

# 华夏睿磐泰兴混合型证券投资基金

**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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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.....	12
§6 中期报告财务会计报告（未经审计）.....	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	14
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	17
§7 投资组合报告.....	48
7.1 期末基金资产组合情况.....	48
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	49
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	49
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	62
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	64
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.....	64
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.....	65
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.....	65
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.....	65
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	65
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	65
7.12 投资组合报告附注.....	65
§8 基金份额持有人信息.....	66
§9 开放式基金份额变动.....	67
§10 重大事件揭示.....	67
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	70
§12 备查文件目录.....	71

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华夏睿磐泰兴混合型证券投资基金	
基金简称	华夏睿磐泰兴混合	
基金主代码	004202	
交易代码	004202	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017年7月14日	
基金管理人	华夏基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	812,848,091.45 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华夏睿磐泰兴混合 A	华夏睿磐泰兴混合 C
下属分级基金的交易代码	004202	017151
报告期末下属分级基金的份额总额	800,151,655.34 份	12,696,436.11 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	通过风险均衡方法进行资产配置，积极管理，力求有效控制风险，实现基金资产长期持续增值。
投资策略	主要投资策略包括资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、权证投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略、期权投资策略等。在资产配置策略上，本基金以风险均衡作为主要资产配置策略，通过平衡各资产类别对整个组合风险贡献，合理确定本基金在股票、债券等资产上的投资比例。在股票投资策略上，本基金股票投资策略分为主动量化股票投资策略和基于风险均衡的股票投资策略。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率×10%+上证国债指数收益率×90%。
风险收益特征	本基金属于混合基金，风险与收益高于债券基金与货币市场基金，低于股票基金，属于较高风险、较高收益的品种。

### 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	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	王小飞
	联系电话	400-818-6666
	电子邮箱	service@ChinaAMC.com
客户服务电话	400-818-6666	wangxiaofei.zh@ccb.com
传真	010-63136700	021-60637228
注册地址	010-63136700	021-60635778
	北京市顺义区安庆大街甲3号	北京市西城区金融大街25号

	院	
办公地址	北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座8层	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码	100033	100033
法定代表人	杨明辉	田国立

### 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	华夏基金管理有限公司	北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 8 层

## §3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日）	
	华夏睿磐泰兴混合 A	华夏睿磐泰兴混合 C
本期已实现收益	19,195,329.35	47,155.66
本期利润	35,174,027.34	49,429.36
加权平均基金份额本期利润	0.0315	0.0164
本期加权平均净值利润率	2.65%	1.35%
本期基金份额净值增长率	2.56%	2.32%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)	
	华夏睿磐泰兴混合 A	华夏睿磐泰兴混合 C
期末可供分配利润	129,005,903.41	2,179,129.19
期末可供分配基金份额利润	0.1612	0.1716
期末基金资产净值	961,255,566.93	15,476,727.82
期末基金份额净值	1.2013	1.2190
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)	
	华夏睿磐泰兴混合 A	华夏睿磐泰兴混合 C

基金份额累计净值增长率	39.87%	1.17%
-------------	--------	-------

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。

④本基金自 2022 年 11 月 14 日增加 C 类基金份额类别。

### 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

##### 华夏睿磐泰兴混合 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	0.39%	0.13%	0.46%	0.08%	-0.07%	0.05%
过去三个月	0.93%	0.12%	0.75%	0.08%	0.18%	0.04%
过去六个月	2.56%	0.11%	1.97%	0.09%	0.59%	0.02%
过去一年	0.80%	0.13%	2.07%	0.10%	-1.27%	0.03%
过去三年	19.83%	0.20%	9.85%	0.12%	9.98%	0.08%
自基金合同生效起至今	39.87%	0.19%	24.99%	0.12%	14.88%	0.07%

##### 华夏睿磐泰兴混合 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	0.35%	0.13%	0.46%	0.08%	-0.11%	0.05%
过去三个月	0.81%	0.12%	0.75%	0.08%	0.06%	0.04%
过去六个月	2.32%	0.11%	1.97%	0.09%	0.35%	0.02%
自新增份额类别以来至今	1.17%	0.12%	2.06%	0.09%	-0.89%	0.03%

注：本基金自 2022 年 11 月 14 日增加 C 类基金份额类别。

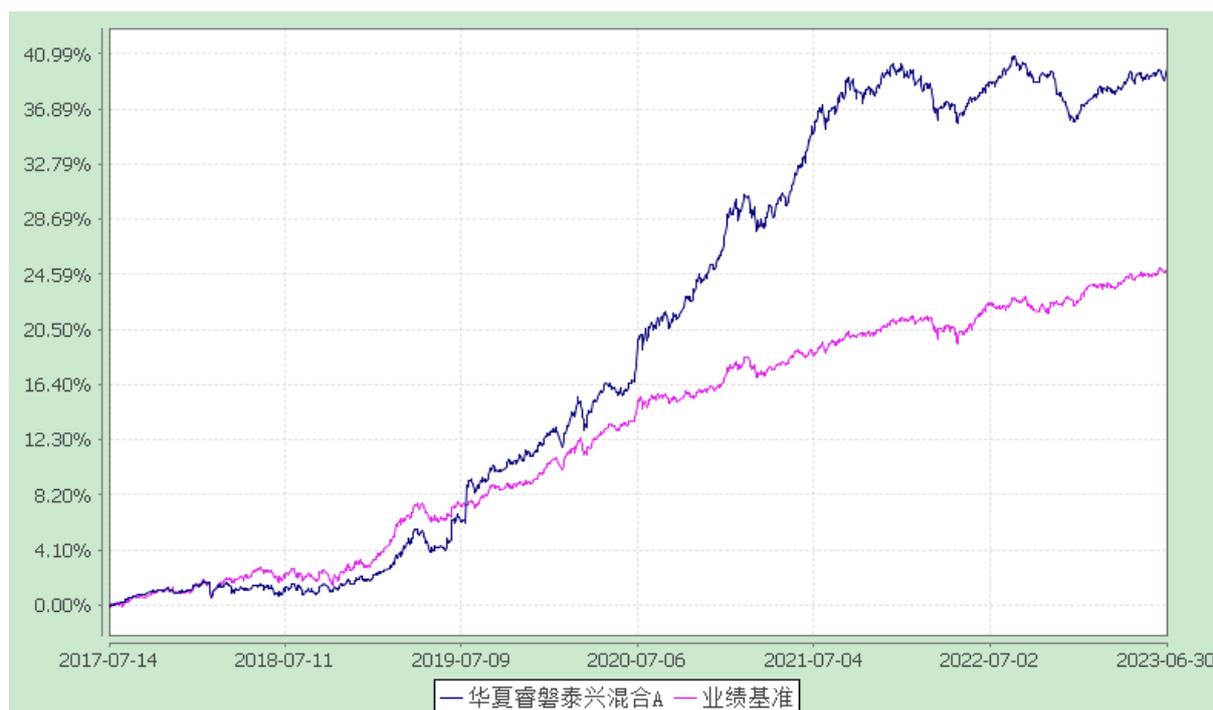
#### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

