.00	2.32
F	批发和零售业	16,261,431.80	3.82
G	交通运输、仓储和邮政业	19,609,363.84	4.61
H	住宿和餐饮业	29,175.00	0.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	19,133,547.66	4.50
J	金融业	35,842,995.59	8.42
K	房地产业	4,142,233.00	0.97
L	租赁和商务服务业	3,904,256.00	0.92
M	科学研究和技术服务业	1,162,942.17	0.27
N	水利、环境和公共设施管理业	2,260,093.00	0.53
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	293,208.00	0.07
Q	卫生和社会工作	15,490.80	0.00
R	文化、体育和娱乐业	6,114,209.00	1.44
S	综合	-	-
	合计	390,069,340.02	91.67

### 8.3 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	601231	环旭电子	268,900	4,364,247.00	1.03
2	300910	瑞丰新材	34,200	4,217,202.00	0.99

3	600548	深高速	388,400	3,487,832.00	0.82
4	002594	比亚迪	13,400	3,443,398.00	0.81
5	600919	江苏银行	467,300	3,406,617.00	0.80
6	600697	欧亚集团	241,400	3,374,772.00	0.79
7	300724	捷佳伟创	28,700	3,272,374.00	0.77
8	600028	中国石化	725,800	3,164,488.00	0.74
9	688336	三生国健	247,629	3,144,888.30	0.74
10	601288	农业银行	1,011,900	2,944,629.00	0.69
11	601318	中国平安	62,500	2,937,500.00	0.69
12	600626	申达股份	798,500	2,874,600.00	0.68
13	002384	东山精密	114,000	2,819,220.00	0.66
14	000913	钱江摩托	150,300	2,777,544.00	0.65
15	601518	吉林高速	910,200	2,648,682.00	0.62
16	600819	耀皮玻璃	570,600	2,636,172.00	0.62
17	688365	光云科技	331,467	2,618,589.30	0.62
18	601939	建设银行	463,753	2,610,929.39	0.61
19	688390	固德威	7,900	2,552,411.00	0.60
20	603527	众源新材	180,800	2,545,664.00	0.60
21	601012	隆基绿能	59,600	2,518,696.00	0.59
22	002963	豪尔赛	182,600	2,510,750.00	0.59
23	601128	常熟银行	328,500	2,480,175.00	0.58
24	002299	圣农发展	104,500	2,475,605.00	0.58
25	600519	贵州茅台	1,400	2,417,800.00	0.57
26	688655	迅捷兴	209,173	2,395,030.85	0.56
27	000596	古井贡酒	8,800	2,348,720.00	0.55
28	002422	科伦药业	88,200	2,347,002.00	0.55
29	002250	联化科技	148,700	2,304,850.00	0.54
30	000627	天茂集团	710,800	2,246,128.00	0.53
31	601988	中国银行	701,800	2,217,688.00	0.52
32	603682	锦和商管	404,900	2,190,509.00	0.51
33	601398	工商银行	484,700	2,103,598.00	0.49
34	688585	上纬新材	258,578	2,071,209.78	0.49
35	300684	中石科技	137,800	2,040,818.00	0.48
36	688618	三旺通信	25,200	2,013,480.00	0.47
37	603505	金石资源	50,720	2,009,526.40	0.47
38	688183	生益电子	214,316	1,995,281.96	0.47
39	603326	我乐家居	241,700	1,928,766.00	0.45
40	600685	中船防务	92,500	1,920,300.00	0.45
41	000858	五粮液	10,600	1,915,314.00	0.45
42	600012	皖通高速	261,200	1,909,372.00	0.45
43	688520	神州细胞	31,500	1,908,900.00	0.45
44	603939	益丰药房	29,900	1,908,816.00	0.45
45	601857	中国石油	383,100	1,904,007.00	0.45
46	600422	昆药集团	134,100	1,893,492.00	0.44
47	603867	新化股份	58,400	1,886,320.00	0.44
48	603890	春秋电子	205,400	1,877,356.00	0.44
49	603822	嘉澳环保	54,800	1,875,256.00	0.44
50	603421	鼎信通讯	224,000	1,874,880.00	0.44
51	600761	安徽合力	142,200	1,869,930.00	0.44
52	300101	振芯科技	74,500	1,825,250.00	0.43

