

**华夏智胜先锋股票型
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：华夏银行股份有限公司

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。

基金托管人华夏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	11
§6 中期报告财务会计报告（未经审计）	11
6.1 资产负债表	11
6.2 利润表	13
6.3 净资产（基金净值）变动表	14
6.4 报表附注	15
§7 投资组合报告	47
7.1 期末基金资产组合情况	47
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	47
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	48
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	63
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	74
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	74
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	75
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	75
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	75
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	75
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	75
7.12 投资组合报告附注	75
§8 基金份额持有人信息	76
§9 开放式基金份额变动	77
§10 重大事件揭示	78
§11 影响投资者决策的其他重要信息	80
§12 备查文件目录	80

§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	3,310,259,257.45 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	879,266,774.62 份	2,430,992,482.83 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

2.5 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）	
	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	33,247,365.51	85,126,572.61
本期利润	43,395,338.42	94,791,815.97
加权平均基金份额本期利润	0.1048	0.0787
本期加权平均净值利润率	9.24%	6.96%
本期基金份额净值增长率	15.05%	14.83%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)	
	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	108,674,768.41	283,797,572.71
期末可供分配基金份额利润	0.1236	0.1167
期末基金资产净值	1,022,957,513.49	2,811,058,419.48
期末基金份额净值	1.1634	1.1563

3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)	
	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	16.34%	15.63%

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
过去一个月	1.92%	0.80%	-0.77%	0.89%	2.69%	-0.09%
过去三个月	1.96%	0.74%	-5.10%	0.78%	7.06%	-0.04%
过去六个月	15.05%	0.73%	2.20%	0.75%	12.85%	-0.02%
过去一年	15.47%	0.93%	-6.65%	0.91%	22.12%	0.02%
自基金合同生效起至今	16.34%	1.18%	-17.14%	1.14%	33.48%	0.04%

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
过去一个月	1.88%	0.80%	-0.77%	0.89%	2.65%	-0.09%
过去三个月	1.86%	0.74%	-5.10%	0.78%	6.96%	-0.04%
过去六个月	14.83%	0.73%	2.20%	0.75%	12.63%	-0.02%
过去一年	15.01%	0.93%	-6.65%	0.91%	21.66%	0.02%
自基金合同生效起至今	15.63%	1.18%	-17.14%	1.14%	32.77%	0.04%

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 2023 年 6 月 30 日)

华夏智胜先锋股票（LOF）A



华夏智胜先锋股票 C



§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”奖评选活动中，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，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		
孙蒙	本基金的 基金经理	2021-12-15	-	9 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。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

上半年，全球主要经济体增长放缓，美欧通胀见顶回落，但仍处高位，主要经济体货币政策紧缩外溢效应突出，硅谷银行倒闭、瑞士信贷被收购等事件引发国际金融市场大幅震荡；西方继续对

俄实施大规模制裁，地缘政治冲突升级并进一步影响全球经济秩序的风险犹存。国内方面，先后经历需求释放以及去库存带来的需求回落，流动性充裕。权益市场赚钱难度较大，一方面，去库存阶段使然，另一方面，缺乏能够短期兑现利润的超预期产业趋势。值得一提的是 AI 方向，正在发生长期变革性的产业变化，产业链涉及硬件和软件，并可渗透至社会的各行各业。目前处于发展早期，个股波动较大。

市场方面，A 股市场上涨后震荡调整，结构性行情非常明显，同时主题板块轮动较快，中小市值板块相对占优。行业间表现差异比较大：通信、传媒、计算机等科技相关行业表现较好，而商业贸易、房地产、美容护理等行业表现较差。市场风格轮动较快，整体上估值、反转等量价类因子表现较好，而盈利、成长等基本面类因子持续走弱，期间量化策略整体表现正常。

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 2023 年 6 月 30 日，华夏智胜先锋股票（LOF）A 基金份额净值为 1.1634 元，本报告期份额净值增长率为 15.05%；华夏智胜先锋股票 C 基金份额净值为 1.1563 元，本报告期份额净值增长率为 14.83%，同期业绩比较基准增长率为 2.20%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年经济复苏弱于预期，下半年政府可能出台更多稳增长政策，货币政策将继续保持宽松，预计中国经济复苏有望加强。A 股上市公司盈利增速方向预计向上，同时投资者情绪逐渐修复。展望下半年，市场预计震荡上行，行业或者风格板块可能持续保持轮动特征，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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、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中期报告中的财务指标、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 中期报告财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华夏智胜先锋股票型证券投资基金（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	234,537,184.52	26,126,592.17
结算备付金		3,803,292.23	1,495,564.90
存出保证金		6,150,048.00	1,798,395.20

交易性金融资产	6.4.7.2	3,580,548,513.61	390,438,480.79
其中：股票投资		3,580,417,502.70	390,069,340.02
基金投资		-	-
债券投资		131,010.91	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	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		48,486,218.15	7,388,773.50
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		3,873,525,256.51	427,247,806.56
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		-	-
应付赎回款		34,157,617.47	1,039,506.86
应付管理人报酬		2,893,143.09	342,946.30
应付托管费		578,628.64	68,589.26
应付销售服务费		859,737.59	82,364.29
应付投资顾问费		-	-
应交税费		0.43	3,272.91
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	1,020,196.32	180,087.69
负债合计		39,509,323.54	1,716,767.31
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	3,310,259,257.45	421,897,017.32
未分配利润	6.4.7.8	523,756,675.52	3,634,021.93
净资产合计		3,834,015,932.97	425,531,039.25
负债和净资产总计		3,873,525,256.51	427,247,806.56

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，华夏智胜先锋股票（LOF）A 基金份额净值 1.1634 元，华夏智胜先锋股票 C 基金份额净值 1.1563 元；华夏智胜先锋股票（LOF）基金份额总额 3,310,259,257.45 份（其中 A 类 879,266,774.62 份，C 类 2,430,992,482.83 份）。

6.2 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：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		151,668,803.10	-14,229,757.10
1.利息收入		208,977.32	123,630.47
其中：存款利息收入	6.4.7.9	208,977.32	33,393.59
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
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		130,002,872.36	-16,431,699.81
其中：股票投资收益	6.4.7.10	96,734,935.91	-19,460,559.05
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	464,663.88	89,740.12
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	-101,409.98	-
股利收益	6.4.7.14	32,904,682.55	2,939,119.12
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	19,813,216.27	1,753,952.92
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	1,643,737.15	324,359.32
减：二、营业总支出		13,481,648.71	2,425,094.52
1.管理人报酬		8,948,467.99	1,730,950.19
2.托管费		1,789,693.59	346,190.03
3.销售服务费		2,658,946.26	263,251.29
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		238.31	0.45
8.其他费用	6.4.7.18	84,302.56	84,702.56
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		138,187,154.39	-16,654,851.62
减：所得税费用		-	-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		138,187,154.39	-16,654,851.62
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		138,187,154.39	-16,654,851.62

6.3 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：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）	421,897,017.32	-	3,634,021.93	425,531,039.25
二、本期期初净资产（基金净值）	421,897,017.32	-	3,634,021.93	425,531,039.25
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	2,888,362,240.13	-	520,122,653.59	3,408,484,893.72
（一）、综合收益总额	-	-	138,187,154.39	138,187,154.39
（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）	2,888,362,240.13	-	381,935,499.20	3,270,297,739.33
其中：1.基金申购款	3,747,779,778.60	-	493,291,051.85	4,241,070,830.45
2.基金赎回款	-859,417,538.47	-	-111,355,552.65	-970,773,091.12
（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）	3,310,259,257.45	-	523,756,675.52	3,834,015,932.97
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）	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）	-125,766,472.88	-	-4,103,361.45	-129,869,834.33
（一）、综合收益总额	-	-	-16,654,851.62	-16,654,851.62
（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）	-125,766,472.88	-	12,551,490.17	-113,214,982.71
其中：1.基金申购款	32,062,050.32	-	-2,416,388.01	29,645,662.31
2.基金赎回款	-157,828,523.20	-	14,967,878.18	-142,860,645.02
（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）	302,503,588.82	-	2,021,534.77	304,525,123.59

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。

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	25,821,345.79
等于：本金	25,818,110.40
加：应计利息	3,235.39
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	208,715,838.73
等于：本金	208,702,117.57
加：应计利息	13,721.16
合计	234,537,184.52

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。

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		3,567,039,971.92	-	3,580,417,502.70	13,377,530.78
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	131,000.00	10.91	131,010.91	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	131,000.00	10.91	131,010.91	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		3,567,170,971.92	10.91	3,580,548,513.61	13,377,530.78

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目		本期末 2023 年 6 月 30 日			
		合同/名义 金额	公允价值		备注
			资产	负债	
利率衍生工具		-	-	-	-
货币衍生工具		-	-	-	-
权益衍生工具		52,165,720.00	-	-	-
其中：股指期货		52,165,720.00	-	-	-
其他衍生工具		-	-	-	-
合计		52,165,720.00	-	-	-

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IC2309	中证 500 期货 IC2309 合约	33	39,402,000.00	-865,000.00
IC2312	中证 500 期货 IC2312 合约	10	11,848,400.00	-50,320.00
合计	-	-	-	-915,320.00
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	-915,320.00

净额	-	-	-	-
----	---	---	---	---

注：衍生金融资产项下的利率/权益/其他衍生工具为国债/股指/商品期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指/商品/国债期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指/商品/国债期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 0。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 其他资产

无。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	902.76
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	144,302.56
其他	874,991.00
合计	1,020,196.32

6.4.7.7 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 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	166,239,703.81	166,239,703.81
本期申购	852,288,029.34	852,288,029.34
本期赎回（以“-”号填列）	-139,260,958.53	-139,260,958.53

本期末	879,266,774.62	879,266,774.62
-----	----------------	----------------

华夏智胜先锋股票 C

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	账面金额
上年度末	255,657,313.51	255,657,313.51
本期申购	2,895,491,749.26	2,895,491,749.26
本期赎回（以“-”号填列）	-720,156,579.94	-720,156,579.94
本期末	2,430,992,482.83	2,430,992,482.83

6.4.7.8 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	2,353,877.68	-500,202.49	1,853,675.19
本期利润	33,247,365.51	10,147,972.91	43,395,338.42
本期基金份额交易产生的变动数	73,073,525.22	25,368,200.04	98,441,725.26
其中：基金申购款	86,073,524.60	30,719,229.70	116,792,754.30
基金赎回款	-12,999,999.38	-5,351,029.66	-18,351,029.04
本期已分配利润	-	-	-
本期末	108,674,768.41	35,015,970.46	143,690,738.87

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	2,561,236.05	-780,889.31	1,780,346.74
本期利润	85,126,572.61	9,665,243.36	94,791,815.97
本期基金份额交易产生的变动数	196,109,764.05	87,384,009.89	283,493,773.94
其中：基金申购款	262,350,952.21	114,147,345.34	376,498,297.55
基金赎回款	-66,241,188.16	-26,763,335.45	-93,004,523.61
本期已分配利润	-	-	-
本期末	283,797,572.71	96,268,363.94	380,065,936.65

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	18,129.20
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	154,565.75

结算备付金利息收入	21,888.88
其他	14,393.49
合计	208,977.32

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。

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	4,335,596,999.00
减：卖出股票成本总额	4,230,943,752.79
减：交易费用	7,918,310.30
买卖股票差价收入	96,734,935.91

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	383.36
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	464,280.52
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	464,663.88

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	2,402,638.79
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,936,600.00
减：应计利息总额	424.61
减：交易费用	1,333.66
买卖债券差价收入	464,280.52