##### 华夏睿磐泰兴混合型证券投资基金

##### 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2017 年 7 月 14 日至 2023 年 6 月 30 日)

##### 华夏睿磐泰兴混合 A



华夏睿磐泰兴混合 C



注：本基金自 2022 年 11 月 14 日增加 C 类基金份额类别。

## §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		
宋洋	本基金的 基金经理	2017-08-29	-	13 年	博士。曾任嘉实基金管理有限公司研究员、投资经理。2016 年 3 月加入华夏基金管理有限公司。历任数量投资部研究员、华夏新锦图灵活配置混合型证券投资基金基金经理（2017 年 3 月 24 日至 2018 年 9 月 10 日期间）、华夏睿磐泰利六个月定期开放混合型证券投资基金基金经理（2018 年 4 月 10 日至 2019 年 2 月 26 日期间）、华夏睿磐泰盛六个月定期开放混合型证券投资基金基金经理（2017 年 8 月 29 日至 2021 年 1 月 5 日期间）、华夏睿磐泰盛混合型证券投资基金基金经理（2021 年 1 月 6 日至 2021 年 5 月 26 日期间）、华夏鼎汇债券型证券投资基金基金经理（2017 年 3 月 24 日至 2021 年 8 月 3 日期间）等。
席与焜	本基金的 基金经理 助理	2023-03-28	-	5 年	硕士。2018 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。
文世伦	本基金的 基金经理 助理	2023-03-28	-	6 年	硕士。曾任华夏基金管理有限公司交易员，中融基金管理有限公司投资经理。2022 年 8 月加入华夏基金管理有限公司。
刘薇	本基金的 基金经理 助理	2022-11-21	2023-06-30	10 年	硕士。2013 年 1 月加入华夏基金管理有限公司。历任固定收益部研究员、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合规守信情况的说明

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，本基金管理人旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 90 次，均为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年，债券市场走出牛市行情，久期策略优于票息策略。从持有期收益率的排序上看，30Y 国债和 20Y 国开持有期收益率最高，其次是 3-5Y 段的二永、普通信用债。5Y 国债明显跑输 5Y 国开，10Y 国开上半年表现也不及 10Y 国债。得益于第三产业的快速恢复，一季度经济表现偏好，逆周期政策继续发力的必要性下降。二季度逆周期政策开始逐步退出，经济修复的节奏趋缓，信贷需求趋弱，银行对基础货币的需求减少，在此背景下资金利率中枢大幅下行。长短端收益率下行，10Y 国债从 2.88 下行至 2.65 左右。信用债方面，随着理财产品发行恢复正常，存量理财规模企稳，去年底因赎回踩踏而走高的信用利差和等级利差快速修复。

权益市场上半年呈现先上后下的走势。一季度，伴随着去年年底疫情管控政策的边际放松，社会经济秩序逐步回归常态，叠加市场预期美联储紧缩货币政策接近尾声等海外金融因素的加持，市场迎来开门红。但在二季度，伴随着经济数据的逐步披露，权益市场经历了从“强预期+弱现实”到“弱现实+弱预期”预期交易的转换，而二季度又正逢领导班子换届以及大兴调研之风的时间窗口期，因此具体政策预期并不明朗，导致二季度回吐了部分一季度的涨幅。整体而言，权益市场上半年呈先上后下之势，继续处于市场存量博弈的环境中。行业与主题的轮动速度仍在历史高位，结构化分化

严重。TMT 和国企改革投资主线轮番表现，消费、地产、新能源等行业遭遇一定幅度的回调。

本基金股票端投资采取与反脆弱相结合的系统化主观投资策略作为核心策略，采取自下而上组合投资结合中观配置，自上而下的宏观框架指导的组合构建方式，采用多策略的管理方式，在全市场范畴内寻找兼顾安全边际和景气度、具备较高投资性价比的行业和个股，力争穿越市场不同风格与投资主线周期，同时积极使用衍生品工具管理产品的波动和回撤水平。二季度相对于一季度，边际增加了权益仓位敞口的暴露水平，在权益细分资产内部配置方面，考虑到全球主要经济体的利率水平、通胀水平、逆全球化进程都处于较高水平，因此增加了避险资产的配置比例，以期增强组合的反脆弱性。报告期内，以产品投资目标为指导，积极调整仓位管理策略为更为积极的偏左侧的仓位管理方式，以期更好地应对股票市场的波动。债券端报告期内维持了合理的仓位和久期，根据市场情况进行了一定的波段操作。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2023 年 6 月 30 日，华夏睿磐泰兴混合 A 基金份额净值为 1.2013 元，本报告期份额净值增长率为 2.56%；华夏睿磐泰兴混合 C 基金份额净值为 1.2190 元，本报告期份额净值增长率为 2.32%，同期业绩比较基准增长率为 1.97%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，债券市场方面，10Y 国债已经在 2.62% 附近的位置，低于 MLF 约 3bp。7 月在远洋展期、地产销售疲弱的状态下，资金没有进一步宽松，DR007 仍在 1.8%-1.9% 的水平。我们认为，若要突破前低 2.59%，需要基本面再度转弱或者新增宽货币政策的支持。前者需要密切跟踪高频数据，及时修正投资观点，后者本质上也是从基本面出发，但从经验上看，可以结合相关部门、领导的讲话综合判断，我们认为目前央行的表态偏向友好，全年实现 5% 左右仍需要货币政策配合，因此我们预计在经济数据出现明显拐点之前，宽货币政策仍可期待，利率仍有一定的下行空间。但是具体节奏不好把握，容易受到各类会议、理财申赎的影响。下半年组合会以票息策略为主，择机参与利率债波段增厚收益。

权益市场方面，目前股债商汇四类资产对未来经济增长已经较为充分定价了中国增长因子下修的悲观预期，而当前影响增长因子变化最关键的驱动是政策。后续伴随着以提振信心、达成全年经济增速目标为导向的稳增长组合拳的陆续出台，预计权益市场将处于底部水位不断抬升的存量博弈环境。当前依旧维持前期对权益市场的基准假设：“弱经济（经济弱复苏）+弱产业（产业景气度均不高）+较好的宏观流动性环境+产业政策频出”的判断，在这个基准假设下，以追逐具备确定性溢价的资产结构为主，体现在两个方面，一是产业趋势的确定性，如 AI+（长期技术革新和工业革命），二是永续经营、高现金流、高股息的资产。同时从复盘角度来看，在经济增长因子下修背景下，首

先由于增长因子偏弱导致市场缺乏动量效应，导致行业轮动的速度仍将处于高位水平，其次，经济增长因子偏弱叠加当前市场筹码结构，导致自 2021 年春节后以来小盘成长持续跑赢市场，公募基金暴露程度最高的大盘成长方向持续跑输市场。因此在基准假设下，待稳增长政策调控窗口期结束且出现市场风险偏好转向迹象时，小盘成长将是值得关注的投资机会。

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

本基金本报告期末未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

## §5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关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符合法律法规和基金合同的相关约定。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

## §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：华夏睿磐泰兴混合型证券投资基金

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
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	8,241,381.43	76,800,245.23
结算备付金		13,092,275.75	13,163,222.81
存出保证金		1,899,323.81	78,785.75
交易性金融资产	6.4.7.2	942,585,684.28	1,312,091,109.60
其中：股票投资		153,654,960.21	175,217,973.21
基金投资		-	-
债券投资		788,930,724.07	1,136,873,136.39
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	-8,312.33	200,028,904.62
应收清算款		30,268,393.43	-
应收股利		-	-
应收申购款		46,012.37	31,380.18
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		996,124,758.74	1,602,193,648.19
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2022 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	6.4.7.3	-	-

卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	19,281,959.07
应付赎回款		18,026,838.95	50,375,622.43
应付管理人报酬		665,080.97	1,227,270.00
应付托管费		166,270.25	306,817.49
应付销售服务费		4,752.01	184.11
应付投资顾问费		-	-
应交税费		31,023.15	25,022.46
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	498,498.66	600,427.99
负债合计		19,392,463.99	71,817,303.55
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	812,848,091.45	1,306,589,596.57
未分配利润	6.4.7.8	163,884,203.30	223,786,748.07
净资产合计		976,732,294.75	1,530,376,344.64
负债和净资产总计		996,124,758.74	1,602,193,648.19

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，华夏睿磐泰兴混合 A 基金份额净值 1.2013 元，华夏睿磐泰兴混合 C 基金份额净值 1.2190 元；华夏睿磐泰兴混合基金份额总额 812,848,091.45 份（其中 A 类 800,151,655.34 份，C 类 12,696,436.11 份）。

## 6.2 利润表

会计主体：华夏睿磐泰兴混合型证券投资基金

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
<b>一、营业总收入</b>		42,032,691.53	-6,549,085.97
1.利息收入		793,030.21	186,204.03
其中：存款利息收入	6.4.7.9	257,827.19	103,120.64
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		535,203.02	83,083.39
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		24,339,841.02	-10,235,098.33
其中：股票投资收益	6.4.7.10	3,878,857.73	-26,074,146.93
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	18,021,275.10	13,924,418.84
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	-50,232.59	1,006,508.27
股利收益	6.4.7.14	2,489,940.78	908,121.49
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	15,980,971.69	3,252,695.16
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	918,848.61	247,113.17
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>6,809,234.83</b>	<b>5,047,829.55</b>
1.管理人报酬		5,310,703.65	3,678,040.51
2.托管费		1,327,675.98	919,510.16
3.销售服务费		9,250.56	-
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		16,165.52	326,065.51
其中：卖出回购金融资产支出		16,165.52	326,065.51
6.信用减值损失	6.4.7.17	-	-
7.税金及附加		24,361.97	11,847.65
8.其他费用	6.4.7.18	121,077.15	112,365.72
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>35,223,456.70</b>	<b>-11,596,915.52</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>35,223,456.70</b>	<b>-11,596,915.52</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		<b>-</b>	<b>-</b>
<b>六、综合收益总额</b>		<b>35,223,456.70</b>	<b>-11,596,915.52</b>

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：华夏睿磐泰兴混合型证券投资基金

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）	1,306,589,596.57	-	223,786,748.07	1,530,376,344.64
二、本期期初净资产（基金净值）	1,306,589,596.57	-	223,786,748.07	1,530,376,344.64
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-493,741,505.12	-	-59,902,544.77	-553,644,049.89

(一)、综合收益总额	-	-	35,223,456.70	35,223,456.70
(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)	-493,741,505.12	-	-95,126,001.47	-588,867,506.59
其中: 1.基金申购款	143,436,517.74	-	28,198,059.53	171,634,577.27
2.基金赎回款	-637,178,022.86	-	-123,324,061.00	-760,502,083.86
(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)	812,848,091.45	-	163,884,203.30	976,732,294.75
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)	711,015,381.41	-	286,346,890.02	997,362,271.43
二、本期期初净资产(基金净值)	711,015,381.41	-	286,346,890.02	997,362,271.43
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-122,162,582.75	-	-58,081,349.80	-180,243,932.55
(一)、综合收益总额	-	-	-11,596,915.52	-11,596,915.52
(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)	-122,162,582.75	-	-46,484,434.28	-168,647,017.03
其中: 1.基金申购款	124,669,405.52	-	46,376,737.77	171,046,143.29
2.基金赎回款	-246,831,988.27	-	-92,861,172.05	-339,693,160.32
(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)	588,852,798.66	-	228,265,540.22	817,118,338.88

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

华夏睿磐泰兴混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）已获中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2016]3124 号《关于准予华夏睿磐泰兴混合型证券投资基金注册的批复》，由华夏基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《华夏睿磐泰兴混合型证券投资基金基金合同》及其他有关法律法规负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限为不定期。本基金自 2017 年 6 月 15 日至 2017 年 7 月 12 日共募集 471,819,848.95 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（2017）验字第 60739337\_A24 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华夏睿磐泰兴混合型证券投资基金基金合同》于 2017 年 7 月 14 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 471,904,646.30 份基金份额，其中认购资金利息折合 84,797.35 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，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。根据基金管理人 2022 年 11 月 9 日刊登的《华夏基金管理有限公司关于修订华夏睿磐泰兴混合型证券投资基金合同的公告》及《华夏基金管理有限公司关于华夏睿磐泰兴混合型证券投资基金增加 C 类基金份额的公告》，本基金自 2022 年 11 月 14 日起增加 C 类基金份额类别。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华夏睿磐泰兴混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板、存托凭证及其他中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、中小企业私募债券、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（包括权证、股指期货、国债期货、期权等）、货币市场工具（含同业存单）、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

##### 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	8,241,381.43
等于：本金	8,239,003.55	
加：应计利息	2,377.88	
定期存款	-	
等于：本金	-	
加：应计利息	-	
其中：存款期限 1 个月以内	-	
存款期限 1-3 个月	-	
存款期限 3 个月以上	-	
其他存款	-	
等于：本金	-	
加：应计利息	-	
合计	8,241,381.43	

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	156,126,191.67	-	153,654,960.21	-2,471,231.46	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	79,546,558.70	989,389.63	81,160,590.03	624,641.70
	银行间市场	698,476,084.79	7,022,234.04	707,770,134.04	2,271,815.21
	合计	778,022,643.49	8,011,623.67	788,930,724.07	2,896,456.91
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	934,148,835.16	8,011,623.67	942,585,684.28	425,225.45	

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			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	

利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	15,212,640.00	-	-	-
其中：股指期货	15,212,640.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	15,212,640.00	-	-	-

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
IF2307	沪深 300 期货 IF2307 合约	13	14,938,560.00	-274,080.00
合计	-	-	-	-274,080.00
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	-274,080.00
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

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-8,312.33	-
银行间市场	-	-
合计	-8,312.33	-

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	18.59
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	404,260.52
其中：交易所市场	388,366.50
银行间市场	15,894.02
应付利息	-
预提费用	94,219.55
合计	498,498.66

#### 6.4.7.7 实收基金

华夏睿磐泰兴混合 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	1,306,216,118.07	1,306,216,118.07
本期申购	130,285,686.17	130,285,686.17
本期赎回（以“-”号填列）	-636,350,148.90	-636,350,148.90
本期末	800,151,655.34	800,151,655.34

华夏睿磐泰兴混合 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	373,478.50	373,478.50
本期申购	13,150,831.57	13,150,831.57
本期赎回（以“-”号填列）	-827,873.96	-827,873.96
本期末	12,696,436.11	12,696,436.11