53	605218	伟时电子	132,000	1,821,600.00	0.43
54	601628	中国人寿	49,000	1,818,880.00	0.43
55	688505	复旦张江	214,500	1,791,075.00	0.42
56	688098	申联生物	224,800	1,784,912.00	0.42
57	600600	青岛啤酒	16,600	1,784,500.00	0.42
58	603711	香飘飘	118,600	1,783,744.00	0.42
59	603699	纽威股份	159,200	1,767,120.00	0.42
60	601006	大秦铁路	263,000	1,756,840.00	0.41
61	688122	西部超导	18,500	1,751,765.00	0.41
62	000553	安道麦 A	193,089	1,747,455.45	0.41
63	002254	泰和新材	81,900	1,737,099.00	0.41
64	600901	江苏金租	314,800	1,725,104.00	0.41
65	300776	帝尔激光	13,600	1,713,600.00	0.40
66	688063	派能科技	5,400	1,704,510.00	0.40
67	002996	顺博合金	130,100	1,695,203.00	0.40
68	600054	黄山旅游	132,300	1,685,502.00	0.40
69	688359	三孚新科	24,900	1,680,501.00	0.39
70	000417	合肥百货	307,800	1,677,510.00	0.39
71	603511	爱慕股份	107,000	1,670,270.00	0.39
72	000729	燕京啤酒	156,800	1,665,216.00	0.39
73	601298	青岛港	296,000	1,660,560.00	0.39
74	002737	葵花药业	71,500	1,657,370.00	0.39
75	601668	中国建筑	304,200	1,651,806.00	0.39
76	002675	东诚药业	99,000	1,639,440.00	0.39
77	688096	京源环保	135,472	1,635,147.04	0.38
78	000690	宝新能源	251,400	1,634,100.00	0.38
79	600377	宁沪高速	197,022	1,619,520.84	0.38
80	601328	交通银行	341,600	1,619,184.00	0.38
81	603828	柯利达	488,700	1,578,501.00	0.37
82	002129	TCL 中环	41,300	1,555,358.00	0.37
83	300487	蓝晓科技	21,950	1,527,500.50	0.36
84	301088	戎美股份	88,100	1,526,773.00	0.36
85	601900	南方传媒	181,200	1,505,772.00	0.35
86	600438	通威股份	38,900	1,500,762.00	0.35
87	603328	依顿电子	230,500	1,495,945.00	0.35
88	688097	博众精工	52,000	1,487,200.00	0.35
89	301086	鸿富瀚	26,000	1,485,380.00	0.35
90	605365	立达信	92,200	1,482,576.00	0.35
91	000878	云南铜业	125,900	1,479,325.00	0.35
92	688617	惠泰医疗	4,700	1,442,571.00	0.34
93	688070	纵横股份	33,700	1,424,499.00	0.33
94	002154	报喜鸟	341,800	1,408,216.00	0.33
95	601010	文峰股份	480,920	1,389,858.80	0.33
96	601567	三星医疗	102,500	1,381,700.00	0.32
97	601899	紫金矿业	138,100	1,381,000.00	0.32
98	603093	南华期货	150,200	1,368,322.00	0.32
99	600875	东方电气	65,000	1,366,300.00	0.32
100	605289	罗曼股份	63,300	1,352,088.00	0.32
101	000048	京基智农	74,800	1,335,180.00	0.31
102	002961	瑞达期货	99,800	1,330,334.00	0.31

103	688185	康希诺	9,100	1,328,782.00	0.31
104	688258	卓易信息	32,137	1,314,403.30	0.31
105	002937	兴瑞科技	57,700	1,306,905.00	0.31
106	000568	泸州老窖	5,700	1,278,396.00	0.30
107	600566	济川药业	46,900	1,276,618.00	0.30
108	600993	马应龙	55,900	1,263,340.00	0.30
109	688312	燕麦科技	80,977	1,255,953.27	0.30
110	688177	百奥泰	57,569	1,253,852.82	0.29
111	603221	爱丽家居	155,400	1,252,524.00	0.29
112	688389	普门科技	69,400	1,237,402.00	0.29
113	002929	润建股份	31,400	1,232,764.00	0.29
114	000012	南玻 A	183,300	1,229,943.00	0.29
115	601801	皖新传媒	235,700	1,227,997.00	0.29
116	600398	海澜之家	231,500	1,226,950.00	0.29
117	300916	朗特智能	28,300	1,216,900.00	0.29
118	002338	奥普光电	54,400	1,212,576.00	0.28
119	688516	奥特维	6,030	1,212,030.00	0.28
120	600768	宁波富邦	128,500	1,180,915.00	0.28
121	000708	中信特钢	68,300	1,172,028.00	0.28
122	600872	中炬高新	31,700	1,168,779.00	0.27
123	300125	聆达股份	58,700	1,164,608.00	0.27
124	603332	苏州龙杰	108,100	1,154,508.00	0.27
125	300114	中航电测	112,500	1,154,250.00	0.27
126	000088	盐田港	225,200	1,141,764.00	0.27
127	300528	幸福蓝海	135,700	1,141,237.00	0.27
128	688111	金山办公	4,300	1,137,307.00	0.27
129	300407	凯发电气	156,300	1,122,234.00	0.26
130	300274	阳光电源	9,900	1,106,820.00	0.26
131	300395	菲利华	20,000	1,100,000.00	0.26
132	002372	伟星新材	50,400	1,075,536.00	0.25
133	300952	恒辉安防	57,600	1,070,208.00	0.25
134	002839	张家港行	231,020	1,065,002.20	0.25
135	688366	昊海生科	10,900	1,063,186.00	0.25
136	300260	新莱应材	15,800	1,060,180.00	0.25
137	688180	君实生物	16,900	1,057,940.00	0.25
138	002966	苏州银行	135,700	1,055,746.00	0.25
139	688687	凯因科技	45,600	1,037,400.00	0.24
140	000655	金岭矿业	156,100	1,033,382.00	0.24
141	603233	大参林	26,000	1,029,600.00	0.24
142	002324	普利特	64,300	1,028,800.00	0.24
143	002705	新宝股份	61,700	1,027,305.00	0.24
144	002608	江苏国信	172,100	1,025,716.00	0.24
145	601886	江河集团	130,700	1,011,618.00	0.24
146	002988	豪美新材	75,000	1,001,250.00	0.24
147	600255	鑫科材料	384,500	992,010.00	0.23
148	601998	中信银行	197,500	983,550.00	0.23
149	000517	荣安地产	330,000	973,500.00	0.23
150	000543	皖能电力	216,000	967,680.00	0.23
151	600662	外服控股	162,000	967,140.00	0.23
152	300115	长盈精密	91,700	947,261.00	0.22