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

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
股指期货投资收益	-101,409.98

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	32,904,682.55
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	32,904,682.55

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	20,416,289.60
——股票投资	20,416,289.60
——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	-603,073.33
——权证投资	-
——期货投资	-603,073.33
4.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	19,813,216.27

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	1,643,737.15
合计	1,643,737.15

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	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
其他	-
合计	84,302.56

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
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
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
中信期货有限公司（“中信期货”）	基金管理人第一大股东的子公司
中信证券(山东)有限责任公司（“中信证券（山东）”）	基金管理人第一大股东的子公司
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：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	11,719,114,217.50	100.00%	2,501,656,053.34	100.00%

6.4.10.1.2 债券交易

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	2,402,638.79	100.00%	663,349.99	100.00%

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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%

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	2,659,329.87	100.00%	-	-
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	563,707.13	100.00%	-	-

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	8,948,467.99	1,730,950.19
其中：支付销售机构的客户维护费	2,504,943.58	610,101.36

注：①支付基金管理人的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 1.00%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

②基金管理人报酬计算公式为：日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×1.00%/当年天数。

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 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	1,789,693.59	346,190.03

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	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		
	华夏智胜先锋股票 (LOF) A	华夏智胜先锋股票 C	合计

各关 联方 名称			
华夏 基金 管理 有限 公司	-	615,216.83	615,216.83
中信 证券	-	376,733.45	376,733.45
中信 证券 （华 南）	-	191,161.01	191,161.01
华夏 财富	-	52,765.55	52,765.55
华夏 银行	-	2,020.95	2,020.95
中信 期货	-	1,546.55	1,546.55
中信 证券 （山 东）	-	943.37	943.37
合计	-	1,240,387.71	1,240,387.71
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）	-	134,019.44	134,019.44
中信 证券	-	84,506.41	84,506.41
华夏	-	1,272.92	1,272.92

银行			
华夏基金 管理有限公司	-	675.25	675.25
中信证券 （山东）	-	349.52	349.52
合计	-	220,823.54	220,823.54

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。

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
华夏银行活期存款	25,821,345.79	18,129.20	8,797,206.48	7,163.67

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。

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	13,146	577,372.32
中信证券	001286	陕西能源	新股发行	37,667	361,603.20
中信证券	688146	中船特气	新股发行	9,186	332,073.90
中信证券	688581	安杰思	新股发行	1,629	204,928.20
中信证券	688539	高华科技	新股发行	5,334	203,865.48
中信证券	688522	纳睿雷达	新股发行	3,638	169,821.84
中信证券	301439	泓淋电力	新股发行	6,925	138,430.75
中信证券	688523	航天环宇	新股发行	4,717	103,113.62
中信证券	301293	三博脑科	新股发行	3,324	98,390.40
中信证券	301323	新莱福	新股发行	2,277	88,939.62
中信证券	688631	莱斯信息	新股发行	3,357	84,864.96
中信证券	301170	锡南科技	新股发行	2,496	84,864.00
中信证券	301157	华塑科技	新股发行	1,498	84,637.00
中信证券	601133	柏诚股份	新股发行	6,632	77,329.12
中信证券	301261	恒工精密	新股发行	1,973	72,803.70
中信证券	603281	江瀚新材	新股发行	863	30,714.17
中信证券	001367	海森药业	新股发行	549	24,419.52
中信证券	001324	长青科技	新股发行	1,131	21,353.28
中信证券	603162	海通发展	新股发行	523	19,481.75
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	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	688326	经纬恒润	新股发行	1,442	174,482.00
中信证券	301109	军信股份	新股发行	4,471	155,635.51
中信证券	301302	华如科技	新股发行	2,801	145,736.03
中信证券	688290	景业智能	新股发行	3,040	103,025.60
中信证券	603191	望变电气	新股发行	1,149	13,627.14
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
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	仁信新材	2023-06-21	1 个月内(含)	新发流通受限	26.68	26.68	4,676	124,755.68	124,755.68	-
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	19.99	19.99	5,241	104,767.59	104,767.59	-

				通 受 限						
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 受限	55.00	55.00	1,251	68,805.00	68,805.00	-
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	23.60	64.67	831	19,611.60	53,740.77	-

				限						
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	-
688531	日联科技	2023-03-24	6 个月	新发流通受限	152.38	135.97	283	43,123.54	38,479.51	-
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	-
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	-
688146	中船特气	2023-04-13	6 个月	新发流通受限	36.15	38.13	919	33,221.85	35,041.47	-
688484	南芯科技	2023-03-28	6 个月	新发流通受限	39.99	36.71	870	34,791.30	31,937.70	-
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	-
001287	中电	2023-03-30	6 个月	新	11.88	21.02	1,365	16,216.20	28,692.30	-

	港			发 流 通 受 限						
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	-
301358	湖南 裕能	2023-02-01	6 个月	新 发 流 通 受 限	23.77	42.89	645	15,331.65	27,664.05	-
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 业	2023-05-26	6 个月	新 发 流 通 受 限	67.28	65.43	409	27,517.52	26,760.87	-
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	29.60	71.42	333	9,856.80	23,782.86	-

				通 受 限						
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 受 限	75.00	90.76	221	16,575.00	20,057.96	-
301303	真兰 仪表	2023-02-13	6 个月	新 发 流 通 受 限	26.80	22.32	878	23,530.40	19,596.96	-
688581	安杰 思	2023-05-12	6 个月	新 发 流 通 受	125.80	118.03	163	20,505.40	19,238.89	-

				限						
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	-
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	2023-05-15	6 个月	新	25.25	19.69	753	19,013.25	14,826.57	-

	环境			发 流 通 受 限						
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 微	2023-05-08	6 个月	新 发 流 通 受 限	20.92	19.16	721	15,083.32	13,814.36	-
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	26.66	31.50	418	11,143.88	13,167.00	-

				通 受 限						
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	-
301439	泓淋 电力	2023-03-10	6 个月	新 发 流 通 受 限	19.99	16.90	693	13,853.07	11,711.70	-
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 受 限	17.80	17.89	628	11,178.40	11,234.92	-
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	35.66	33.26	333	11,874.78	11,075.58	-

				限						
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	2023-06-02	6 个月	新	17.55	16.75	563	9,880.65	9,430.25	-

	科技			发 流 通 受 限						
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 科技	2023-06-16	6 个月	新 发 流 通 受 限	34.00	34.93	250	8,500.00	8,732.50	-
301281	科源 制药	2023-03-28	6 个月	新 发 流 通 受 限	44.18	25.10	337	10,647.38	8,458.70	含 证 券 送 配
688535	华海 诚科	2023-03-28	6 个月	新 发 流	35.00	51.23	161	5,635.00	8,248.03	-

				通 受 限						
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	-
301157	华塑 科技	2023-03-01	6 个月	新发 流 通 受 限	56.50	52.93	150	8,475.00	7,939.50	-
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 受	42.45	32.97	226	9,593.70	7,451.22	-

				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	-
301345	涛涛车业	2023-03-10	6 个月	新发流通受限	73.45	46.64	153	11,237.85	7,135.92	-
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	2023-05-15	6 个月	新	27.93	33.03	105	2,932.65	3,468.15	-

	锻造			发 流 通 受 限						
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	-
6.4.12.1.2 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 (张)	期 末 成 本 总 额	期 末 估 值 总 额	备 注
127086	恒邦转债	2023-06-12	1 个月 内(含)	新发 流 通 受 限	100.00	100.01	1,310	131,000.00	131,010.91	期 末 估 值 单 价 为 含

										息 价 格
--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	-------------

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

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

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

④基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的设定限售期的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金管理人主要通过定性分析和定量分析的方法，估测各种金融工具风险可能产生的损失。本基金管理人从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重性；从定量分析的角度出发，根据本基

金的投资目标，结合基金资产所运用的金融工具特征，通过特定的风险量化指标、模型和日常的量化报告，参考压力测试结果，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时对各种风险进行监督、检查和评估，并制定相应决策，将风险控制在预期可承受的范围之内。

6.4.13.2 信用风险

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

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

6.4.13.3 流动性风险

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

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 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	3,580,417,502.70	93.39	390,069,340.02	91.67
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	131,010.91	0.00	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	3,580,548,513.61	93.39	390,438,480.79	91.75

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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	-5%	-173,103,300.72	-18,862,086.71
	+5%	173,103,300.72	18,862,086.71

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	3,578,012,899.48
第二层次	996,445.09
第三层次	1,539,169.04
合计	3,580,548,513.61

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	3,580,417,502.70	92.43
	其中：股票	3,580,417,502.70	92.43
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	131,010.91	0.00
	其中：债券	131,010.91	0.00
	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	238,340,476.75	6.15
8	其他各项资产	54,636,266.15	1.41
9	合计	3,873,525,256.51	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	3,413,151.00	0.09
B	采矿业	123,172,070.88	3.21
C	制造业	2,279,785,848.53	59.46
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	152,545,935.97	3.98
E	建筑业	58,669,620.41	1.53
F	批发和零售业	64,981,485.02	1.69
G	交通运输、仓储和邮政业	116,388,415.92	3.04
H	住宿和餐饮业	853,316.00	0.02
I	信息传输、软件和信息技术服务业	183,609,819.54	4.79
J	金融业	336,185,106.62	8.77
K	房地产业	39,485,785.10	1.03
L	租赁和商务服务业	96,265,286.08	2.51
M	科学研究和技术服务业	72,678,990.00	1.90
N	水利、环境和公共设施管理业	11,514,368.57	0.30
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	17,084,099.20	0.45

Q	卫生和社会工作	3,094,273.86	0.08
R	文化、体育和娱乐业	19,194,524.00	0.50
S	综合	1,495,406.00	0.04
	合计	3,580,417,502.70	93.39

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	600582	天地科技	4,559,000	26,578,970.00	0.69
2	000623	吉林敖东	1,621,743	26,012,757.72	0.68
3	301028	东亚机械	2,208,100	24,620,315.00	0.64
4	300719	安达维尔	1,736,179	24,514,847.48	0.64
5	601328	交通银行	4,179,200	24,239,360.00	0.63
6	603556	海兴电力	954,688	24,096,325.12	0.63
7	603551	奥普家居	1,830,400	23,667,072.00	0.62
8	601398	工商银行	4,842,200	23,339,404.00	0.61
9	688013	天臣医疗	961,553	22,798,421.63	0.59
10	300767	震安科技	884,327	22,426,532.72	0.58
11	300003	乐普医疗	988,100	22,340,941.00	0.58
12	000063	中兴通讯	476,600	21,704,364.00	0.57
13	601288	农业银行	5,988,900	21,140,817.00	0.55
14	002203	海亮股份	1,722,300	20,684,823.00	0.54
15	002990	盛视科技	544,389	20,033,515.20	0.52
16	600028	中国石化	3,148,100	20,021,916.00	0.52
17	002028	思源电气	427,300	19,963,456.00	0.52
18	000333	美的集团	338,200	19,926,744.00	0.52
19	000725	京东方 A	4,855,300	19,858,177.00	0.52
20	002879	长缆科技	1,195,800	19,694,826.00	0.51
21	002732	燕塘乳业	899,254	19,441,871.48	0.51
22	002027	分众传媒	2,854,400	19,438,464.00	0.51
23	601888	中国中免	175,806	19,431,837.18	0.51
24	002749	国光股份	1,682,457	19,062,237.81	0.50
25	601939	建设银行	3,042,153	19,043,877.78	0.50
26	000811	冰轮环境	1,207,800	19,034,928.00	0.50
27	688718	唯赛勃	1,059,747	18,344,220.57	0.48
28	002818	富森美	1,372,430	18,157,248.90	0.47
29	002152	广电运通	1,545,100	18,108,572.00	0.47
30	601728	中国电信	3,166,000	17,824,580.00	0.46
31	601857	中国石油	2,374,200	17,735,274.00	0.46
32	002774	快意电梯	2,212,900	17,592,555.00	0.46
33	688819	天能股份	474,224	17,470,412.16	0.46
34	000060	中金岭南	3,638,362	17,282,219.50	0.45