#### 6.4.7.8 未分配利润

华夏睿磐泰兴混合 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	187,100,355.61	36,614,892.05	223,715,247.66
本期利润	19,195,329.35	15,978,697.99	35,174,027.34
本期基金份额交易产生的变动数	-77,289,781.55	-20,495,581.86	-97,785,363.41
其中：基金申购款	20,159,631.20	5,202,971.59	25,362,602.79
基金赎回款	-97,449,412.75	-25,698,553.45	-123,147,966.20

本期已分配利润	-	-	-
本期末	129,005,903.41	32,098,008.18	161,103,911.59

华夏睿磐泰兴混合 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	58,404.91	13,095.50	71,500.41
本期利润	47,155.66	2,273.70	49,429.36
本期基金份额交易产生的变动数	2,073,568.62	585,793.32	2,659,361.94
其中：基金申购款	2,212,412.79	623,043.95	2,835,456.74
基金赎回款	-138,844.17	-37,250.63	-176,094.80
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,179,129.19	601,162.52	2,780,291.71

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	137,101.10
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	119,923.51
其他	802.58
合计	257,827.19

#### 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	733,617,315.07
减：卖出股票成本总额	728,273,749.41
减：交易费用	1,464,707.93
买卖股票差价收入	3,878,857.73

#### 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	17,176,457.51
债券投资收益——买卖债券（债转股及	844,817.59

债券到期兑付) 差价收入	
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	18,021,275.10

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	1,386,656,350.77
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,366,551,308.48
减：应计利息总额	19,235,349.70
减：交易费用	24,875.00
买卖债券差价收入	844,817.59

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	-50,232.59

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	2,489,940.78
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	2,489,940.78

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	16,255,051.69
——股票投资	1,899,931.47
——债券投资	14,355,120.22
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-274,080.00
——权证投资	-
——期货投资	-274,080.00
4.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	15,980,971.69

#### 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	918,848.61
合计	918,848.61

#### 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	34,712.18
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	7,857.60
银行间账户维护费	18,000.00
其他	1,000.00
合计	121,077.15

#### 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
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	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

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	-	-	37,158,637.28	4.81%

###### 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	-	-	9,910,410.10	8.10%

###### 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	成交金额	占当期债券回购成交总

		交总额的 比例		额的比例
中信证券	-	-	622,200,000.00	17.09%

#### 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
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	27,531.20	4.73%	27,531.20	5.48%

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	5,310,703.65	3,678,040.51
其中：支付销售机构的客户维护费	228,457.06	307,084.55

注：①支付基金管理人的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 0.80%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×0.80%/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	1,327,675.98	919,510.16
----------------	--------------	------------

注：①支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值 0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

②基金托管费计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.20%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华夏睿磐泰兴混合 A	华夏睿磐泰兴混合 C	合计
华夏基金管理有限公司	-	116.46	116.46
合计	-	116.46	116.46
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		
	华夏睿磐泰兴混合 A	华夏睿磐泰兴混合 C	合计
合计	-	-	-

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 0.50%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×0.50%/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		上年度可比期间	
	2023年1月1日至2023年6月30日		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
中国建设银行活期存款	8,241,381.43	137,101.10	2,296,032.80	32,520.96

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国建设银行保管，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	21,134	928,205.28
中信证券	688146	中船特气	新股发行	10,101	365,151.15
中信证券	001286	陕西能源	新股发行	37,667	361,603.20
中信证券	688581	安杰思	新股发行	1,629	204,928.20
中信证券	688539	高华科技	新股发行	5,334	203,865.48
中信证券	688522	纳睿雷达	新股发行	4,299	200,677.32
中信证券	301439	泓淋电力	新股发行	9,486	189,625.14
中信证券	688523	航天环宇	新股发行	4,717	103,113.62
中信证券	301293	三博脑科	新股发行	3,324	98,390.40

中信证券	601916	浙商银行	配股发行	48,360	97,687.20
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	688223	晶科能源	新股发行	134,758	673,790.00
中信证券	301200	大族数控	新股发行	6,739	515,937.84
中信证券	688150	莱特光电	新股发行	5,626	124,053.30
中信证券	603132	金徽股份	新股发行	1,342	14,493.60
中信证券	603191	望变电气	新股发行	1,149	13,627.14
中信证券	603209	兴通股份	新股发行	595	12,804.40
中信证券	001266	宏英智能	新股发行	247	9,536.67
中信证券	603215	比依股份	新股发行	575	7,187.50
中信证券	603051	鹿山新材	新股发行	272	7,014.88

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

##### 6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配事项。

#### 6.4.12 期末（2023 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限	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

				类型						
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	-
301292	海科新源	2023-06-29	1 个月内(含)	新发流通受限	19.99	19.99	5,241	104,767.59	104,767.59	-
301488	豪恩汽电	2023-06-26	1 个月内(含)	新发流通受限	39.78	39.78	2,356	93,721.68	93,721.68	-
301358	湖南裕能	2023-02-01	6 个月	新发流通受限	23.77	42.89	2,023	48,086.71	86,766.47	-
688472	阿特斯	2023-06-02	6 个月	新发流通受限	11.10	17.04	4,633	51,426.30	78,946.32	-

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	-
301260	格力博	2023-01-20	6 个月	新发流通受限	30.85	23.63	2,762	85,207.70	65,266.06	-
688361	中科飞测	2023-05-12	6 个月	新发流通受限	23.60	64.67	831	19,611.60	53,740.77	-
688531	日联科技	2023-03-24	6 个月	新发流通受限	152.38	135.97	346	52,723.48	47,045.62	-
301325	曼恩斯特	2023-05-04	6 个月	新发	76.80	107.95	364	27,955.20	39,293.80	-

				流通受限						
688146	中船特气	2023-04-13	6 个月	新发流通受限	36.15	38.13	1,011	36,547.65	38,549.43	-
301291	明阳电气	2023-06-21	6 个月	新发流通受限	38.13	31.03	1,206	45,984.78	37,422.18	-
688484	南芯科技	2023-03-28	6 个月	新发流通受限	39.99	36.71	1,008	40,309.92	37,003.68	-
001286	陕西能源	2023-03-31	6 个月	新发流通受限	9.60	9.41	3,767	36,163.20	35,447.47	-
001287	中电港	2023-03-30	6 个月	新发流通受限	11.88	21.02	1,386	16,465.68	29,133.72	-
688576	西山科技	2023-05-30	6 个月	新发流通受限	135.80	120.41	240	32,592.00	28,898.40	-
301246	宏源药业	2023-03-10	6 个月	新发流通	50.00	30.71	931	46,550.00	28,591.01	-

				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	-
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	新发流通受限	29.60	71.42	333	9,856.80	23,782.86	-
301303	真兰仪表	2023-02-13	6 个月	新发流通受限	26.80	22.32	1,058	28,354.40	23,614.56	-

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	-
301322	绿通科技	2023-02-27	6 个月	新发流通受限	131.11	53.24	392	34,219.71	20,870.08	含证券送配
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	-
688581	安杰思	2023-05-12	6 个月	新发流通受限	125.80	118.03	163	20,505.40	19,238.89	-
301317	鑫磊股份	2023-01-12	6 个月	新发	20.67	26.17	694	14,344.98	18,161.98	-