153	688045	必易微	17,200	940,840.00	0.22
154	688207	格灵深瞳	40,800	938,400.00	0.22
155	300337	银邦股份	120,900	938,184.00	0.22
156	600386	北巴传媒	236,200	937,714.00	0.22
157	688148	芳源股份	64,200	936,678.00	0.22
158	688777	中控技术	10,200	926,466.00	0.22
159	300041	回天新材	56,600	923,712.00	0.22
160	603861	白云电器	122,400	914,328.00	0.21
161	300009	安科生物	97,100	908,856.00	0.21
162	605086	龙高股份	47,200	907,184.00	0.21
163	300384	三联虹普	58,700	892,827.00	0.21
164	601888	中国中免	4,100	885,723.00	0.21
165	603790	雅运股份	88,000	880,880.00	0.21
166	002653	海思科	39,500	878,875.00	0.21
167	002785	万里石	29,100	878,238.00	0.21
168	300810	中科海讯	50,400	872,928.00	0.21
169	002318	久立特材	51,995	865,196.80	0.20
170	002152	广电运通	84,800	842,912.00	0.20
171	002718	友邦吊顶	62,000	840,100.00	0.20
172	300092	科新机电	62,900	839,715.00	0.20
173	003033	征和工业	18,800	834,720.00	0.20
174	605318	法狮龙	59,800	822,250.00	0.19
175	601595	上海电影	74,700	819,459.00	0.19
176	002080	中材科技	38,000	814,340.00	0.19
177	000651	格力电器	24,700	798,304.00	0.19
178	600936	广西广电	219,600	794,952.00	0.19
179	600435	北方导航	68,200	791,120.00	0.19
180	688596	正帆科技	22,700	770,665.00	0.18
181	600488	津药药业	174,500	769,545.00	0.18
182	600845	宝信软件	17,100	766,080.00	0.18
183	300616	尚品宅配	38,700	760,068.00	0.18
184	600060	海信视像	56,100	759,594.00	0.18
185	002262	恩华药业	30,900	758,595.00	0.18
186	600348	华阳股份	53,200	758,100.00	0.18
187	600563	法拉电子	4,700	751,436.00	0.18
188	600250	南纺股份	128,700	750,321.00	0.18
189	600981	汇鸿集团	258,700	747,643.00	0.18
190	002158	汉钟精机	31,000	742,450.00	0.17
191	688127	蓝特光学	46,303	737,606.79	0.17
192	688358	祥生医疗	21,400	736,160.00	0.17
193	002918	蒙娜丽莎	40,600	729,988.00	0.17
194	688037	芯源微	4,600	719,900.00	0.17
195	688282	理工导航	15,400	703,010.00	0.17
196	002632	道明光学	110,000	701,800.00	0.16
197	603408	建霖家居	64,600	701,556.00	0.16
198	688320	禾川科技	14,900	697,320.00	0.16
199	600846	同济科技	77,100	693,129.00	0.16
200	002540	亚太科技	134,900	683,943.00	0.16
201	002004	华邦健康	133,300	679,830.00	0.16
202	601598	中国外运	177,000	679,680.00	0.16



203	601138	工业富联	73,900	678,402.00	0.16
204	000089	深圳机场	85,700	673,602.00	0.16
205	300839	博汇股份	36,300	673,365.00	0.16
206	688501	青达环保	25,900	669,515.00	0.16
207	600708	光明地产	270,500	665,430.00	0.16
208	605117	德业股份	2,000	662,400.00	0.16
209	300405	科隆股份	122,776	656,851.60	0.15
210	300532	今天国际	44,900	650,152.00	0.15
211	300481	濮阳惠成	24,200	646,866.00	0.15
212	000002	万科 A	35,100	638,820.00	0.15
213	688586	江航装备	38,860	633,418.00	0.15
214	300059	东方财富	32,500	630,500.00	0.15
215	688107	安路科技	9,800	629,160.00	0.15
216	002986	宇新股份	28,900	628,286.00	0.15
217	301302	华如科技	9,700	621,091.00	0.15
218	688700	东威科技	4,300	615,545.00	0.14
219	600210	紫江企业	121,900	609,500.00	0.14
220	002724	海洋王	74,400	601,152.00	0.14
221	300357	我武生物	10,900	600,590.00	0.14
222	000900	现代投资	143,500	599,830.00	0.14
223	001203	大中矿业	46,100	596,073.00	0.14
224	600469	风神股份	126,300	592,347.00	0.14
225	300930	屹通新材	24,500	590,940.00	0.14
226	300750	宁德时代	1,500	590,130.00	0.14
227	000601	韶能股份	125,400	589,380.00	0.14
228	002810	山东赫达	26,200	587,404.00	0.14
229	601966	玲珑轮胎	28,100	575,488.00	0.14
230	688166	博瑞医药	25,000	564,250.00	0.13
231	300686	智动力	46,900	562,800.00	0.13
232	300570	太辰光	38,000	549,480.00	0.13
233	300385	雪浪环境	93,258	549,289.62	0.13
234	600337	美克家居	192,900	543,978.00	0.13
235	601163	三角轮胎	44,300	540,903.00	0.13
236	688112	鼎阳科技	5,800	540,850.00	0.13
237	300277	海联讯	81,500	539,530.00	0.13
238	605088	冠盛股份	31,400	539,452.00	0.13
239	600830	香溢融通	84,900	534,870.00	0.13
240	002401	中远海科	48,000	528,000.00	0.12
241	688006	杭可科技	12,000	525,240.00	0.12
242	600732	爱旭股份	13,700	518,134.00	0.12
243	600665	天地源	139,500	514,755.00	0.12
244	605180	华生科技	32,700	510,447.00	0.12
245	300034	钢研高纳	11,100	508,824.00	0.12
246	603321	梅轮电梯	73,700	505,582.00	0.12
247	601808	中海油服	29,700	492,426.00	0.12
248	000712	锦龙股份	37,200	481,368.00	0.11
249	003016	欣贺股份	52,100	478,278.00	0.11
250	600073	上海梅林	59,800	475,410.00	0.11
251	601689	拓普集团	8,100	474,498.00	0.11
252	000761	本钢板材	159,400	470,230.00	0.11