35	000513	丽珠集团	439,369	17,095,847.79	0.45
36	601006	大秦铁路	2,288,100	17,000,583.00	0.44
37	600845	宝信软件	329,628	16,748,398.68	0.44
38	600167	联美控股	2,390,000	16,658,300.00	0.43
39	600968	海油发展	5,386,200	16,535,634.00	0.43
40	002763	汇洁股份	1,864,800	16,522,128.00	0.43
41	605167	利柏特	1,701,300	16,468,584.00	0.43
42	688100	威胜信息	551,200	16,431,272.00	0.43
43	603508	思维列控	955,290	16,287,694.50	0.42
44	300749	顶固集创	1,757,500	16,151,425.00	0.42
45	600826	兰生股份	1,523,600	15,647,372.00	0.41
46	600519	贵州茅台	9,100	15,388,100.00	0.40
47	002595	豪迈科技	437,000	15,351,810.00	0.40
48	603758	秦安股份	1,441,200	15,334,368.00	0.40
49	601577	长沙银行	1,941,700	15,067,592.00	0.39
50	003006	百亚股份	870,400	15,040,512.00	0.39
51	003816	中国广核	4,772,600	14,842,786.00	0.39
52	601686	友发集团	2,142,400	14,654,016.00	0.38
53	300515	三德科技	906,000	14,604,720.00	0.38
54	002275	桂林三金	804,227	14,484,128.27	0.38
55	600729	重庆百货	450,151	14,152,747.44	0.37
56	600517	国网英大	2,474,000	14,101,800.00	0.37
57	688670	金迪克	297,464	14,004,605.12	0.37
58	600830	香溢融通	2,272,600	13,885,586.00	0.36
59	002249	大洋电机	2,403,500	13,699,950.00	0.36
60	600761	安徽合力	680,220	13,556,784.60	0.35
61	000783	长江证券	2,296,400	13,319,120.00	0.35
62	688560	明冠新材	471,300	13,097,427.00	0.34
63	000987	越秀资本	2,045,200	12,987,020.00	0.34
64	002563	森马服饰	2,078,600	12,928,892.00	0.34
65	002322	理工能科	1,235,300	12,847,120.00	0.34
66	000030	富奥股份	2,544,400	12,823,776.00	0.33
67	688210	统联精密	656,585	12,816,539.20	0.33
68	603511	爱慕股份	744,300	12,801,960.00	0.33
69	002381	双箭股份	1,654,200	12,770,424.00	0.33
70	000426	兴业银锡	1,432,200	12,717,936.00	0.33
71	002611	东方精工	2,213,200	12,703,768.00	0.33
72	601139	深圳燃气	1,741,770	12,697,503.30	0.33
73	300074	华平股份	2,943,600	12,686,916.00	0.33
74	688012	中微公司	80,987	12,670,416.15	0.33
75	688080	映翰通	258,960	12,663,144.00	0.33
76	600039	四川路桥	1,287,120	12,626,647.20	0.33
77	002855	捷荣技术	1,202,300	12,612,127.00	0.33

78	603488	展鹏科技	1,566,640	12,580,119.20	0.33
79	688132	邦彦技术	462,281	12,564,797.58	0.33
80	603421	鼎信通讯	1,198,464	12,523,948.80	0.33
81	605066	天正电气	1,329,500	12,510,595.00	0.33
82	600897	厦门空港	604,400	12,505,036.00	0.33
83	688288	鸿泉物联	491,410	12,491,642.20	0.33
84	603628	清源股份	785,300	12,431,299.00	0.32
85	688336	三生国健	724,736	12,385,738.24	0.32
86	600864	哈投股份	2,421,400	12,373,354.00	0.32
87	600007	中国国贸	666,625	12,345,895.00	0.32
88	688073	毕得医药	174,000	12,315,720.00	0.32
89	002801	微光股份	454,480	12,298,228.80	0.32
90	603855	华荣股份	461,600	12,278,560.00	0.32
91	000608	阳光股份	4,520,110	12,249,498.10	0.32
92	603766	隆鑫通用	2,312,900	12,212,112.00	0.32
93	688093	世华科技	606,200	12,160,372.00	0.32
94	603839	安正时尚	1,615,960	12,152,019.20	0.32
95	601336	新华保险	330,400	12,148,808.00	0.32
96	688696	极米科技	87,111	12,142,402.29	0.32
97	603515	欧普照明	589,750	11,971,925.00	0.31
98	601601	中国太保	458,300	11,906,634.00	0.31
99	603040	新坐标	446,700	11,877,753.00	0.31
100	600886	国投电力	935,400	11,832,810.00	0.31
101	688616	西力科技	893,991	11,827,500.93	0.31
102	688078	龙软科技	228,100	11,758,555.00	0.31
103	002500	山西证券	2,100,700	11,721,906.00	0.31
104	688510	航亚科技	589,011	11,715,428.79	0.31
105	000980	众泰汽车	4,749,100	11,682,786.00	0.30
106	600261	阳光照明	3,188,500	11,638,025.00	0.30
107	002516	旷达科技	2,399,100	11,611,644.00	0.30
108	000528	柳工	1,461,900	11,549,010.00	0.30
109	601318	中国平安	248,892	11,548,588.80	0.30
110	601169	北京银行	2,483,800	11,499,994.00	0.30
111	300697	电工合金	958,440	11,482,111.20	0.30
112	601989	中国重工	2,380,500	11,474,010.00	0.30
113	601899	紫金矿业	1,005,300	11,430,261.00	0.30
114	600362	江西铜业	601,400	11,414,572.00	0.30
115	000997	新大陆	601,300	11,364,570.00	0.30
116	600900	长江电力	513,800	11,334,428.00	0.30
117	688625	呈和科技	288,273	11,297,418.87	0.29
118	000869	张裕 A	368,224	11,289,747.84	0.29
119	300667	必创科技	571,500	11,252,835.00	0.29
120	600276	恒瑞医药	234,520	11,233,508.00	0.29

121	603053	成都燃气	1,110,500	11,182,735.00	0.29
122	603808	歌力思	845,600	11,102,728.00	0.29
123	601628	中国人寿	317,000	11,082,320.00	0.29
124	688981	中芯国际	216,600	10,942,632.00	0.29
125	000923	河钢资源	809,100	10,922,850.00	0.28
126	000818	航锦科技	325,102	10,848,653.74	0.28
127	600967	内蒙一机	1,060,300	10,709,030.00	0.28
128	000514	渝开发	2,795,900	10,680,338.00	0.28
129	002479	富春环保	2,266,700	10,562,822.00	0.28
130	300314	戴维医疗	499,600	10,561,544.00	0.28
131	301076	新瀚新材	536,370	10,523,579.40	0.27
132	000858	五粮液	64,300	10,517,551.00	0.27
133	603701	德宏股份	740,100	10,502,019.00	0.27
134	300951	博硕科技	191,500	10,461,645.00	0.27
135	000531	穗恒运 A	1,446,480	10,458,050.40	0.27
136	300462	华铭智能	876,800	10,293,632.00	0.27
137	002149	西部材料	610,833	10,255,886.07	0.27
138	601567	三星医疗	811,900	10,254,297.00	0.27
139	002978	安宁股份	315,508	10,130,961.88	0.26
140	688395	正弦电气	379,500	10,090,905.00	0.26
141	002273	水晶光电	841,500	10,047,510.00	0.26
142	000717	中南股份	3,610,600	10,037,468.00	0.26
143	600628	新世界	1,380,200	9,978,846.00	0.26
144	300587	天铁股份	1,292,700	9,953,790.00	0.26
145	600662	外服控股	1,738,400	9,943,648.00	0.26
146	601600	中国铝业	1,810,500	9,939,645.00	0.26
147	600548	深高速	1,100,800	9,885,184.00	0.26
148	002745	木林森	1,073,900	9,879,880.00	0.26
149	600120	浙江东方	2,570,700	9,845,781.00	0.26
150	688267	中触媒	463,443	9,764,744.01	0.25
151	000045	深纺织 A	886,900	9,755,900.00	0.25
152	600161	天坛生物	358,560	9,734,904.00	0.25
153	301011	华立科技	414,436	9,710,235.48	0.25
154	688125	安达智能	178,404	9,696,257.40	0.25
155	688360	德马科技	433,400	9,617,146.00	0.25
156	002833	弘亚数控	488,440	9,602,730.40	0.25
157	600941	中国移动	102,100	9,525,930.00	0.25
158	605177	东亚药业	386,600	9,525,824.00	0.25
159	300976	达瑞电子	186,516	9,456,361.20	0.25
160	002698	博实股份	535,100	9,358,899.00	0.24
161	002345	潮宏基	1,182,980	9,298,222.80	0.24
162	301182	凯旺科技	403,670	9,272,299.90	0.24
163	600828	茂业商业	2,495,900	9,234,830.00	0.24

164	002928	华夏航空	1,089,000	9,202,050.00	0.24
165	000425	徐工机械	1,359,000	9,200,430.00	0.24
166	603861	白云电器	949,097	9,111,331.20	0.24
167	301061	匠心家居	246,320	9,101,524.00	0.24
168	601928	凤凰传媒	798,200	9,099,480.00	0.24
169	002793	罗欣药业	1,686,100	9,088,079.00	0.24
170	603283	赛腾股份	204,100	9,082,450.00	0.24
171	300347	泰格医药	140,700	9,080,778.00	0.24
172	000598	兴蓉环境	1,642,000	8,916,060.00	0.23
173	600879	航天电子	1,037,800	8,810,922.00	0.23
174	601988	中国银行	2,246,600	8,784,206.00	0.23
175	603217	元利科技	336,296	8,659,622.00	0.23
176	300396	迪瑞医疗	265,700	8,632,593.00	0.23
177	301004	嘉益股份	222,200	8,621,360.00	0.22
178	603896	寿仙谷	193,600	8,576,480.00	0.22
179	002017	东信和平	652,140	8,549,555.40	0.22
180	601012	隆基绿能	295,100	8,460,517.00	0.22
181	603367	辰欣药业	556,800	8,452,224.00	0.22
182	000534	万泽股份	493,200	8,270,964.00	0.22
183	603377	东方时尚	1,025,680	8,246,467.20	0.22
184	688630	芯碁微装	97,600	8,200,352.00	0.21
185	600061	国投资本	1,150,952	8,194,778.24	0.21
186	002014	永新股份	943,580	8,190,274.40	0.21
187	002930	宏川智慧	356,365	8,114,431.05	0.21
188	300896	爱美客	18,200	8,098,090.00	0.21
189	603587	地素时尚	552,600	8,090,064.00	0.21
190	002956	西麦食品	512,660	8,012,875.80	0.21
191	002966	苏州银行	1,220,700	7,995,585.00	0.21
192	300433	蓝思科技	669,100	7,868,616.00	0.21
193	002448	中原内配	1,121,500	7,850,500.00	0.20
194	601158	重庆水务	1,411,200	7,846,272.00	0.20
195	002376	新北洋	958,200	7,732,674.00	0.20
196	002372	伟星新材	376,400	7,731,256.00	0.20
197	600488	津药药业	1,365,400	7,673,548.00	0.20
198	600025	华能水电	1,075,300	7,666,889.00	0.20
199	002287	奇正藏药	315,779	7,547,118.10	0.20
200	601985	中国核电	1,066,300	7,517,415.00	0.20
201	603877	太平鸟	294,700	7,450,016.00	0.19
202	300371	汇中股份	567,528	7,434,616.80	0.19
203	688138	清溢光电	351,900	7,428,609.00	0.19
204	002540	亚太科技	1,276,884	7,380,389.52	0.19
205	600820	隧道股份	1,226,000	7,368,260.00	0.19
206	003008	开普检测	254,800	7,320,404.00	0.19