				流通受限						
301262	海看股份	2023-06-13	6 个月	新发流通受限	30.22	25.50	692	20,912.24	17,646.00	-
301383	天键股份	2023-05-31	6 个月	新发流通受限	46.16	35.72	493	22,756.88	17,609.96	-
688562	航天软件	2023-05-15	6 个月	新发流通受限	12.68	22.31	726	9,205.68	16,197.06	-
301439	泓淋电力	2023-03-10	6 个月	新发流通受限	19.99	16.90	949	18,970.51	16,038.10	-
688623	双元科技	2023-05-31	6 个月	新发流通受限	125.88	86.79	178	22,406.64	15,448.62	-
301332	德尔玛	2023-05-09	6 个月	新发流通受限	14.81	13.73	1,122	16,616.82	15,405.06	-
301399	英特科技	2023-05-16	6 个月	新发流通	43.99	51.57	293	12,889.07	15,110.01	-

				受限						
301305	朗坤环境	2023-05-15	6 个月	新发流通受限	25.25	19.69	753	19,013.25	14,826.57	-
301397	溯联股份	2023-06-15	6 个月	新发流通受限	53.27	40.20	362	19,283.74	14,552.40	-
301387	光大同创	2023-04-10	6 个月	新发流通受限	58.32	45.36	307	17,904.24	13,925.52	-
301395	仁信新材	2023-06-21	6 个月	新发流通受限	26.68	26.68	520	13,873.60	13,873.60	-
301210	金杨股份	2023-06-21	6 个月	新发流通受限	57.88	49.17	281	16,264.28	13,816.77	-
688512	慧智微	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	新发流通受限	26.66	31.50	418	11,143.88	13,167.00	-
301360	荣旗科技	2023-04-17	6 个月	新发流通受限	71.88	92.60	134	9,631.92	12,408.40	-
301345	涛涛车业	2023-03-10	6 个月	新发流通受限	73.45	46.64	266	19,537.70	12,406.24	-
301292	海科新源	2023-06-29	6 个月	新发流通受限	19.99	19.99	583	11,654.17	11,654.17	-
688523	航天环宇	2023-05-26	6 个月	新发流通受限	21.86	23.85	472	10,317.92	11,257.20	-
603135	中重科技	2023-03-29	6 个月	新发流通受限	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	35.66	33.26	333	11,874.78	11,075.58	-

				流通受限						
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	24.66	22.51	420	10,357.20	9,454.20	-

				受限						
301355	南王科技	2023-06-02	6 个月	新发流通受限	17.55	16.75	563	9,880.65	9,430.25	-
301357	北方长龙	2023-04-11	6 个月	新发流通受限	50.00	48.39	190	9,500.00	9,194.10	-
301386	未来电器	2023-03-21	6 个月	新发流通受限	29.99	23.79	378	11,336.22	8,992.62	-
301323	新莱福	2023-05-29	6 个月	新发流通受限	39.06	39.36	228	8,905.68	8,974.08	-
688429	时创能源	2023-06-20	6 个月	新发流通受限	19.20	25.53	346	6,643.20	8,833.38	-
301170	锡南科技	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	338	10,647.38	8,483.80	含 证 券 送 配

688535	华海诚科	2023-03-28	6 个月	新发流通受限	35.00	51.23	161	5,635.00	8,248.03	-
601133	柏诚股份	2023-03-31	6 个月	新发流通受限	11.66	12.26	664	7,742.24	8,140.64	-
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	42.45	32.97	226	9,593.70	7,451.22	-

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

001360	南矿集团	2023-03-31	6 个月	受限 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	受限 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	受限 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	受限 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)	受限 新发流通受限	100.00	100.01	449	44,900.00	44,903.74	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內。

#### 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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	合计
银行存款	8,241,381.43	-	-	8,241,381.43
结算备付金	13,092,275.75	-	-	13,092,275.75
结算保证金	1,899,323.81	-	-	1,899,323.81
债券投资	90,795,939.13	657,794,326.60	40,340,458.34	788,930,724.07
资产支持证券	-	-	-	-
买入返售金融资产	-8,312.33	-	-	-8,312.33
应收直销申购款	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	合计
银行存款	76,800,245.23	-	-	76,800,245.23
结算备付金	13,163,222.81	-	-	13,163,222.81
结算保证金	78,785.75	-	-	78,785.75
债券投资	114,535,805.19	969,926,574.50	52,410,756.70	1,136,873,136.39
资产支持证券	-	-	-	-
买入返售金融资产	200,028,904.62	-	-	200,028,904.62
应收直销申购款	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	利率下降 25 个基点	4,924,344.36	7,234,632.15
	利率上升 25 个基点	-4,867,670.71	-7,160,128.86

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	153,654,960.21	15.73	175,217,973.21	11.45
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	400,602.16	0.04	73,052.03	0.00
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	154,055,562.37	15.77	175,291,025.24	11.45

注：①本表中交易性金融资产-债券投资科目仅包含可转换公司债券和可交换公司债券等。

②由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

##### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	-5%	-6,065,159.94	-8,333,285.68
	+5%	6,065,159.94	8,333,285.68

#### 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	151,518,189.24
第二层次	789,440,459.83
第三层次	1,627,035.21
合计	942,585,684.28

##### 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	153,654,960.21	15.43
	其中：股票	153,654,960.21	15.43
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	788,930,724.07	79.20
	其中：债券	788,930,724.07	79.20
	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	-8,312.33	0.00
	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	21,333,657.18	2.14
8	其他各项资产	32,213,729.61	3.23
9	合计	996,124,758.74	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	3,754,164.00	0.38
B	采矿业	12,759,047.00	1.31
C	制造业	81,088,127.69	8.30
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,427,411.27	0.76
E	建筑业	5,499,068.64	0.56
F	批发和零售业	3,526,527.96	0.36
G	交通运输、仓储和邮政业	4,293,140.00	0.44
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,899,058.82	1.01
J	金融业	12,197,194.80	1.25
K	房地产业	8,103,153.10	0.83
L	租赁和商务服务业	1,115,309.50	0.11
M	科学研究和技术服务业	1,967,005.00	0.20
N	水利、环境和公共设施管理业	871,174.57	0.09
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	159,151.00	0.02
Q	卫生和社会工作	235,182.86	0.02
R	文化、体育和娱乐业	760,244.00	0.08
S	综合	-	-
	合计	153,654,960.21	15.73

## 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	600547	山东黄金	101,800	2,390,264.00	0.24
2	600489	中金黄金	192,800	1,991,624.00	0.20
3	000975	银泰黄金	170,200	1,991,340.00	0.20
4	600060	海信视像	58,800	1,455,300.00	0.15
5	600050	中国联通	295,100	1,416,480.00	0.15