253	600928	西安银行	133,300	469,216.00	0.11
254	603013	亚普股份	32,690	468,447.70	0.11
255	600743	华远地产	247,400	467,586.00	0.11
256	300873	海晨股份	17,000	461,550.00	0.11
257	688428	诺诚健华	35,491	455,349.53	0.11
258	688625	呈和科技	9,300	454,956.00	0.11
259	601019	山东出版	72,400	454,672.00	0.11
260	002088	鲁阳节能	19,400	448,528.00	0.11
261	000598	兴蓉环境	91,100	445,479.00	0.10
262	603658	安图生物	7,200	445,320.00	0.10
263	002391	长青股份	62,800	441,484.00	0.10
264	605009	豪悦护理	8,500	440,895.00	0.10
265	600583	海油工程	72,600	439,956.00	0.10
266	300219	鸿利智汇	65,700	438,876.00	0.10
267	603813	原尚股份	30,000	435,600.00	0.10
268	000963	华东医药	9,300	435,240.00	0.10
269	603179	新泉股份	11,300	434,937.00	0.10
270	300146	汤臣倍健	19,000	433,580.00	0.10
271	688733	壹石通	11,500	433,205.00	0.10
272	688290	景业智能	6,000	432,480.00	0.10
273	603116	红蜻蜓	84,300	431,616.00	0.10
274	600491	龙元建设	68,600	431,494.00	0.10
275	002032	苏泊尔	8,700	430,302.00	0.10
276	600160	巨化股份	27,500	426,525.00	0.10
277	300705	九典制药	17,500	425,250.00	0.10
278	601800	中国交建	52,500	422,625.00	0.10
279	000501	武商集团	37,700	422,240.00	0.10
280	002851	麦格米特	16,200	420,552.00	0.10
281	002495	佳隆股份	138,600	419,958.00	0.10
282	600019	宝钢股份	74,800	418,132.00	0.10
283	688711	宏微科技	4,500	417,600.00	0.10
284	002787	华源控股	69,200	417,276.00	0.10
285	603600	永艺股份	42,700	416,325.00	0.10
286	688071	华依科技	7,300	412,523.00	0.10
287	002392	北京利尔	116,800	407,632.00	0.10
288	301181	标榜股份	11,300	404,088.00	0.09
289	300847	中船汉光	25,500	402,900.00	0.09
290	000686	东北证券	61,900	402,350.00	0.09
291	600642	申能股份	72,900	400,221.00	0.09
292	002955	鸿合科技	16,900	397,995.00	0.09
293	600966	博汇纸业	44,600	396,494.00	0.09
294	688718	唯赛勃	19,900	396,209.00	0.09
295	300033	同花顺	4,000	394,440.00	0.09
296	300133	华策影视	74,000	394,420.00	0.09
297	603353	和顺石油	21,100	392,038.00	0.09
298	000617	中油资本	70,200	391,014.00	0.09
299	601728	中国电信	93,300	390,927.00	0.09
300	300014	亿纬锂能	4,400	386,760.00	0.09
301	600089	特变电工	19,200	385,536.00	0.09
302	300074	华平股份	102,400	384,000.00	0.09