207	002236	大华股份	365,900	7,226,525.00	0.19
208	000567	海德股份	561,820	7,202,532.40	0.19
209	688586	江航装备	515,664	7,172,886.24	0.19
210	603878	武进不锈	846,220	7,150,559.00	0.19
211	300470	中密控股	153,100	7,076,282.00	0.18
212	002111	威海广泰	729,200	6,956,568.00	0.18
213	601319	中国人保	1,187,700	6,936,168.00	0.18
214	000429	粤高速 A	882,500	6,918,800.00	0.18
215	000020	深华发 A	585,200	6,770,764.00	0.18
216	002690	美亚光电	261,700	6,738,775.00	0.18
217	002925	盈趣科技	347,250	6,736,650.00	0.18
218	600724	宁波富达	1,833,600	6,729,312.00	0.18
219	001965	招商公路	693,479	6,657,398.40	0.17
220	601010	文峰股份	2,716,500	6,655,425.00	0.17
221	000729	燕京啤酒	529,100	6,597,877.00	0.17
222	600936	广西广电	1,715,000	6,568,450.00	0.17
223	600377	宁沪高速	662,822	6,515,540.26	0.17
224	002410	广联达	199,880	6,494,101.20	0.17
225	601138	工业富联	257,200	6,481,440.00	0.17
226	688211	中科微至	141,000	6,368,970.00	0.17
227	000589	贵州轮胎	1,136,300	6,363,280.00	0.17
228	300768	迪普科技	379,000	6,280,030.00	0.16
229	002461	珠江啤酒	711,100	6,264,791.00	0.16
230	603657	春光科技	356,700	6,260,085.00	0.16
231	000708	中信特钢	394,800	6,253,632.00	0.16
232	601326	秦港股份	1,831,100	6,189,118.00	0.16
233	603444	吉比特	12,600	6,187,986.00	0.16
234	000338	潍柴动力	496,400	6,185,144.00	0.16
235	001267	汇绿生态	1,104,700	6,164,226.00	0.16
236	300797	钢研纳克	333,900	6,157,116.00	0.16
237	603466	风语筑	436,000	6,060,400.00	0.16
238	688519	南亚新材	251,100	6,033,933.00	0.16
239	601211	国泰君安	427,400	5,979,326.00	0.16
240	601021	春秋航空	103,700	5,959,639.00	0.16
241	600909	华安证券	1,267,800	5,920,626.00	0.15
242	600131	国网信通	292,000	5,895,480.00	0.15
243	300384	三联虹普	346,400	5,885,336.00	0.15
244	603993	洛阳钼业	1,103,900	5,883,787.00	0.15
245	688131	皓元医药	102,800	5,857,544.00	0.15
246	603725	天安新材	686,500	5,581,245.00	0.15
247	300717	华信新材	325,531	5,550,303.55	0.14
248	688338	赛科希德	99,400	5,511,730.00	0.14
249	600019	宝钢股份	980,500	5,510,410.00	0.14

250	601688	华泰证券	399,100	5,495,607.00	0.14
251	601607	上海医药	244,500	5,479,245.00	0.14
252	002942	新农股份	301,530	5,472,769.50	0.14
253	002830	名雕股份	426,100	5,458,341.00	0.14
254	002779	中坚科技	207,100	5,448,801.00	0.14
255	688215	瑞晟智能	137,942	5,440,432.48	0.14
256	301005	超捷股份	189,500	5,419,700.00	0.14
257	600674	川投能源	358,400	5,393,920.00	0.14
258	603416	信捷电气	130,000	5,370,300.00	0.14
259	002979	雷赛智能	221,100	5,253,336.00	0.14
260	002454	松芝股份	620,100	5,252,247.00	0.14
261	000028	国药一致	119,930	5,230,147.30	0.14
262	605009	豪悦护理	108,200	5,193,600.00	0.14
263	002465	海格通信	488,500	5,051,090.00	0.13
264	688588	凌志软件	322,800	5,019,540.00	0.13
265	300388	节能国祯	746,000	5,005,660.00	0.13
266	603677	奇精机械	365,300	4,942,509.00	0.13
267	688137	近岸蛋白	95,500	4,916,340.00	0.13
268	000728	国元证券	751,600	4,900,432.00	0.13
269	688096	京源环保	492,260	4,843,838.40	0.13
270	000627	天茂集团	1,604,600	4,813,800.00	0.13
271	002659	凯文教育	999,100	4,775,698.00	0.12
272	601618	中国中冶	1,202,001	4,771,943.97	0.12
273	601163	三角轮胎	300,100	4,762,587.00	0.12
274	603326	我乐家居	593,700	4,636,797.00	0.12
275	605499	东鹏饮料	26,600	4,599,140.00	0.12
276	002198	嘉应制药	512,000	4,592,640.00	0.12
277	603499	翔港科技	478,800	4,567,752.00	0.12
278	600050	中国联通	950,800	4,563,840.00	0.12
279	601816	京沪高铁	866,200	4,556,212.00	0.12
280	688618	三旺通信	66,740	4,519,632.80	0.12
281	000568	泸州老窖	21,127	4,427,585.39	0.12
282	002797	第一创业	773,200	4,422,704.00	0.12
283	300428	立中集团	191,000	4,404,460.00	0.11
284	300621	维业股份	436,550	4,369,865.50	0.11
285	603289	泰瑞机器	388,700	4,361,214.00	0.11
286	603615	茶花股份	454,000	4,285,760.00	0.11
287	002238	天威视讯	615,400	4,264,722.00	0.11
288	300832	新产业	70,380	4,152,420.00	0.11
289	603950	长源东谷	274,640	4,108,614.40	0.11
290	301099	雅创电子	78,800	4,102,328.00	0.11
291	605098	行动教育	102,600	4,061,934.00	0.11
292	601886	江河集团	455,300	4,047,617.00	0.11

293	002988	豪美新材	235,000	4,016,150.00	0.10
294	600036	招商银行	121,200	3,970,512.00	0.10
295	603535	嘉诚国际	244,300	3,967,432.00	0.10
296	002712	思美传媒	603,100	3,956,336.00	0.10
297	688072	拓荆科技	9,200	3,918,924.00	0.10
298	603328	依顿电子	470,100	3,892,428.00	0.10
299	688683	莱尔科技	174,600	3,884,850.00	0.10
300	300059	东方财富	272,800	3,873,760.00	0.10
301	688002	睿创微纳	85,400	3,825,920.00	0.10
302	600315	上海家化	131,700	3,820,617.00	0.10
303	000685	中山公用	504,500	3,819,065.00	0.10
304	002937	兴瑞科技	152,700	3,756,420.00	0.10
305	600380	健康元	295,500	3,755,805.00	0.10
306	601555	东吴证券	526,540	3,654,187.60	0.10
307	002724	海洋王	420,700	3,651,676.00	0.10
308	601003	柳钢股份	898,100	3,628,324.00	0.09
309	603186	华正新材	105,300	3,622,320.00	0.09
310	688390	固德威	21,669	3,615,689.34	0.09
311	605339	南侨食品	180,200	3,587,782.00	0.09
312	002020	京新药业	278,000	3,563,960.00	0.09
313	300286	安科瑞	93,500	3,539,910.00	0.09
314	605300	佳禾食品	162,300	3,528,402.00	0.09
315	003028	振邦智能	84,000	3,512,040.00	0.09
316	688219	会通股份	367,262	3,507,352.10	0.09
317	603871	嘉友国际	222,131	3,489,678.01	0.09
318	002683	广东宏大	118,500	3,488,640.00	0.09
319	002397	梦洁股份	1,005,000	3,487,350.00	0.09
320	001209	洪兴股份	194,040	3,455,852.40	0.09
321	601668	中国建筑	597,900	3,431,946.00	0.09
322	688667	菱电电控	45,700	3,410,591.00	0.09
323	002128	电投能源	257,100	3,398,862.00	0.09
324	688202	美迪西	38,600	3,290,650.00	0.09
325	600583	海油工程	555,200	3,247,920.00	0.08
326	300445	康斯特	204,400	3,239,740.00	0.08
327	605288	凯迪股份	75,000	3,228,000.00	0.08
328	603706	东方环宇	213,500	3,213,175.00	0.08
329	301043	绿岛风	100,000	3,197,000.00	0.08
330	300993	玉马遮阳	278,630	3,190,313.50	0.08
331	603729	龙韵股份	213,000	3,180,090.00	0.08
332	600248	陕建股份	666,100	3,177,297.00	0.08
333	603129	春风动力	19,500	3,157,050.00	0.08
334	600990	四创电子	99,300	3,141,852.00	0.08
335	003012	东鹏控股	386,700	3,128,403.00	0.08

336	002285	世联行	1,218,800	3,120,128.00	0.08
337	688350	富淼科技	181,100	3,076,889.00	0.08
338	002494	华斯股份	664,500	3,076,635.00	0.08
339	000516	国际医学	365,100	3,070,491.00	0.08
340	300277	海联讯	390,900	3,064,656.00	0.08
341	002727	一心堂	115,900	3,059,760.00	0.08
342	601186	中国铁建	308,500	3,038,725.00	0.08
343	600837	海通证券	329,200	3,035,224.00	0.08
344	002976	瑞玛精密	107,900	3,017,963.00	0.08
345	600989	宝丰能源	238,800	3,011,268.00	0.08
346	688186	广大特材	92,500	3,009,025.00	0.08
347	688396	华润微	57,300	3,003,093.00	0.08
348	603012	创力集团	483,600	2,983,812.00	0.08
349	002299	圣农发展	155,500	2,977,825.00	0.08
350	600600	青岛啤酒	28,600	2,963,818.00	0.08
351	603969	银龙股份	641,410	2,963,314.20	0.08
352	000686	东北证券	425,000	2,949,500.00	0.08
353	603609	禾丰股份	323,181	2,940,947.10	0.08
354	300009	安科生物	291,800	2,918,000.00	0.08
355	601818	光大银行	945,000	2,901,150.00	0.08
356	600363	联创光电	78,100	2,897,510.00	0.08
357	002032	苏泊尔	57,700	2,885,000.00	0.08
358	301106	骏成科技	80,600	2,870,972.00	0.07
359	601500	通用股份	694,240	2,839,441.60	0.07
360	603177	德创环保	225,100	2,809,248.00	0.07
361	300304	云意电气	505,200	2,798,808.00	0.07
362	688398	赛特新材	80,345	2,743,781.75	0.07
363	603589	口子窖	55,200	2,724,120.00	0.07
364	600635	大众公用	804,400	2,670,608.00	0.07
365	000698	沈阳化工	648,200	2,664,102.00	0.07
366	688120	华海清科	10,532	2,654,590.60	0.07
367	600020	中原高速	722,800	2,652,676.00	0.07
368	601390	中国中铁	346,700	2,627,986.00	0.07
369	002106	莱宝高科	307,300	2,612,050.00	0.07
370	688428	诺诚健华	226,000	2,610,300.00	0.07
371	688619	罗普特	173,600	2,609,208.00	0.07
372	603833	欧派家居	27,100	2,596,180.00	0.07
373	600681	百川能源	553,600	2,585,312.00	0.07
374	605056	咸亨国际	180,834	2,562,417.78	0.07
375	603365	水星家纺	175,100	2,461,906.00	0.06
376	000596	古井贡酒	9,700	2,399,586.00	0.06
377	688379	华光新材	116,742	2,371,030.02	0.06
378	601968	宝钢包装	329,000	2,368,800.00	0.06