6	002422	科伦药业	47,600	1,412,768.00	0.14
7	600941	中国移动	15,000	1,399,500.00	0.14
8	600674	川投能源	87,600	1,318,380.00	0.13
9	600066	宇通客车	88,200	1,300,068.00	0.13
10	601336	新华保险	34,700	1,275,919.00	0.13
11	603156	养元饮品	47,600	1,175,720.00	0.12
12	002367	康力电梯	126,300	1,153,119.00	0.12
13	002772	众兴菌业	98,900	1,117,570.00	0.11
14	600377	宁沪高速	113,600	1,116,688.00	0.11
15	601163	三角轮胎	68,700	1,090,269.00	0.11
16	600028	中国石化	169,700	1,079,292.00	0.11
17	000517	荣安地产	350,600	1,069,330.00	0.11
18	601318	中国平安	23,000	1,067,200.00	0.11
19	601857	中国石油	142,100	1,061,487.00	0.11
20	300908	仲景食品	23,400	1,061,190.00	0.11
21	002489	浙江永强	260,800	1,056,240.00	0.11
22	600612	老凤祥	15,000	1,048,200.00	0.11
23	600251	冠农股份	116,000	1,047,480.00	0.11
24	000048	京基智农	53,500	1,044,320.00	0.11
25	601619	嘉泽新能	228,900	1,041,495.00	0.11
26	603878	武进不锈	123,200	1,041,040.00	0.11
27	002233	塔牌集团	134,600	1,039,112.00	0.11
28	600639	浦东金桥	83,510	1,036,359.10	0.11
29	000906	浙商中拓	113,400	1,011,528.00	0.10
30	600035	楚天高速	247,800	1,011,024.00	0.10
31	600938	中国海油	55,400	1,003,848.00	0.10
32	300146	汤臣倍健	41,600	997,568.00	0.10
33	600729	重庆百货	31,200	980,928.00	0.10
34	002714	牧原股份	23,000	969,450.00	0.10
35	600642	申能股份	137,200	959,028.00	0.10
36	002448	中原内配	135,800	950,600.00	0.10
37	002404	嘉欣丝绸	140,800	948,992.00	0.10
38	600863	内蒙华电	227,700	944,955.00	0.10
39	600803	新奥股份	49,200	933,816.00	0.10
40	600531	豫光金铅	146,900	925,470.00	0.09
41	600266	城建发展	180,600	917,448.00	0.09
42	600598	北大荒	68,800	917,104.00	0.09
43	605077	华康股份	34,600	916,208.00	0.09
44	300433	蓝思科技	77,700	913,752.00	0.09
45	600089	特变电工	40,805	909,543.45	0.09
46	000538	云南白药	17,320	908,953.60	0.09
47	000728	国元证券	138,100	900,412.00	0.09
48	000739	普洛药业	50,700	899,418.00	0.09

49	000937	冀中能源	140,900	898,942.00	0.09
50	000783	长江证券	154,000	893,200.00	0.09
51	601728	中国电信	158,600	892,918.00	0.09
52	600909	华安证券	189,800	886,366.00	0.09
53	002275	桂林三金	49,200	886,092.00	0.09
54	001979	招商蛇口	67,900	884,737.00	0.09
55	601319	中国人保	151,300	883,592.00	0.09
56	002154	报喜鸟	159,900	882,648.00	0.09
57	601555	东吴证券	126,800	879,992.00	0.09
58	000623	吉林敖东	54,800	878,992.00	0.09
59	001914	招商积余	58,200	875,910.00	0.09
60	600325	华发股份	88,400	870,740.00	0.09
61	601155	新城控股	60,200	867,482.00	0.09
62	600248	陕建股份	177,000	844,290.00	0.09
63	600048	保利发展	64,400	839,132.00	0.09
64	601186	中国铁建	84,800	835,280.00	0.09
65	600761	安徽合力	40,400	805,172.00	0.08
66	002092	中泰化学	121,300	782,385.00	0.08
67	600971	恒源煤电	97,900	762,641.00	0.08
68	601668	中国建筑	113,400	650,916.00	0.07
69	601390	中国中铁	85,700	649,606.00	0.07
70	600919	江苏银行	85,300	626,955.00	0.06
71	003006	百亚股份	35,000	604,800.00	0.06
72	601800	中国交建	55,100	601,141.00	0.06
73	301039	中集车辆	44,700	591,381.00	0.06
74	603565	中谷物流	54,100	584,280.00	0.06
75	600580	卧龙电驱	38,800	566,868.00	0.06
76	000065	北方国际	36,550	548,981.00	0.06
77	601138	工业富联	20,900	526,680.00	0.05
78	601117	中国化学	62,200	515,016.00	0.05
79	003011	海象新材	15,900	512,775.00	0.05
80	000338	潍柴动力	40,100	499,646.00	0.05
81	600438	通威股份	13,944	478,418.64	0.05
82	600211	西藏药业	7,900	469,260.00	0.05
83	600461	洪城环境	56,800	464,056.00	0.05
84	600583	海油工程	78,100	456,885.00	0.05
85	601288	农业银行	123,200	434,896.00	0.04
86	688503	聚和材料	4,450	433,875.00	0.04
87	601328	交通银行	74,500	432,100.00	0.04
88	600926	杭州银行	36,300	426,525.00	0.04
89	603345	安井食品	2,900	425,720.00	0.04
90	601169	北京银行	91,000	421,330.00	0.04
91	002966	苏州银行	63,000	412,650.00	0.04

92	600016	民生银行	109,600	411,000.00	0.04
93	000001	平安银行	36,400	408,772.00	0.04
94	601658	邮储银行	83,000	405,870.00	0.04
95	002027	分众传媒	59,100	402,471.00	0.04
96	002847	盐津铺子	4,700	399,735.00	0.04
97	300515	三德科技	24,500	394,940.00	0.04
98	002345	潮宏基	50,100	393,786.00	0.04
99	601916	浙商银行	148,260	391,406.40	0.04
100	301291	明阳电气	12,054	391,066.98	0.04
101	603757	大元泵业	12,700	378,968.00	0.04
102	002429	兆驰股份	68,900	378,950.00	0.04
103	300012	华测检测	19,400	378,300.00	0.04
104	002402	和而泰	22,000	373,560.00	0.04
105	600600	青岛啤酒	3,600	373,068.00	0.04
106	300002	神州泰岳	26,600	372,400.00	0.04
107	002518	科士达	9,100	364,091.00	0.04
108	300009	安科生物	35,600	356,000.00	0.04
109	688357	建龙微纳	5,500	355,795.00	0.04
110	000543	皖能电力	53,600	353,760.00	0.04
111	601766	中国中车	54,400	353,600.00	0.04
112	000921	海信家电	13,000	350,350.00	0.04
113	002419	天虹股份	58,700	343,395.00	0.04
114	002335	科华数据	9,500	341,525.00	0.03
115	603136	天目湖	13,000	335,400.00	0.03
116	002536	飞龙股份	22,100	331,500.00	0.03
117	002415	海康威视	10,000	331,100.00	0.03
118	000625	长安汽车	25,500	329,715.00	0.03
119	002959	小熊电器	3,900	325,650.00	0.03
120	603050	科林电气	19,880	320,266.80	0.03
121	000425	徐工机械	47,100	318,867.00	0.03
122	300532	今天国际	15,500	318,680.00	0.03
123	002283	天润工业	48,700	312,654.00	0.03
124	688315	诺禾致源	11,700	310,635.00	0.03
125	603368	柳药集团	12,500	308,875.00	0.03
126	601137	博威合金	19,800	308,088.00	0.03
127	603129	春风动力	1,900	307,610.00	0.03
128	000333	美的集团	5,200	306,384.00	0.03
129	002929	润建股份	7,000	303,870.00	0.03
130	002056	横店东磁	16,600	302,286.00	0.03
131	300842	帝科股份	3,300	301,752.00	0.03
132	300258	精锻科技	20,600	298,494.00	0.03
133	600879	航天电子	34,900	296,301.00	0.03
134	601877	正泰电器	10,600	293,090.00	0.03