303	601898	中煤能源	44,400	382,728.00	0.09
304	002287	奇正藏药	16,600	379,310.00	0.09
305	600180	瑞茂通	66,200	374,692.00	0.09
306	000915	华特达因	8,200	373,100.00	0.09
307	688350	富淼科技	22,200	364,968.00	0.09
308	600188	兖矿能源	10,600	355,948.00	0.08
309	601588	北辰实业	174,000	354,960.00	0.08
310	300504	天邑股份	22,000	353,100.00	0.08
311	603876	鼎胜新材	8,600	352,944.00	0.08
312	301106	骏成科技	12,800	347,648.00	0.08
313	601021	春秋航空	5,400	346,950.00	0.08
314	603398	沐邦高科	12,300	346,368.00	0.08
315	688300	联瑞新材	7,100	345,628.00	0.08
316	688678	福立旺	18,000	345,420.00	0.08
317	603725	天安新材	49,100	339,281.00	0.08
318	300717	华信新材	24,031	336,434.00	0.08
319	688085	三友医疗	12,000	333,000.00	0.08
320	605118	力鼎光电	26,500	331,250.00	0.08
321	300751	迈为股份	800	329,472.00	0.08
322	002050	三花智控	15,500	328,910.00	0.08
323	300824	北鼎股份	36,800	327,520.00	0.08
324	300762	上海瀚讯	24,500	322,910.00	0.08
325	603818	曲美家居	50,700	319,410.00	0.08
326	600562	国睿科技	18,400	311,880.00	0.07
327	688819	天能股份	8,449	310,416.26	0.07
328	688175	高凌信息	8,760	307,563.60	0.07
329	600551	时代出版	29,600	301,328.00	0.07
330	300365	恒华科技	39,400	299,834.00	0.07
331	000898	鞍钢股份	112,000	299,040.00	0.07
332	603377	东方时尚	45,600	293,208.00	0.07
333	601975	招商南油	74,300	292,742.00	0.07
334	300298	三诺生物	8,600	290,078.00	0.07
335	605177	东亚药业	14,300	286,286.00	0.07
336	600638	新黄浦	50,200	283,630.00	0.07
337	688778	厦钨新能	3,600	279,648.00	0.07
338	603568	伟明环保	14,900	276,097.00	0.06
339	600784	鲁银投资	44,600	270,276.00	0.06
340	603678	火炬电子	6,600	270,204.00	0.06
341	603585	苏利股份	15,200	269,496.00	0.06
342	601333	广深铁路	118,700	269,449.00	0.06
343	603681	永冠新材	12,600	269,388.00	0.06
344	600521	华海药业	12,000	262,320.00	0.06
345	300912	凯龙高科	19,400	262,094.00	0.06
346	002674	兴业科技	24,200	261,602.00	0.06
347	688031	星环科技	3,307	260,591.60	0.06
348	002446	盛路通信	27,100	259,076.00	0.06
349	000750	国海证券	76,400	254,412.00	0.06
350	002807	江阴银行	63,300	251,301.00	0.06
351	600125	铁龙物流	45,700	249,522.00	0.06
352	000060	中金岭南	60,700	248,870.00	0.06

353	600917	重庆燃气	31,100	247,556.00	0.06
354	600409	三友化工	37,200	245,892.00	0.06
355	600748	上实发展	70,800	243,552.00	0.06
356	002068	黑猫股份	20,200	241,794.00	0.06
357	601088	中国神华	8,700	240,294.00	0.06
358	000400	许继电气	12,000	239,640.00	0.06
359	688072	拓荆科技	1,100	238,425.00	0.06
360	603138	海量数据	11,600	238,380.00	0.06
361	000726	鲁泰 A	32,300	238,374.00	0.06
362	300345	华民股份	22,800	234,384.00	0.06
363	300896	爱美客	400	226,540.00	0.05
364	688506	百利天恒	9,150	226,005.00	0.05
365	300634	彩讯股份	14,400	219,600.00	0.05
366	603868	飞科电器	3,200	215,456.00	0.05
367	002832	比音勒芬	8,200	210,002.00	0.05
368	300637	扬帆新材	32,600	209,944.00	0.05
369	603877	太平鸟	11,400	209,646.00	0.05
370	000541	佛山照明	42,600	209,592.00	0.05
371	603368	柳药集团	11,200	209,104.00	0.05
372	300679	电连技术	5,600	207,200.00	0.05
373	300462	华铭智能	24,400	203,496.00	0.05
374	688030	山石网科	10,400	202,384.00	0.05
375	600785	新华百货	10,900	202,086.00	0.05
376	600720	祁连山	19,900	197,607.00	0.05
377	603609	禾丰股份	16,281	192,767.04	0.05
378	600582	天地科技	37,000	192,400.00	0.05
379	000983	山西焦煤	16,400	191,060.00	0.04
380	300706	阿石创	8,200	188,600.00	0.04
381	000401	冀东水泥	22,900	188,467.00	0.04
382	600755	厦门国贸	26,300	187,782.00	0.04
383	002138	顺络电子	7,100	185,878.00	0.04
384	002493	荣盛石化	15,100	185,730.00	0.04
385	300641	正丹股份	35,800	181,864.00	0.04
386	300366	创意信息	18,700	179,894.00	0.04
387	300448	浩云科技	37,900	177,372.00	0.04
388	002609	捷顺科技	19,100	171,900.00	0.04
389	002203	海亮股份	15,200	171,760.00	0.04
390	601336	新华保险	5,700	171,456.00	0.04
391	600232	金鹰股份	31,400	171,444.00	0.04
392	300951	博硕科技	3,600	171,360.00	0.04
393	601009	南京银行	16,400	170,888.00	0.04
394	300025	华星创业	35,900	170,525.00	0.04
395	601881	中国银河	18,200	169,078.00	0.04
396	002959	小熊电器	2,800	168,896.00	0.04
397	000030	富奥股份	38,300	168,520.00	0.04
398	002027	分众传媒	24,900	166,332.00	0.04
399	002048	宁波华翔	11,800	164,020.00	0.04
400	601111	中国国航	15,400	163,240.00	0.04
401	002378	章源钨业	23,000	161,920.00	0.04
402	688013	天臣医疗	8,200	158,998.00	0.04