379	300661	圣邦股份	28,600	2,348,918.00	0.06
380	002176	江特电机	195,900	2,335,128.00	0.06
381	300487	蓝晓科技	37,350	2,331,387.00	0.06
382	600835	上海机电	134,200	2,305,556.00	0.06
383	002739	万达电影	181,800	2,279,772.00	0.06
384	002415	海康威视	68,800	2,277,968.00	0.06
385	601966	玲珑轮胎	102,500	2,277,550.00	0.06
386	600566	济川药业	78,300	2,273,832.00	0.06
387	688109	品茗科技	87,768	2,273,191.20	0.06
388	603669	灵康药业	486,929	2,264,219.85	0.06
389	002242	九阳股份	151,100	2,258,945.00	0.06
390	300865	大宏立	103,700	2,241,994.00	0.06
391	300866	安克创新	25,600	2,240,000.00	0.06
392	600182	S 佳通	140,200	2,220,768.00	0.06
393	600338	西藏珠峰	121,300	2,214,938.00	0.06
394	600792	云煤能源	653,700	2,202,969.00	0.06
395	603320	迪贝电气	148,400	2,157,736.00	0.06
396	600329	达仁堂	47,000	2,109,830.00	0.06
397	000538	云南白药	39,600	2,078,208.00	0.05
398	688366	昊海生科	24,600	2,071,812.00	0.05
399	600901	江苏金租	499,960	2,064,834.80	0.05
400	603848	好太太	128,900	2,062,400.00	0.05
401	688681	科汇股份	127,200	2,055,552.00	0.05
402	000629	钒钛股份	525,000	2,052,750.00	0.05
403	603600	永艺股份	214,600	2,040,846.00	0.05
404	688689	银河微电	76,900	1,984,020.00	0.05
405	000166	申万宏源	425,500	1,965,810.00	0.05
406	603915	国茂股份	92,700	1,963,386.00	0.05
407	603992	松霖科技	127,700	1,958,918.00	0.05
408	603226	菲林格尔	380,000	1,938,000.00	0.05
409	601958	金钼股份	167,900	1,872,085.00	0.05
410	300889	爱克股份	124,900	1,869,753.00	0.05
411	600562	国睿科技	114,900	1,861,380.00	0.05
412	688685	迈信林	87,700	1,855,732.00	0.05
413	002899	英派斯	121,900	1,824,843.00	0.05
414	002270	华明装备	161,100	1,764,045.00	0.05
415	603899	晨光股份	39,400	1,758,816.00	0.05
416	002250	联化科技	167,400	1,751,004.00	0.05
417	002996	顺博合金	144,300	1,746,030.00	0.05
418	300718	长盛轴承	77,600	1,726,600.00	0.05
419	688386	泛亚微透	40,990	1,721,580.00	0.04
420	002600	领益智造	245,200	1,694,332.00	0.04
421	300622	博士眼镜	71,400	1,685,040.00	0.04

422	300679	电连技术	50,300	1,662,415.00	0.04
423	002973	侨银股份	142,600	1,654,160.00	0.04
424	600958	东方证券	164,800	1,598,560.00	0.04
425	300512	中亚股份	176,000	1,594,560.00	0.04
426	600626	申达股份	461,500	1,592,175.00	0.04
427	002811	郑中设计	199,070	1,578,625.10	0.04
428	002790	瑞尔特	163,900	1,573,440.00	0.04
429	300101	振芯科技	81,000	1,570,590.00	0.04
430	603989	艾华集团	73,600	1,550,016.00	0.04
431	000785	居然之家	406,100	1,547,241.00	0.04
432	600919	江苏银行	208,000	1,528,800.00	0.04
433	301326	捷邦科技	39,996	1,521,047.88	0.04
434	000551	创元科技	134,600	1,495,406.00	0.04
435	300691	联合光电	84,300	1,485,366.00	0.04
436	002154	报喜鸟	262,700	1,450,104.00	0.04
437	603279	景津装备	45,940	1,440,678.40	0.04
438	603303	得邦照明	101,700	1,404,477.00	0.04
439	688026	洁特生物	75,500	1,379,385.00	0.04
440	601088	中国神华	44,800	1,377,600.00	0.04
441	000777	中核科技	102,000	1,375,980.00	0.04
442	601869	长飞光纤	36,600	1,354,566.00	0.04
443	605183	确成股份	74,100	1,341,210.00	0.03
444	002533	金杯电工	161,900	1,321,104.00	0.03
445	688293	奥浦迈	27,400	1,306,158.00	0.03
446	600229	城市传媒	153,000	1,303,560.00	0.03
447	603386	骏亚科技	114,700	1,301,845.00	0.03
448	600511	国药股份	33,000	1,282,050.00	0.03
449	688660	电气风电	224,800	1,252,136.00	0.03
450	300699	光威复材	40,540	1,250,659.00	0.03
451	002130	沃尔核材	153,700	1,248,044.00	0.03
452	688310	迈得医疗	37,380	1,224,942.60	0.03
453	300770	新媒股份	26,700	1,224,462.00	0.03
454	688143	长盈通	32,370	1,220,349.00	0.03
455	002852	道道全	93,100	1,203,783.00	0.03
456	600271	航天信息	86,400	1,182,816.00	0.03
457	600927	永安期货	72,200	1,173,972.00	0.03
458	603180	金牌厨柜	34,000	1,139,680.00	0.03
459	688626	翔宇医疗	24,500	1,114,995.00	0.03
460	600054	黄山旅游	86,900	1,112,320.00	0.03
461	601808	中海油服	79,400	1,102,072.00	0.03
462	000883	湖北能源	240,600	1,097,136.00	0.03
463	000906	浙商中拓	122,400	1,091,808.00	0.03
464	300127	银河磁体	59,700	1,082,361.00	0.03

465	300791	仙乐健康	36,800	1,068,672.00	0.03
466	002673	西部证券	166,500	1,057,275.00	0.03
467	300547	川环科技	63,400	1,056,878.00	0.03
468	300224	正海磁材	81,300	1,045,518.00	0.03
469	002294	信立泰	33,500	1,044,865.00	0.03
470	603496	恒为科技	55,600	1,044,168.00	0.03
471	605155	西大门	71,300	1,034,563.00	0.03
472	688230	芯导科技	22,820	1,033,974.20	0.03
473	603059	倍加洁	45,300	1,030,122.00	0.03
474	688611	杭州柯林	23,500	1,006,975.00	0.03
475	002160	常铝股份	248,600	1,004,344.00	0.03
476	601766	中国中车	153,200	995,800.00	0.03
477	603689	皖天然气	112,640	987,852.80	0.03
478	603321	梅轮电梯	126,700	986,993.00	0.03
479	002653	海思科	41,800	986,480.00	0.03
480	603167	渤海轮渡	131,500	933,650.00	0.02
481	000027	深圳能源	131,300	865,267.00	0.02
482	603309	维力医疗	53,760	831,667.20	0.02
483	688601	力芯微	17,600	828,960.00	0.02
484	603598	引力传媒	79,100	827,386.00	0.02
485	000630	铜陵有色	282,300	815,847.00	0.02
486	603383	顶点软件	14,100	781,422.00	0.02
487	603979	金诚信	24,500	761,950.00	0.02
488	603390	通达电气	89,100	748,440.00	0.02
489	002092	中泰化学	115,200	743,040.00	0.02
490	002158	汉钟精机	29,700	741,312.00	0.02
491	000548	湖南投资	152,500	738,100.00	0.02
492	002327	富安娜	85,500	719,910.00	0.02
493	603171	税友股份	17,500	699,650.00	0.02
494	002900	哈三联	52,200	697,914.00	0.02
495	601518	吉林高速	287,340	683,869.20	0.02
496	688799	华纳药厂	16,700	678,354.00	0.02
497	002508	老板电器	26,570	671,955.30	0.02
498	002861	瀛通通讯	56,900	650,936.00	0.02
499	603355	莱克电气	25,327	643,559.07	0.02
500	600184	光电股份	48,800	640,744.00	0.02
501	600754	锦江酒店	14,600	618,164.00	0.02
502	000048	京基智农	31,000	605,120.00	0.02
503	300418	昆仑万维	14,800	596,144.00	0.02
504	688079	美迪凯	51,800	579,642.00	0.02
505	002016	世荣兆业	84,500	562,770.00	0.01
506	600689	上海三毛	59,000	551,650.00	0.01
507	002237	恒邦股份	49,300	536,877.00	0.01

508	000967	盈峰环境	105,400	532,270.00	0.01
509	300405	科隆股份	95,076	520,065.72	0.01
510	600997	开滦股份	86,100	514,017.00	0.01
511	600702	舍得酒业	4,000	495,800.00	0.01
512	300873	海晨股份	23,900	475,371.00	0.01
513	688389	普门科技	19,375	455,118.75	0.01
514	603103	横店影视	26,800	451,312.00	0.01
515	688106	金宏气体	16,400	446,080.00	0.01
516	688278	特宝生物	9,826	431,459.66	0.01
517	688270	臻镭科技	6,580	427,239.40	0.01
518	603239	浙江仙通	25,700	418,139.00	0.01
519	600598	北大荒	30,700	409,231.00	0.01
520	601369	陕鼓动力	44,200	402,662.00	0.01
521	301328	维峰电子	6,950	395,733.00	0.01
522	301291	明阳电气	12,054	391,066.98	0.01
523	002887	绿茵生态	41,600	378,144.00	0.01
524	600642	申能股份	51,800	362,082.00	0.01
525	603156	养元饮品	14,600	360,620.00	0.01
526	600129	太极集团	6,000	356,940.00	0.01
527	603602	纵横通信	29,000	356,410.00	0.01
528	600638	新黄浦	66,200	350,198.00	0.01
529	603369	今世缘	6,500	343,200.00	0.01
530	603958	哈森股份	43,800	335,946.00	0.01
531	688318	财富趋势	3,300	329,901.00	0.01
532	688698	伟创电气	7,800	311,844.00	0.01
533	601825	沪农商行	57,200	311,740.00	0.01
534	688777	中控技术	4,759	298,770.02	0.01
535	300930	屹通新材	11,600	289,420.00	0.01
536	603368	柳药集团	11,600	286,636.00	0.01
537	603238	诺邦股份	22,600	284,986.00	0.01
538	300034	钢研高纳	7,100	279,669.00	0.01
539	301486	致尚科技	4,820	277,921.20	0.01
540	300382	斯莱克	20,300	267,757.00	0.01
541	600166	福田汽车	75,000	255,000.00	0.01
542	002304	洋河股份	1,900	249,565.00	0.01
543	002048	宁波华翔	18,400	246,560.00	0.01
544	688658	悦康药业	11,400	237,234.00	0.01
545	601007	金陵饭店	27,600	235,152.00	0.01
546	600933	爱柯迪	9,700	225,913.00	0.01
547	002148	北纬科技	36,600	223,260.00	0.01
548	300207	欣旺达	12,100	197,472.00	0.01
549	603682	锦和商管	36,900	193,725.00	0.01
550	000937	冀中能源	29,800	190,124.00	0.00