135	000923	河钢资源	21,600	291,600.00	0.03
136	600888	新疆众和	36,700	290,664.00	0.03
137	600548	深高速	32,200	289,156.00	0.03
138	300511	雪榕生物	38,000	288,800.00	0.03
139	603298	杭叉集团	12,200	287,310.00	0.03
140	601006	大秦铁路	38,600	286,798.00	0.03
141	002371	北方华创	900	285,885.00	0.03
142	000651	格力电器	7,800	284,778.00	0.03
143	600487	亨通光电	19,400	284,404.00	0.03
144	000630	铜陵有色	98,200	283,798.00	0.03
145	688569	铁科轨道	6,700	281,869.00	0.03
146	300795	米奥会展	6,750	281,542.50	0.03
147	600219	南山铝业	92,700	279,954.00	0.03
148	600998	九州通	26,808	278,267.04	0.03
149	301486	致尚科技	4,820	277,921.20	0.03
150	000636	风华高科	18,100	277,654.00	0.03
151	600073	上海梅林	37,800	275,940.00	0.03
152	002737	葵花药业	10,900	265,306.00	0.03
153	600332	白云山	8,300	264,604.00	0.03
154	601919	中远海控	27,200	255,680.00	0.03
155	600312	平高电气	20,600	255,234.00	0.03
156	002444	巨星科技	11,500	251,620.00	0.03
157	600757	长江传媒	29,200	251,120.00	0.03
158	605167	利柏特	25,700	248,776.00	0.03
159	002033	丽江股份	22,700	246,976.00	0.03
160	300349	金卡智能	17,700	245,676.00	0.03
161	300855	图南股份	6,870	242,648.40	0.02
162	600373	中文传媒	18,200	242,424.00	0.02
163	603279	景津装备	7,700	241,472.00	0.02
164	002129	TCL 中环	7,225	239,870.00	0.02
165	603688	石英股份	2,100	239,064.00	0.02
166	300750	宁德时代	1,040	237,941.60	0.02
167	600570	恒生电子	5,330	236,065.70	0.02
168	300314	戴维医疗	11,100	234,654.00	0.02
169	688186	广大特材	7,200	234,216.00	0.02
170	600129	太极集团	3,900	232,011.00	0.02
171	601601	中国太保	8,900	231,222.00	0.02
172	000858	五粮液	1,400	228,998.00	0.02
173	600415	小商品城	26,800	228,604.00	0.02
174	002459	晶澳科技	5,480	228,516.00	0.02
175	002865	钧达股份	1,497	228,337.41	0.02
176	603165	荣晟环保	14,200	227,768.00	0.02
177	300396	迪瑞医疗	7,000	227,430.00	0.02

178	603556	海兴电力	8,874	223,979.76	0.02
179	600188	兖矿能源	7,400	221,408.00	0.02
180	605009	豪悦护理	4,600	220,800.00	0.02
181	002970	锐明技术	6,900	217,281.00	0.02
182	600967	内蒙一机	21,500	217,150.00	0.02
183	603198	迎驾贡酒	3,400	216,920.00	0.02
184	600741	华域汽车	11,600	214,136.00	0.02
185	603882	金城医学	2,800	211,400.00	0.02
186	688009	中国通号	36,119	209,490.20	0.02
187	605368	蓝天燃气	21,840	209,008.80	0.02
188	600584	长电科技	6,700	208,839.00	0.02
189	600892	大晟文化	31,500	208,215.00	0.02
190	601899	紫金矿业	18,200	206,934.00	0.02
191	301096	百诚医药	3,400	206,074.00	0.02
192	600419	天润乳业	12,700	205,994.00	0.02
193	603369	今世缘	3,900	205,920.00	0.02
194	605289	罗曼股份	5,300	203,043.00	0.02
195	000785	居然之家	53,200	202,692.00	0.02
196	601000	唐山港	57,300	202,269.00	0.02
197	002384	东山精密	7,800	202,020.00	0.02
198	002832	比音勒芬	5,700	201,837.00	0.02
199	000862	银星能源	26,300	201,458.00	0.02
200	600566	济川药业	6,936	201,421.44	0.02
201	600887	伊利股份	7,100	201,072.00	0.02
202	603518	锦泓集团	17,700	200,895.00	0.02
203	002597	金禾实业	8,500	200,600.00	0.02
204	300979	华利集团	4,100	199,834.00	0.02
205	002403	爱仕达	19,800	199,584.00	0.02
206	300772	运达股份	15,400	198,352.00	0.02
207	300467	迅游科技	9,700	198,171.00	0.02
208	603901	永创智能	13,600	198,016.00	0.02
209	300119	瑞普生物	11,100	197,580.00	0.02
210	300051	三五互联	15,700	197,035.00	0.02
211	601567	三星医疗	15,600	197,028.00	0.02
212	600285	羚锐制药	12,200	195,932.00	0.02
213	688338	赛科希德	3,500	194,075.00	0.02
214	000778	新兴铸管	47,500	193,800.00	0.02
215	600031	三一重工	11,600	192,908.00	0.02
216	603803	瑞斯康达	20,300	191,226.00	0.02
217	600665	天地源	47,000	190,350.00	0.02
218	002786	银宝山新	29,500	190,275.00	0.02
219	603516	淳中科技	8,600	189,630.00	0.02
220	603529	爱玛科技	5,850	188,487.00	0.02

221	300888	稳健医疗	4,500	187,515.00	0.02
222	002158	汉钟精机	7,500	187,200.00	0.02
223	002244	滨江集团	21,200	186,984.00	0.02
224	301168	通灵股份	3,000	186,900.00	0.02
225	300951	博硕科技	3,400	185,742.00	0.02
226	600901	江苏金租	44,880	185,354.40	0.02
227	601126	四方股份	12,100	183,799.00	0.02
228	000725	京东方 A	44,700	182,823.00	0.02
229	002893	京能热力	16,900	182,013.00	0.02
230	688318	财富趋势	1,820	181,945.40	0.02
231	605399	晨光新材	10,200	181,560.00	0.02
232	601369	陕鼓动力	19,900	181,289.00	0.02
233	301079	邵阳液压	8,490	181,006.80	0.02
234	002940	昂利康	9,400	180,574.00	0.02
235	600469	风神股份	28,000	180,320.00	0.02
236	832225	利通科技	19,100	179,731.00	0.02
237	002334	英威腾	14,100	179,634.00	0.02
238	300777	中简科技	3,800	179,588.00	0.02
239	603499	翔港科技	18,800	179,352.00	0.02
240	600860	京城股份	13,800	179,124.00	0.02
241	301330	熵基科技	5,000	178,900.00	0.02
242	003816	中国广核	57,400	178,514.00	0.02
243	002299	圣农发展	9,300	178,095.00	0.02
244	002747	埃斯顿	6,300	176,400.00	0.02
244	600525	长园集团	30,000	176,400.00	0.02
246	300464	星徽股份	26,400	176,088.00	0.02
247	600012	皖通高速	16,800	176,064.00	0.02
248	000404	长虹华意	25,400	175,768.00	0.02
249	000521	长虹美菱	23,000	175,720.00	0.02
250	002162	悦心健康	39,100	175,559.00	0.02
251	000599	青岛双星	41,100	175,497.00	0.02
252	300360	炬华科技	9,800	175,224.00	0.02
253	300132	青松股份	30,900	175,203.00	0.02
254	300462	华铭智能	14,900	174,926.00	0.02
255	300885	海昌新材	16,800	174,888.00	0.02
256	300390	天华新能	4,880	174,704.00	0.02
257	603161	科华控股	11,983	174,592.31	0.02
258	603990	麦迪科技	7,900	174,195.00	0.02
259	002652	扬子新材	65,600	173,184.00	0.02
260	600119	长江投资	29,400	173,166.00	0.02
260	000596	古井贡酒	700	173,166.00	0.02
262	688296	和达科技	9,700	173,145.00	0.02
262	600498	烽火通信	8,500	173,145.00	0.02