403	603226	菲林格尔	31,600	155,788.00	0.04
404	000758	中色股份	32,700	155,325.00	0.04
405	600549	厦门钨业	7,800	152,490.00	0.04
406	600998	九州通	11,600	151,264.00	0.04
407	600229	城市传媒	20,400	144,228.00	0.03
408	603225	新凤鸣	13,200	143,616.00	0.03
409	002083	孚日股份	30,100	142,674.00	0.03
410	300442	润泽科技	3,300	139,788.00	0.03
411	000682	东方电子	17,300	139,092.00	0.03
412	600284	浦东建设	20,400	137,496.00	0.03
413	002281	光迅科技	8,700	136,764.00	0.03
414	600063	皖维高新	23,300	136,305.00	0.03
415	603528	多伦科技	20,800	134,160.00	0.03
416	300723	一品红	3,800	131,404.00	0.03
417	300645	正元智慧	5,200	130,936.00	0.03
418	603995	甬金股份	4,600	128,018.00	0.03
419	002655	共达电声	11,400	127,224.00	0.03
420	600826	兰生股份	13,800	126,822.00	0.03
421	300596	利安隆	2,300	125,511.00	0.03
422	002322	理工能科	14,000	125,020.00	0.03
423	688380	中微半导	4,725	124,929.00	0.03
424	688153	唯捷创芯	3,300	121,209.00	0.03
425	002273	水晶光电	10,100	119,079.00	0.03
426	600792	云煤能源	34,100	118,327.00	0.03
427	600496	精工钢构	29,700	117,315.00	0.03
428	002293	罗莱生活	10,400	116,688.00	0.03
429	603679	华体科技	9,600	114,528.00	0.03
430	000420	吉林化纤	25,500	112,965.00	0.03
431	300447	全信股份	7,300	112,420.00	0.03
432	688528	秦川物联	11,000	112,090.00	0.03
433	601098	中南传媒	11,200	111,776.00	0.03
434	002831	裕同科技	3,300	109,131.00	0.03
435	600053	九鼎投资	7,200	106,416.00	0.03
436	000739	普洛药业	4,900	105,546.00	0.02
437	000027	深圳能源	16,100	102,396.00	0.02
438	600184	光电股份	9,100	101,920.00	0.02
439	600578	京能电力	31,300	101,725.00	0.02
440	688139	海尔生物	1,600	101,280.00	0.02
441	002583	海能达	19,600	100,156.00	0.02
442	002055	得润电子	11,500	99,130.00	0.02
443	600026	中远海能	7,900	95,195.00	0.02
444	002829	星网宇达	2,700	92,853.00	0.02
445	603983	丸美股份	2,700	91,098.00	0.02
446	300454	深信服	800	90,040.00	0.02
447	002081	金螳螂	18,500	89,725.00	0.02
448	600629	华建集团	20,400	89,556.00	0.02
449	002028	思源电气	2,300	87,906.00	0.02
450	688698	伟创电气	4,100	84,911.00	0.02
451	002815	崇达技术	8,500	84,235.00	0.02
452	600985	淮北矿业	6,500	83,200.00	0.02

453	300575	中旗股份	3,800	83,106.00	0.02
454	301193	家联科技	2,500	82,775.00	0.02
455	688101	三达膜	6,400	82,752.00	0.02
456	000935	四川双马	3,900	81,900.00	0.02
457	603663	三祥新材	6,300	80,073.00	0.02
458	603661	恒林股份	2,800	79,716.00	0.02
459	605388	均瑶健康	5,000	75,200.00	0.02
460	688686	奥普特	565	74,580.00	0.02
461	601326	秦港股份	26,800	73,700.00	0.02
462	688184	帕瓦股份	2,156	72,915.92	0.02
463	605183	确成股份	3,800	71,782.00	0.02
464	688123	聚辰股份	700	70,840.00	0.02
465	600261	阳光照明	22,100	70,499.00	0.02
466	001301	尚太科技	1,164	68,722.56	0.02
467	605020	永和股份	1,700	66,776.00	0.02
468	688188	柏楚电子	300	65,124.00	0.02
469	603898	好莱客	5,700	64,524.00	0.02
470	603060	国检集团	4,700	60,630.00	0.01
471	003035	南网能源	10,500	59,535.00	0.01
472	688092	爱科科技	2,500	58,050.00	0.01
473	300138	晨光生物	3,200	56,736.00	0.01
474	002637	赞宇科技	4,500	55,260.00	0.01
475	600575	淮河能源	22,100	53,261.00	0.01
476	603038	华立股份	7,300	52,195.00	0.01
477	002484	江海股份	2,300	51,451.00	0.01
478	600967	内蒙一机	6,000	49,560.00	0.01
479	603113	金能科技	5,400	48,978.00	0.01
480	300242	佳云科技	14,300	48,620.00	0.01
481	002913	奥士康	1,900	46,303.00	0.01
482	000921	海信家电	3,500	46,095.00	0.01
483	601168	西部矿业	4,300	43,860.00	0.01
484	601882	海天精工	1,600	41,920.00	0.01
485	300856	科思股份	800	41,720.00	0.01
486	002841	视源股份	700	41,328.00	0.01
487	688159	有方科技	2,800	40,740.00	0.01
488	300938	信测标准	1,200	40,128.00	0.01
489	301021	英诺激光	1,500	38,685.00	0.01
490	603006	联明股份	4,300	37,840.00	0.01
491	002952	亚世光电	2,500	37,450.00	0.01
492	605116	奥锐特	1,500	37,035.00	0.01
493	600292	远达环保	6,500	36,400.00	0.01
494	603556	海兴电力	2,000	35,200.00	0.01
495	601211	国泰君安	2,500	33,975.00	0.01
496	600378	昊华科技	700	30,037.00	0.01
497	600754	锦江酒店	500	29,175.00	0.01
498	301269	华大九天	326	28,668.44	0.01
499	688150	莱特光电	1,400	27,090.00	0.01
500	300238	冠昊生物	2,400	24,672.00	0.01
501	600117	西宁特钢	7,600	23,636.00	0.01
502	603713	密尔克卫	200	23,332.00	0.01