551	002829	星网宇达	4,300	188,899.00	0.00
552	688227	品高股份	7,400	183,742.00	0.00
553	002133	广宇集团	52,200	176,958.00	0.00
554	002131	利欧股份	70,000	161,000.00	0.00
555	301397	溯联股份	3,618	152,606.80	0.00
556	301210	金杨股份	2,801	143,168.37	0.00
557	600287	江苏舜天	27,800	142,058.00	0.00
558	601898	中煤能源	16,500	139,260.00	0.00
559	301395	仁信新材	5,196	138,629.28	0.00
560	688249	晶合集成	7,405	133,734.30	0.00
561	301292	海科新源	5,824	116,421.76	0.00
562	300329	海伦钢琴	15,300	108,171.00	0.00
563	688472	阿特斯	6,261	106,687.44	0.00
564	301488	豪恩汽电	2,618	104,144.04	0.00
565	000898	鞍钢股份	36,400	101,192.00	0.00
566	002841	视源股份	1,500	100,260.00	0.00
567	002088	鲁阳节能	5,400	99,576.00	0.00
568	603579	荣泰健康	4,600	96,232.00	0.00
569	688443	智翔金泰	3,033	89,443.17	0.00
570	300033	同花顺	500	87,640.00	0.00
571	300219	鸿利智汇	11,200	82,320.00	0.00
572	300751	迈为股份	480	81,302.40	0.00
573	002967	广电计量	4,000	80,360.00	0.00
574	301202	朗威股份	3,060	79,009.20	0.00
575	300804	广康生化	2,257	77,134.83	0.00
576	688603	天承科技	1,391	76,505.00	0.00
577	688469	中芯集成	13,800	74,658.00	0.00
578	002851	麦格米特	2,000	72,940.00	0.00
579	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	0.00
580	603639	海利尔	3,800	68,096.00	0.00
581	002544	普天科技	2,700	61,830.00	0.00
582	688361	中科飞测	831	53,740.77	0.00
583	301339	通行宝	2,000	50,260.00	0.00
584	301325	曼恩斯特	364	39,293.80	0.00
585	301006	迈拓股份	1,500	39,225.00	0.00
586	688531	日联科技	283	38,479.51	0.00
587	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.00
588	688146	中船特气	919	35,041.47	0.00
589	688484	南芯科技	870	31,937.70	0.00
590	688576	西山科技	240	28,898.40	0.00
591	001287	中电港	1,365	28,692.30	0.00
592	688352	颀中科技	2,361	28,497.27	0.00
593	301358	湖南裕能	645	27,664.05	0.00

594	688507	索辰科技	222	27,108.42	0.00
595	301310	鑫宏业	409	26,760.87	0.00
596	688582	芯动联科	648	26,360.64	0.00
597	000998	隆平高科	1,700	26,095.00	0.00
598	301293	三博脑科	333	23,782.86	0.00
599	605116	奥锐特	900	22,752.00	0.00
600	688552	航天南湖	956	22,466.00	0.00
601	688570	天玛智控	884	22,391.72	0.00
602	301307	美利信	687	21,887.82	0.00
603	688543	国科军工	410	21,750.50	0.00
604	688458	美芯晟	221	20,057.96	0.00
605	301303	真兰仪表	878	19,596.96	0.00
606	688581	安杰思	163	19,238.89	0.00
607	301317	鑫磊股份	694	18,161.98	0.00
608	301262	海看股份	692	17,646.00	0.00
609	301383	天键股份	493	17,609.96	0.00
610	688562	航天软件	726	16,197.06	0.00
611	688623	双元科技	178	15,448.62	0.00
612	301332	德尔玛	1,122	15,405.06	0.00
613	301399	英特科技	293	15,110.01	0.00
614	301305	朗坤环境	753	14,826.57	0.00
615	301387	光大同创	307	13,925.52	0.00
616	688512	慧智微	721	13,814.36	0.00
617	301382	蜂助手	408	13,398.72	0.00
618	688433	华曙高科	418	13,167.00	0.00
619	301360	荣旗科技	134	12,408.40	0.00
620	301439	泓淋电力	693	11,711.70	0.00
621	688523	航天环宇	472	11,257.20	0.00
622	603135	中重科技	628	11,234.92	0.00
623	301141	中科磁业	262	11,184.78	0.00
624	301225	恒勃股份	333	11,075.58	0.00
625	301429	森泰股份	499	10,488.98	0.00
626	601065	江盐集团	875	10,360.00	0.00
627	688631	莱斯信息	336	10,036.32	0.00
628	688479	友车科技	332	9,790.68	0.00
629	301232	飞沃科技	165	9,639.30	0.00
630	301376	致欧科技	420	9,454.20	0.00
631	301355	南王科技	563	9,430.25	0.00
632	301357	北方长龙	190	9,194.10	0.00
633	301386	未来电器	378	8,992.62	0.00
634	301323	新莱福	228	8,974.08	0.00
635	688429	时创能源	346	8,833.38	0.00
636	301170	锡南科技	250	8,732.50	0.00

637	301281	科源制药	337	8,458.70	0.00
638	688535	华海诚科	161	8,248.03	0.00
639	601133	柏诚股份	664	8,140.64	0.00
640	301157	华塑科技	150	7,939.50	0.00
641	301295	美硕科技	215	7,755.05	0.00
642	301203	国泰环保	225	7,740.00	0.00
643	301345	涛涛车业	153	7,135.92	0.00
644	301337	亚华电子	232	7,045.84	0.00
645	301428	世纪恒通	229	7,007.40	0.00
646	001380	华纬科技	170	5,232.60	0.00
647	603125	常青科技	160	3,924.80	0.00
648	001328	登康口腔	145	3,696.05	0.00
649	001282	三联锻造	105	3,468.15	0.00
650	001360	南矿集团	177	2,631.99	0.00
651	001324	长青科技	114	2,234.40	0.00
652	001367	海森药业	55	2,171.40	0.00
653	603172	万丰股份	122	1,967.86	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	002027	分众传媒	31,938,345.00	7.51
2	603861	白云电器	30,004,921.97	7.05
3	300003	乐普医疗	29,757,449.00	6.99
4	002749	国光股份	29,585,721.32	6.95
5	600582	天地科技	28,095,758.00	6.60
6	603556	海兴电力	27,954,755.72	6.57
7	000623	吉林敖东	27,941,064.75	6.57
8	603444	吉比特	26,349,269.00	6.19
9	002203	海亮股份	25,915,199.00	6.09
10	603551	奥普家居	25,637,849.00	6.02
11	300767	震安科技	24,698,825.97	5.80
12	301028	东亚机械	24,536,436.00	5.77
13	688013	天臣医疗	24,278,343.44	5.71
14	601328	交通银行	23,953,539.67	5.63
15	000333	美的集团	23,793,724.00	5.59
16	002990	盛视科技	23,473,401.66	5.52
17	600845	宝信软件	23,272,758.37	5.47
18	601888	中国中免	23,077,351.24	5.42
19	688718	唯赛勃	22,875,965.39	5.38
20	300719	安达维尔	22,650,746.56	5.32

21	000513	丽珠集团	22,514,594.21	5.29
22	601939	建设银行	22,477,619.16	5.28
23	002774	快意电梯	22,114,313.00	5.20
24	601728	中国电信	22,055,910.00	5.18
25	601398	工商银行	21,923,265.00	5.15
26	600662	外服控股	21,695,977.00	5.10
27	601857	中国石油	21,473,801.00	5.05
28	688012	中微公司	21,312,605.74	5.01
29	002698	博实股份	21,242,661.44	4.99
30	688093	世华科技	21,068,120.85	4.95
31	000725	京东方 A	20,760,921.00	4.88
32	600968	海油发展	20,673,141.00	4.86
33	601336	新华保险	20,561,588.67	4.83
34	688655	迅捷兴	20,556,420.62	4.83
35	601601	中国太保	20,554,654.00	4.83
36	688777	中控技术	20,470,332.56	4.81
37	601318	中国平安	20,405,250.44	4.80
38	600162	香江控股	20,155,507.00	4.74
39	688336	三生国健	20,096,677.25	4.72
40	002732	燕塘乳业	20,029,124.67	4.71
41	002879	长缆科技	19,993,539.20	4.70
42	002028	思源电气	19,937,306.00	4.69
43	002322	理工能科	19,827,442.50	4.66
44	688616	西力科技	19,637,530.44	4.61
45	600028	中国石化	19,444,773.00	4.57
46	600761	安徽合力	19,159,395.20	4.50
47	601288	农业银行	19,046,396.00	4.48
48	603508	思维列控	19,017,172.35	4.47
49	601006	大秦铁路	18,957,050.00	4.45
50	688100	威胜信息	18,893,372.90	4.44
51	000063	中兴通讯	18,748,900.00	4.41
52	300896	爱美客	18,730,015.40	4.40
53	688670	金迪克	18,643,483.07	4.38
54	002818	富森美	18,616,025.30	4.37
55	000020	深华发 A	18,500,243.00	4.35
56	002152	广电运通	18,396,655.00	4.32
57	688819	天能股份	18,045,144.23	4.24
58	601577	长沙银行	17,833,659.00	4.19
59	600161	天坛生物	17,817,540.00	4.19
60	000060	中金岭南	17,618,594.32	4.14
61	603758	秦安股份	17,588,819.00	4.13
62	300697	电工合金	17,404,526.00	4.09
63	600167	联美控股	17,350,693.00	4.08

64	688288	鸿泉物联	17,342,397.45	4.08
65	000811	冰轮环境	17,307,282.00	4.07
66	688210	统联精密	17,271,156.49	4.06
67	603878	武进不锈	17,091,328.00	4.02
68	600830	香溢融通	17,066,118.00	4.01
69	002273	水晶光电	17,022,259.50	4.00
70	601686	友发集团	16,946,428.00	3.98
71	600826	兰生股份	16,870,667.00	3.96
72	600519	贵州茅台	16,819,128.00	3.95
73	601816	京沪高铁	16,806,808.00	3.95
74	601326	秦港股份	16,716,684.89	3.93
75	300805	电声股份	16,542,069.00	3.89
76	601668	中国建筑	16,494,846.00	3.88
77	603855	华荣股份	16,408,798.00	3.86
78	688032	禾迈股份	16,370,192.76	3.85
79	688390	固德威	16,346,756.30	3.84
80	605167	利柏特	16,165,480.00	3.80
81	300621	维业股份	16,114,628.50	3.79
82	002111	威海广泰	16,056,364.00	3.77
83	002014	永新股份	16,014,609.60	3.76
84	601899	紫金矿业	16,010,095.00	3.76
85	300749	顶固集创	15,861,734.00	3.73
86	300033	同花顺	15,845,265.00	3.72
87	002763	汇洁股份	15,820,408.00	3.72
88	002595	豪迈科技	15,817,776.00	3.72
89	300602	飞荣达	15,782,181.00	3.71
90	603103	横店影视	15,698,189.00	3.69
91	600941	中国移动	15,620,104.00	3.67
92	002236	大华股份	15,593,429.00	3.66
93	605177	东亚药业	15,584,598.00	3.66
94	601138	工业富联	15,583,385.00	3.66
95	600019	宝钢股份	15,571,888.66	3.66
96	600864	哈投股份	15,504,051.41	3.64
97	600039	四川路桥	15,498,486.00	3.64
98	688109	品茗科技	15,454,698.31	3.63
99	603167	渤海轮渡	15,430,500.00	3.63
100	000426	兴业银锡	15,393,563.00	3.62
101	300009	安科生物	15,378,347.40	3.61
102	600886	国投电力	15,153,804.60	3.56
103	002930	宏川智慧	15,134,458.48	3.56
104	003006	百亚股份	15,102,754.00	3.55
105	603630	拉芳家化	15,089,804.60	3.55
106	688981	中芯国际	15,086,741.71	3.55

107	002275	桂林三金	15,043,238.27	3.54
108	003816	中国广核	14,870,162.00	3.49
109	603421	鼎信通讯	14,838,666.12	3.49
110	688659	元琛科技	14,828,012.77	3.48
111	000980	众泰汽车	14,808,901.00	3.48
112	002410	广联达	14,795,755.80	3.48
113	603511	爱慕股份	14,779,567.00	3.47
114	301076	新瀚新材	14,747,309.75	3.47
115	603515	欧普照明	14,697,604.50	3.45
116	300074	华平股份	14,679,817.00	3.45
117	000429	粤高速 A	14,640,957.84	3.44
118	000923	河钢资源	14,549,269.00	3.42
119	601958	金钼股份	14,484,348.00	3.40
120	000627	天茂集团	14,419,222.00	3.39
121	600229	城市传媒	14,392,829.00	3.38
122	002855	捷荣技术	14,239,680.00	3.35
123	688448	磁谷科技	14,219,781.23	3.34
124	600362	江西铜业	14,196,697.00	3.34
125	000987	越秀资本	14,143,609.00	3.32
126	002287	奇正藏药	14,143,565.00	3.32
127	601588	北辰实业	14,109,600.00	3.32
128	603993	洛阳钼业	14,096,977.00	3.31
129	300316	晶盛机电	14,057,811.86	3.30
130	600517	国网英大	14,054,103.00	3.30
131	600757	长江传媒	13,993,190.00	3.29
132	601169	北京银行	13,962,700.00	3.28
133	600626	申达股份	13,950,812.00	3.28
134	002801	微光股份	13,900,006.00	3.27
135	002811	郑中设计	13,897,741.30	3.27
136	300430	诚益通	13,825,959.00	3.25
137	002683	广东宏大	13,733,679.00	3.23
138	000783	长江证券	13,690,419.00	3.22
139	003008	开普检测	13,668,352.00	3.21
140	000030	富奥股份	13,658,363.00	3.21
141	600729	重庆百货	13,620,408.01	3.20
142	300515	三德科技	13,552,396.00	3.18
143	688510	航亚科技	13,542,650.54	3.18
144	600828	茂业商业	13,471,622.00	3.17
145	300059	东方财富	13,348,969.00	3.14
146	688348	昱能科技	13,338,889.58	3.13
147	601139	深圳燃气	13,227,283.30	3.11
148	688132	邦彦技术	13,218,199.61	3.11
149	002563	森马服饰	13,213,150.00	3.11

150	600036	招商银行	13,182,653.00	3.10
151	002372	伟星新材	13,179,995.00	3.10
152	605128	上海沿浦	13,122,471.03	3.08
153	000608	阳光股份	13,080,148.10	3.07
154	600261	阳光照明	13,064,315.00	3.07
155	002249	大洋电机	12,968,875.00	3.05
156	603839	安正时尚	12,963,299.00	3.05
157	688678	福立旺	12,958,295.06	3.05
158	603657	春光科技	12,869,070.00	3.02
159	002739	万达电影	12,835,457.00	3.02
160	688700	东威科技	12,785,158.34	3.00
161	002988	豪美新材	12,766,545.00	3.00
162	002500	山西证券	12,753,858.00	3.00
163	600989	宝丰能源	12,734,098.00	2.99
164	688138	清溢光电	12,689,023.43	2.98
165	688267	中触媒	12,659,567.38	2.98
166	600276	恒瑞医药	12,625,969.20	2.97
167	601607	上海医药	12,623,421.00	2.97
168	603729	龙韵股份	12,604,377.20	2.96
169	600061	国投资本	12,561,022.36	2.95
170	688226	威腾电气	12,555,998.38	2.95
171	688073	毕得医药	12,541,469.93	2.95
172	600900	长江电力	12,521,022.00	2.94
173	688078	龙软科技	12,490,712.19	2.94
174	603613	国联股份	12,439,783.32	2.92
175	300750	宁德时代	12,389,594.00	2.91
176	688560	明冠新材	12,383,932.67	2.91
177	002381	双箭股份	12,357,162.00	2.90
178	600897	厦门空港	12,350,005.00	2.90
179	600007	中国国贸	12,340,980.75	2.90
180	603040	新坐标	12,337,472.00	2.90
181	688320	禾川科技	12,310,699.88	2.89
182	300314	戴维医疗	12,273,106.00	2.88
183	300509	新美星	12,242,375.25	2.88
184	002611	东方精工	12,234,529.00	2.88
185	603006	联明股份	12,184,978.00	2.86
186	600628	新世界	12,174,367.00	2.86
187	603628	清源股份	12,151,992.00	2.86
188	688696	极米科技	12,108,782.82	2.85
189	603488	展鹏科技	12,097,018.80	2.84
190	605066	天正电气	12,083,924.00	2.84
191	603053	成都燃气	12,081,081.00	2.84
192	000717	中南股份	12,071,230.00	2.84

193	300587	天铁股份	12,021,083.00	2.82
194	603326	我乐家居	12,014,250.04	2.82
195	601567	三星医疗	11,998,343.00	2.82
196	688519	南亚新材	11,920,492.65	2.80
197	688080	映翰通	11,888,290.44	2.79
198	603766	隆鑫通用	11,849,510.00	2.78
199	300433	蓝思科技	11,839,349.00	2.78
200	000528	柳工	11,762,000.00	2.76
201	000869	张裕 A	11,629,870.88	2.73
202	000858	五粮液	11,611,852.00	2.73
203	300667	必创科技	11,523,415.00	2.71
204	600548	深高速	11,496,869.00	2.70
205	002690	美亚光电	11,476,823.10	2.70
206	600583	海油工程	11,431,031.00	2.69
207	000655	金岭矿业	11,400,005.00	2.68
208	301099	雅创电子	11,387,812.00	2.68
209	000425	徐工机械	11,369,315.00	2.67
210	601989	中国重工	11,289,016.00	2.65
211	301379	天山电子	11,260,171.01	2.65
212	002516	旷达科技	11,245,814.00	2.64
213	301061	匠心家居	11,223,241.20	2.64
214	603828	柯利达	11,219,421.00	2.64
215	688625	呈和科技	11,188,458.64	2.63
216	300347	泰格医药	11,176,765.00	2.63
217	002625	光启技术	11,141,774.27	2.62
218	300930	屹通新材	11,119,403.00	2.61
219	000878	云南铜业	11,114,925.00	2.61
220	300462	华铭智能	11,105,228.00	2.61
221	000514	渝开发	11,104,001.00	2.61
222	002479	富春环保	11,073,478.00	2.60
223	002367	康力电梯	11,070,339.00	2.60
224	000708	中信特钢	11,066,585.00	2.60
225	603808	歌力思	11,000,320.00	2.59
226	688021	奥福环保	10,987,679.27	2.58
227	603367	辰欣药业	10,916,477.00	2.57
228	002973	侨银股份	10,856,401.00	2.55
229	603499	翔港科技	10,810,948.00	2.54
230	600927	永安期货	10,802,642.00	2.54
231	000818	航锦科技	10,735,746.60	2.52
232	002978	安宁股份	10,730,433.28	2.52
233	601019	山东出版	10,661,203.00	2.51
234	000917	电广传媒	10,593,719.00	2.49
235	688125	安达智能	10,578,946.83	2.49

236	000932	华菱钢铁	10,558,233.00	2.48
237	600967	内蒙一机	10,551,065.00	2.48
238	688186	广大特材	10,511,146.73	2.47
239	002032	苏泊尔	10,481,007.00	2.46
240	603680	今创集团	10,472,961.00	2.46
241	600120	浙江东方	10,472,727.00	2.46
242	000997	新大陆	10,449,387.00	2.46
243	300951	博硕科技	10,440,143.00	2.45
244	600025	华能水电	10,432,998.00	2.45
245	301011	华立科技	10,430,955.20	2.45
246	002540	亚太科技	10,430,305.00	2.45
247	000531	穗恒运 A	10,354,802.40	2.43
248	600377	宁沪高速	10,207,573.00	2.40
249	605056	咸亨国际	10,199,996.00	2.40
250	688183	生益电子	10,148,102.81	2.38
251	603527	众源新材	10,142,271.00	2.38
252	600551	时代出版	10,141,856.00	2.38
253	603869	新智认知	10,128,949.90	2.38
254	002176	江特电机	10,079,952.00	2.37
255	002868	绿康生化	10,079,916.00	2.37
256	000777	中核科技	10,048,415.00	2.36
257	002422	科伦药业	10,043,487.00	2.36
258	000590	启迪药业	10,015,033.00	2.35
259	688101	三达膜	10,005,642.79	2.35
260	300832	新产业	9,988,468.00	2.35
261	688395	正弦电气	9,948,786.64	2.34
262	601600	中国铝业	9,911,005.00	2.33
263	002020	京新药业	9,901,577.00	2.33
264	688585	上纬新材	9,895,531.11	2.33
265	603600	永艺股份	9,845,676.00	2.31
266	603228	景旺电子	9,771,322.00	2.30
267	301326	捷邦科技	9,735,838.97	2.29
268	301135	瑞德智能	9,731,973.00	2.29
269	688499	利元亨	9,724,987.18	2.29
270	000651	格力电器	9,722,161.00	2.28
271	601628	中国人寿	9,717,535.00	2.28
272	000045	深纺织 A	9,688,304.00	2.28
273	601988	中国银行	9,647,781.00	2.27
274	603701	德宏股份	9,642,407.00	2.27
275	002745	木林森	9,610,563.00	2.26
276	603351	威尔药业	9,606,363.40	2.26
277	603355	莱克电气	9,581,911.47	2.25
278	002214	大立科技	9,526,412.00	2.24

279	300057	万顺新材	9,477,812.00	2.23
280	002966	苏州银行	9,468,642.00	2.23
281	688360	德马科技	9,445,891.37	2.22
282	002149	西部材料	9,431,168.43	2.22
283	603725	天安新材	9,415,220.20	2.21
284	601012	隆基绿能	9,404,950.40	2.21
285	301182	凯旺科技	9,361,982.70	2.20
286	688219	会通股份	9,359,928.41	2.20
287	605068	明新旭腾	9,353,385.00	2.20
288	000551	创元科技	9,340,457.00	2.20
289	001965	招商公路	9,280,158.99	2.18
290	601086	国芳集团	9,273,618.00	2.18
291	300976	达瑞电子	9,245,237.48	2.17
292	603267	鸿远电子	9,234,064.00	2.17
293	002793	罗欣药业	9,233,823.00	2.17
294	002956	西麦食品	9,214,204.40	2.17
295	300552	万集科技	9,204,977.00	2.16
296	688111	金山办公	9,200,970.42	2.16
297	603587	地素时尚	9,195,760.90	2.16
298	002833	弘亚数控	9,150,762.80	2.15
299	300382	斯莱克	9,141,049.00	2.15
300	601928	凤凰传媒	9,128,562.00	2.15
301	002928	华夏航空	9,115,489.00	2.14
302	300952	恒辉安防	9,111,670.00	2.14
303	603896	寿仙谷	9,038,067.00	2.12
304	300532	今天国际	9,036,677.00	2.12
305	688173	希荻微	9,019,140.80	2.12
306	002936	郑州银行	9,012,307.00	2.12
307	603283	赛腾股份	8,939,364.00	2.10
308	300371	汇中股份	8,895,307.40	2.09
309	000598	兴蓉环境	8,884,605.00	2.09
310	600936	广西广电	8,884,025.00	2.09
311	000568	泸州老窖	8,864,334.77	2.08
312	002130	沃尔核材	8,844,951.00	2.08
313	000563	陕国投 A	8,826,084.35	2.07
314	002345	潮宏基	8,822,255.60	2.07
315	688079	美迪凯	8,817,408.40	2.07
316	002830	名雕股份	8,815,403.00	2.07
317	688528	秦川物联	8,772,387.82	2.06
318	605365	立达信	8,746,711.15	2.06
319	300396	迪瑞医疗	8,738,578.00	2.05
320	688291	金橙子	8,686,303.81	2.04
321	301106	骏成科技	8,668,820.00	2.04