503	601500	通用股份	6,200	22,940.00	0.01
504	300394	天孚通信	800	20,280.00	0.00
505	002753	永东股份	2,100	17,556.00	0.00
506	301267	华厦眼科	234	15,490.80	0.00
507	301308	江波龙	271	15,371.12	0.00
508	603283	赛腾股份	500	15,015.00	0.00
509	601921	浙版传媒	1,800	13,320.00	0.00
510	301338	凯格精机	253	12,394.47	0.00
511	301165	锐捷网络	379	11,980.19	0.00
512	301230	泓博医药	247	11,935.04	0.00
513	301396	宏景科技	370	11,803.00	0.00
514	301391	卡莱特	144	11,659.68	0.00
515	300602	飞荣达	800	11,512.00	0.00
516	301277	新天地	439	11,317.42	0.00
517	301152	天力锂能	226	10,540.64	0.00
518	301273	瑞晨环保	277	10,467.83	0.00
519	301335	天元宠物	291	9,841.62	0.00
520	301363	美好医疗	259	9,803.15	0.00
521	301121	紫建电子	193	9,605.61	0.00
522	603059	倍加洁	500	9,535.00	0.00
523	301377	鼎泰高科	539	9,502.57	0.00
524	301328	维峰电子	122	9,389.12	0.00
525	301265	华新环保	819	9,336.60	0.00
526	301139	元道通信	362	9,162.22	0.00
527	002003	伟星股份	900	9,108.00	0.00
528	301306	西测测试	197	8,331.13	0.00
529	301326	捷邦科技	227	8,312.74	0.00
530	301176	逸豪新材	460	7,769.40	0.00
531	301171	易点天下	437	7,743.64	0.00
532	301366	一博科技	171	7,710.39	0.00
533	301398	星源卓镁	255	7,379.70	0.00
534	000917	电广传媒	1,400	7,252.00	0.00
535	301313	凡拓数创	247	7,197.58	0.00
536	300135	宝利国际	2,500	6,875.00	0.00
537	301349	信德新材	63	6,521.76	0.00
538	301388	欣灵电气	292	6,307.20	0.00
539	301368	丰立智能	337	6,241.24	0.00
540	301319	唯特偶	115	6,126.05	0.00
541	301270	汉仪股份	210	5,957.70	0.00
542	301318	维海德	130	5,426.20	0.00
543	301276	嘉曼服饰	239	5,403.79	0.00
544	301316	慧博云通	359	5,140.88	0.00
545	002463	沪电股份	400	4,760.00	0.00
546	301309	万得凯	178	4,353.88	0.00
547	600061	国投资本	500	3,195.00	0.00
548	000630	铜陵有色	900	2,808.00	0.00

#### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 8.4.1 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	300750	宁德时代	10,714,349.00	2.47
2	603613	国联股份	10,543,867.40	2.43
3	600519	贵州茅台	9,250,128.00	2.13
4	601857	中国石油	9,241,864.26	2.13
5	600919	江苏银行	9,155,264.00	2.11
6	600626	申达股份	8,023,710.00	1.85
7	603568	伟明环保	7,913,713.40	1.82
8	002790	瑞尔特	7,742,542.20	1.78
9	601012	隆基绿能	7,631,680.48	1.76
10	002718	友邦吊顶	7,552,620.00	1.74
11	601668	中国建筑	7,411,599.00	1.71
12	000776	广发证券	7,392,751.00	1.70
13	600028	中国石化	7,044,238.00	1.62
14	688100	威胜信息	7,020,564.61	1.62
15	002088	鲁阳节能	6,959,131.68	1.60
16	688585	上纬新材	6,908,377.57	1.59
17	002129	TCL 中环	6,728,789.00	1.55
18	688080	映翰通	6,622,415.09	1.52
19	688655	迅捷兴	6,597,424.64	1.52
20	002594	比亚迪	6,537,600.00	1.50

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。

## 8.4.2 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	603568	伟明环保	10,210,967.20	2.35
2	603613	国联股份	10,142,826.75	2.33
3	300750	宁德时代	9,476,577.74	2.18
4	601857	中国石油	9,085,666.00	2.09
5	601668	中国建筑	8,993,330.00	2.07
6	000733	振华科技	8,462,550.00	1.95
7	000519	中兵红箭	8,273,222.10	1.90
8	002790	瑞尔特	7,845,669.04	1.81
9	688319	欧林生物	7,626,387.30	1.76
10	300769	德方纳米	7,505,966.80	1.73
11	000776	广发证券	7,314,720.00	1.68
12	002756	永兴材料	7,187,490.29	1.65
13	600519	贵州茅台	6,994,944.00	1.61
14	688536	思瑞浦	6,872,860.34	1.58
15	600919	江苏银行	6,824,192.00	1.57
16	600873	梅花生物	6,663,523.00	1.53
17	001965	招商公路	6,581,565.13	1.52



18	603260	合盛硅业	6,519,058.00	1.50
19	300751	迈为股份	6,397,378.00	1.47
20	300014	亿纬锂能	6,364,226.96	1.47

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。

#### 8.4.3 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	2,563,310,429.08
卖出股票收入（成交）总额	2,529,940,767.31

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。

#### 8.5 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	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
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）	369,140.77	0.09
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	369,140.77	0.09

#### 8.6 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	127078	优彩转债	1,461	146,123.06	0.03
2	110091	合力转债	1,240	124,010.33	0.03
3	118029	富淼转债	990	99,007.38	0.02
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

#### 8.7 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。

#### 8.8 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。

## 8.9 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。

## 8.10 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。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 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。

### 8.11.2 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。

## 8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国农业银行股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责、处罚的情况。本基金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。

8.12.2 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。

### 8.12.3 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	1,798,395.20
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	7,388,773.50
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,187,168.70

### 8.12.4 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。

### 8.12.5 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。

### 8.12.6 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。

## §9 基金份额持有人信息

### 9.1 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
华夏智胜先锋股票（LOF）A	2,954	56,276.14	22,493,691.22	13.53%	143,746,012.59	86.47%
华夏智胜先锋股票 C	4,619	55,349.06	71,768,120.21	28.07%	183,889,193.30	71.93%
合计	7,573	55,710.68	94,261,811.43	22.34%	327,635,205.89	77.66%

### 9.2 期末上市基金前十名持有人

华夏智胜先锋股票（LOF）A

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	潘智楠	5,000,800.00	7.41%
2	东莞市嘉荣实业投资有限公司	3,982,618.00	5.90%
3	林艳华	2,489,924.00	3.69%
4	广东智慧云信息技术有限公司	1,990,859.00	2.95%
5	黄汉文	1,959,665.00	2.90%
6	余振强	1,777,323.00	2.63%
7	唐振仕	1,000,000.00	1.48%
8	江裕明	993,008.00	1.47%
9	唐晓明	992,738.00	1.47%
10	李芳	992,468.00	1.47%

### 9.3 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	华夏智胜先锋股票（LOF）A	719,352.53	0.43%
	华夏智胜先锋股票 C	290,785.34	0.11%
	合计	1,010,137.87	0.24%

### 9.4 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	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	华夏智胜先锋股票（LOF）A	0
	华夏智胜先锋股票 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	华夏智胜先锋股票（LOF）A	0~10
	华夏智胜先锋股票 C	0

	合计	0~10
--	----	------

## §10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华夏智胜先锋股票（LOF）A	华夏智胜先锋股票 C
基金合同生效日（2021 年 12 月 15 日）基金份额总额	266,047,009.99	162,223,051.71
本报告期期初基金份额总额	266,047,009.99	162,223,051.71
本报告期基金总申购份额	68,985,525.29	292,421,692.71
减：本报告期基金总赎回份额	168,792,831.47	198,987,430.91
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	166,239,703.81	255,657,313.51

## §11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 11.2 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，桂勇先生担任华夏基金管理有限公司首席信息官，李一梅女士不再兼任。华夏基金管理有限公司已根据法律法规的规定完成财务负责人孙立强先生的有关备案工作。

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。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 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。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期应支付给安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为 60,000 元人民币。本基金本报告期内选聘安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）提供首年审计服务。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 11.6.1 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。

#### 11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 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	2	5,074,473,548.14	100.00%	1,147,295.62	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，本基金本报告期末选择其他交易单元作为本基金交易单元。

④本报告期内，本基金租用的券商交易单元未发生变更。

### 11.7.2 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	904,246.17	100.00%	676,100,000.00	100.00%	-	-	-	-

## 11.8 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关于华夏智胜先锋股票型证券投资基金（LOF）A 类基金份额开通场外份额转托管至场内业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-01-18
2	华夏基金管理有限公司关于华夏智胜先锋股票型证券投资基金（LOF）A 类基金份额上市交	中国证监会指定报刊及网站	2022-01-28

	易公告书提示性公告		
3	华夏智胜先锋股票型证券投资基金（LOF）A 类基金份额上市交易公告书	中国证监会指定报刊及网站	2022-01-28
4	华夏智胜先锋股票型证券投资基金（LOF）开放日常申购、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	2022-01-28
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	2022-03-19
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	2022-04-02
7	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	2022-04-08
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	2022-04-13
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	2022-04-16
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	2022-05-28
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	2022-06-18
12	华夏基金管理有限公司公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-06-24
13	华夏基金管理有限公司公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-06-25
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	2022-07-07
15	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	2022-07-15
16	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	2022-07-20
17	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	2022-07-23
18	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	2022-07-30
19	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	2022-08-10
20	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	2022-08-12
21	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	2022-08-13
22	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	2022-08-19
23	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	2022-09-01
24	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	2022-09-03
25	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	2022-09-17
26	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	2022-09-22
27	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	2022-09-23

28	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	2022-09-26
29	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	2022-10-14
30	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	2022-10-20
31	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	2022-10-22
32	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	2022-11-05
33	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	2022-11-12
34	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	2022-11-16
35	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	2022-11-26
36	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	2022-11-30
37	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	2022-12-16
38	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资非公开发行股票的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-12-17
39	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	2022-12-20
40	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	2022-12-23
41	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	2022-12-24

## §12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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。

## §13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予基金注册的文件；
- 2、《华夏智胜先锋股票型证券投资基金（LOF）基金合同》；
- 3、《华夏智胜先锋股票型证券投资基金（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。

### 13.2 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。

### 13.3 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

二〇二三年三月三十日