322	000698	沈阳化工	8,666,430.00	2.04
323	688072	拓荆科技	8,652,223.91	2.03
324	601319	中国人保	8,602,702.00	2.02
325	603118	共进股份	8,595,722.00	2.02
326	603669	灵康药业	8,587,796.41	2.02
327	600879	航天电子	8,579,633.00	2.02
328	688350	富淼科技	8,551,538.70	2.01

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	688655	迅捷兴	28,110,566.46	6.61
2	603861	白云电器	22,743,411.00	5.34
3	603444	吉比特	20,133,405.00	4.73
4	688777	中控技术	20,126,511.42	4.73
5	300805	电声股份	19,205,844.00	4.51
6	600162	香江控股	18,860,204.50	4.43
7	300033	同花顺	18,834,436.80	4.43
8	300602	飞荣达	17,803,872.35	4.18
9	603103	横店影视	17,252,232.00	4.05
10	688448	磁谷科技	16,003,498.56	3.76
11	601019	山东出版	15,906,068.00	3.74
12	603630	拉芳家化	15,902,603.40	3.74
13	600229	城市传媒	15,657,418.00	3.68
14	600757	长江传媒	15,475,220.00	3.64
15	688659	元琛科技	15,300,198.20	3.60
16	688032	禾迈股份	15,140,403.02	3.56
17	601668	中国建筑	15,128,528.00	3.56
18	688320	禾川科技	15,126,676.81	3.55
19	300430	诚益通	14,759,166.00	3.47
20	688678	福立旺	14,755,140.61	3.47
21	688109	品茗科技	14,691,608.74	3.45
22	688390	固德威	14,654,171.06	3.44
23	600626	申达股份	14,397,736.08	3.38
24	688348	昱能科技	14,139,736.20	3.32
25	688336	三生国健	13,569,926.14	3.19
26	601588	北辰实业	13,555,753.00	3.19
27	603167	渤海轮渡	13,527,465.76	3.18
28	605128	上海沿浦	13,465,236.66	3.16
29	603613	国联股份	13,408,767.08	3.15
30	601138	工业富联	13,360,743.00	3.14

31	603006	联明股份	13,309,462.00	3.13
32	688700	东威科技	13,275,858.52	3.12
33	002422	科伦药业	13,272,788.10	3.12
34	300316	晶盛机电	13,180,628.81	3.10
35	000020	深华发 A	13,167,439.00	3.09
36	601326	秦港股份	12,980,452.00	3.05
37	688183	生益电子	12,807,231.57	3.01
38	300509	新美星	12,715,902.28	2.99
39	603869	新智认知	12,707,081.30	2.99
40	300750	宁德时代	12,501,862.80	2.94
41	002698	博实股份	12,450,276.84	2.93
42	601958	金钼股份	12,448,284.00	2.93
43	603680	今创集团	12,372,189.70	2.91
44	603527	众源新材	12,340,544.80	2.90
45	300009	安科生物	12,309,650.00	2.89
46	000878	云南铜业	12,277,963.00	2.89
47	601816	京沪高铁	12,247,017.00	2.88
48	600551	时代出版	12,170,393.00	2.86
49	601900	南方传媒	12,136,830.03	2.85
50	002749	国光股份	12,107,068.85	2.85
51	002027	分众传媒	12,050,959.00	2.83
52	300621	维业股份	11,858,482.00	2.79
53	688226	威腾电气	11,833,500.05	2.78
54	688021	奥福环保	11,491,478.17	2.70
55	300930	屹通新材	11,458,930.26	2.69
56	601318	中国平安	11,376,612.00	2.67
57	603828	柯利达	11,305,618.36	2.66
58	600662	外服控股	11,252,830.27	2.64
59	301379	天山电子	11,198,683.92	2.63
60	000917	电广传媒	11,184,779.00	2.63
61	601336	新华保险	11,182,201.00	2.63
62	002811	郑中设计	11,151,036.50	2.62
63	002367	康力电梯	11,085,103.00	2.61
64	688585	上纬新材	10,881,620.13	2.56
65	000655	金岭矿业	10,808,387.00	2.54
66	300059	东方财富	10,792,903.20	2.54
67	301135	瑞德智能	10,785,958.00	2.53
68	300532	今天国际	10,718,118.00	2.52
69	300952	恒辉安防	10,680,082.00	2.51
70	300896	爱美客	10,652,940.00	2.50
71	000627	天茂集团	10,609,552.00	2.49
72	002988	豪美新材	10,533,774.00	2.48
73	002625	光启技术	10,515,512.00	2.47

74	000913	钱江摩托	10,387,238.03	2.44
75	688111	金山办公	10,324,636.59	2.43
76	002739	万达电影	10,213,793.00	2.40
77	603118	共进股份	10,195,450.00	2.40
78	601801	皖新传媒	10,190,173.00	2.39
79	000048	京基智农	10,165,664.73	2.39
80	000651	格力电器	10,149,993.00	2.39
81	601298	青岛港	9,982,912.00	2.35
82	601857	中国石油	9,965,831.05	2.34
83	603228	景旺电子	9,949,008.00	2.34
84	601086	国芳集团	9,933,681.00	2.33
85	688505	复旦张江	9,920,567.31	2.33
86	002868	绿康生化	9,906,979.00	2.33
87	688097	博众精工	9,846,739.42	2.31
88	002683	广东宏大	9,768,877.00	2.30
89	600019	宝钢股份	9,727,791.28	2.29
90	605068	明新旭腾	9,639,309.00	2.27
91	603729	龙韵股份	9,620,539.40	2.26
92	000590	启迪药业	9,581,222.00	2.25
93	000932	华菱钢铁	9,546,522.00	2.24
94	605365	立达信	9,539,441.80	2.24
95	600386	北巴传媒	9,497,477.82	2.23
96	300057	万顺新材	9,472,756.00	2.23
97	688173	希荻微	9,466,906.35	2.22
98	002880	卫光生物	9,461,948.80	2.22
99	002608	江苏国信	9,429,332.98	2.22
100	000761	本钢板材	9,375,363.00	2.20
101	600989	宝丰能源	9,364,185.00	2.20
102	688101	三达膜	9,350,010.11	2.20
103	603326	我乐家居	9,332,752.20	2.19
104	600602	云赛智联	9,331,764.00	2.19
105	600761	安徽合力	9,315,780.00	2.19
106	603351	威尔药业	9,250,104.00	2.17
107	603878	武进不锈	9,247,087.88	2.17
108	002869	金溢科技	9,083,999.62	2.13
109	600927	永安期货	9,076,558.00	2.13
110	002068	黑猫股份	9,030,331.00	2.12
111	002214	大立科技	8,936,891.63	2.10
112	000777	中核科技	8,927,696.86	2.10
113	601601	中国太保	8,909,202.00	2.09
114	688679	通源环境	8,872,867.52	2.09
115	603267	鸿远电子	8,806,528.40	2.07
116	002730	电光科技	8,782,160.00	2.06

117	000933	神火股份	8,773,987.08	2.06
118	600036	招商银行	8,755,662.00	2.06
119	688159	有方科技	8,747,503.08	2.06
120	002236	大华股份	8,736,259.00	2.05
121	605218	伟时电子	8,679,123.00	2.04
122	688291	金橙子	8,673,867.72	2.04
123	600250	南纺股份	8,662,340.00	2.04
124	000831	中国稀土	8,548,787.14	2.01
125	688093	世华科技	8,548,152.10	2.01
126	002973	侨银股份	8,528,219.00	2.00

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	7,400,875,625.87
卖出股票收入（成交）总额	4,335,596,999.00

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	-	-
	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）	131,010.91	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	131,010.91	0.00

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	127086	恒邦转债	1,310	131,010.91	0.00
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

本基金在风险可控的前提下，根据基金合同规定投资股指期货旨在配合基金日常投资管理需要，更有效地进行流动性管理，实现投资目标。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末无国债期货投资。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货投资。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，交通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。

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	6,150,048.00
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	48,486,218.15
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	54,636,266.15
---	----	---------------

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级 别	持有人户 数(户)	户均持有的基 金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
华 夏 智 胜 先 锋 股 票 (LOF) A	39,507	22,255.97	216,260,557.69	24.60%	663,006,216.93	75.40%
华 夏 智 胜 先 锋 股 票 C	56,566	42,976.21	1,428,334,378.93	58.76%	1,002,658,103.90	41.24%
合计	96,073	34,455.67	1,644,594,936.62	49.68%	1,665,664,320.83	50.32%

8.2 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	4.10%
2	朱群英	4,678,575.00	3.83%
3	东莞市嘉荣实业投资有限 公司	3,982,618.00	3.26%
4	徐向明	3,436,600.00	2.81%

5	杨淼莹	2,766,703.00	2.27%
6	沈昌胜	2,315,307.00	1.90%
7	上海途灵资产管理有限公司—途灵衡利 1 号证券私募投资基金	2,200,104.00	1.80%
8	上海复熙资产管理有限公司—复熙恒赢 8 号私募证券投资基金	1,800,000.00	1.47%
9	杨新宇	1,770,000.00	1.45%
10	俞枝枝	1,704,496.00	1.40%

8.3 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	2,096,768.21	0.24%
	华夏智胜先锋股票 C	1,667,414.57	0.07%
	合计	3,764,182.78	0.11%

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	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

§9 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	166,239,703.81	255,657,313.51
本报告期基金总申购份额	852,288,029.34	2,895,491,749.26
减：本报告期基金总赎回份额	139,260,958.53	720,156,579.94
本报告期基金拆分变动份额	-	-

本报告期末基金份额总额	879,266,774.62	2,430,992,482.83
-------------	----------------	------------------

§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 2023 年 2 月 23 日发布公告，胡捷先生自 2023 年 2 月 23 日起不再担任华夏银行股份有限公司资产托管部副总经理。

本报告期内，本基金托管人 2023 年 4 月 7 日发布公告，朱绍刚先生自 2023 年 4 月 4 日起担任华夏银行股份有限公司资产托管部副总经理。

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

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	

中信证券	2	11,719,114,217.50	100.00%	2,659,329.87	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。

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	2,402,638.79	100.00%	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华夏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
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	2023-02-11
4	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	2023-02-24
5	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	2023-03-03

	联方承销证券的公告	网站	
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	2023-03-11
7	华夏基金管理有限公司关于限制华夏智胜先锋股票型证券投资基金（LOF）申购及定期定额申购业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-03-17
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	2023-03-23
9	华夏基金管理有限公司关于调整华夏智胜先锋股票型证券投资基金（LOF）申购及定期定额申购业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-03-28
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	2023-03-30
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	2023-04-01
12	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
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	2023-04-15
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	2023-04-27
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	2023-05-13
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	2023-05-27
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	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。

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