264	002718	友邦吊顶	11,400	172,824.00	0.02
265	603063	禾望电气	5,600	172,200.00	0.02
266	002775	文科园林	45,900	172,125.00	0.02
267	002821	凯莱英	1,460	172,075.60	0.02
268	603289	泰瑞机器	15,300	171,666.00	0.02
269	000933	神火股份	13,100	170,300.00	0.02
270	603639	海利尔	9,500	170,240.00	0.02
271	002209	达意隆	16,600	170,150.00	0.02
272	600686	金龙汽车	20,900	170,126.00	0.02
273	002938	鹏鼎控股	7,000	170,030.00	0.02
274	603536	惠发食品	26,400	170,016.00	0.02
275	600375	汉马科技	22,400	169,792.00	0.02
276	002583	海能达	29,100	169,071.00	0.02
277	600097	开创国际	17,700	168,681.00	0.02
278	600198	大唐电信	24,600	168,510.00	0.02
279	002512	达华智能	42,000	168,420.00	0.02
280	301070	开勒股份	4,500	168,300.00	0.02
281	300407	凯发电气	18,400	167,992.00	0.02
282	600353	旭光电子	20,420	167,444.00	0.02
283	002185	华天科技	18,200	167,440.00	0.02
284	002947	恒铭达	8,000	166,720.00	0.02
285	002237	恒邦股份	15,300	166,617.00	0.02
286	300490	华自科技	9,700	166,452.00	0.02
287	300112	万讯自控	15,100	166,402.00	0.02
288	600797	浙大网新	23,300	166,362.00	0.02
289	300157	恒泰艾普	51,600	166,152.00	0.02
290	605507	国邦医药	7,800	165,906.00	0.02
291	603378	亚士创能	18,200	165,802.00	0.02
292	300530	领湃科技	7,300	165,272.00	0.02
293	300419	浩丰科技	26,400	165,264.00	0.02
294	300609	汇纳科技	5,900	165,200.00	0.02
295	600513	联环药业	17,100	165,186.00	0.02
296	600929	雪天盐业	20,700	164,358.00	0.02
297	002471	中超控股	61,400	163,938.00	0.02
298	002269	美邦服饰	104,300	163,751.00	0.02
299	300894	火星人	6,400	163,456.00	0.02
300	834475	三友科技	22,700	163,440.00	0.02
301	603086	先达股份	23,840	163,304.00	0.02
302	001266	宏英智能	5,600	162,680.00	0.02
303	603858	步长制药	7,900	162,661.00	0.02
304	603693	江苏新能	11,600	162,400.00	0.02
305	688623	双元科技	1,776	162,256.88	0.02
306	603689	皖天然气	18,500	162,245.00	0.02

307	301221	光庭信息	2,900	161,907.00	0.02
308	601113	华鼎股份	49,700	161,028.00	0.02
309	001322	箭牌家居	9,600	160,704.00	0.02
310	301051	信濠光电	2,650	160,298.50	0.02
311	300835	龙磁科技	5,100	160,038.00	0.02
312	601801	皖新传媒	17,000	159,630.00	0.02
313	002532	天山铝业	26,600	159,334.00	0.02
314	600661	昂立教育	16,700	159,151.00	0.02
315	688175	高凌信息	4,800	158,976.00	0.02
316	600502	安徽建工	30,100	158,928.00	0.02
317	603105	芯能科技	9,400	158,766.00	0.02
318	000498	山东路桥	24,700	158,574.00	0.02
319	603115	海星股份	10,300	158,311.00	0.02
320	002840	华统股份	10,100	157,964.00	0.02
321	300405	科隆股份	28,800	157,536.00	0.02
322	000852	石化机械	21,900	157,461.00	0.02
323	600483	福能股份	13,600	157,080.00	0.02
324	300242	佳云科技	45,500	156,975.00	0.02
325	300674	宇信科技	8,871	156,839.28	0.02
326	603969	银龙股份	33,700	155,694.00	0.02
327	000908	景峰医药	61,400	155,342.00	0.02
328	002105	信隆健康	26,100	155,295.00	0.02
329	605155	西大门	10,700	155,257.00	0.02
330	603511	爱慕股份	9,000	154,800.00	0.02
331	002581	未名医药	8,100	154,629.00	0.02
332	301077	星华新材	7,200	154,296.00	0.02
333	000534	万泽股份	9,200	154,284.00	0.02
334	002980	华盛昌	4,600	153,916.00	0.02
335	000555	神州信息	12,500	153,750.00	0.02
336	300876	蒙泰高新	5,900	153,695.00	0.02
337	600512	腾达建设	57,100	153,028.00	0.02
338	603633	徕木股份	11,700	152,919.00	0.02
339	301196	唯科科技	4,500	152,775.00	0.02
340	301397	溯联股份	3,618	152,606.80	0.02
341	603507	振江股份	4,200	152,292.00	0.02
342	300554	三超新材	7,300	152,059.00	0.02
343	603171	税友股份	3,800	151,924.00	0.02
344	001313	粤海饲料	19,200	151,680.00	0.02
345	301228	实朴检测	9,700	151,126.00	0.02
346	300449	汉邦高科	22,600	150,742.00	0.02
347	002688	金河生物	31,800	150,096.00	0.02
348	300787	海能实业	7,600	149,720.00	0.02
349	600180	瑞茂通	25,000	149,500.00	0.02

350	300642	透景生命	7,400	149,258.00	0.02
351	300203	聚光科技	7,300	147,971.00	0.02
352	300614	百川畅银	5,400	147,906.00	0.02
353	300440	运达科技	20,900	147,763.00	0.02
354	300872	天阳科技	9,500	147,630.00	0.02
355	301121	紫建电子	2,900	146,856.00	0.02
356	300773	拉卡拉	8,400	146,496.00	0.01
357	838171	邦德股份	16,200	146,286.00	0.01
358	688658	悦康药业	7,000	145,670.00	0.01
359	001308	康冠科技	5,300	145,538.00	0.01
360	301236	软通动力	5,300	144,213.00	0.01
361	301210	金杨股份	2,801	143,168.37	0.01
362	301327	华宝新能	1,800	142,398.00	0.01
363	688111	金山办公	300	141,666.00	0.01
364	301013	利和兴	9,900	141,570.00	0.01
365	300996	普联软件	4,600	141,220.00	0.01
366	300766	每日互动	8,400	140,784.00	0.01
367	301046	能辉科技	4,300	140,610.00	0.01
368	601058	赛轮轮胎	12,300	140,097.00	0.01
369	301026	浩通科技	3,900	139,308.00	0.01
370	603222	济民医疗	13,300	138,719.00	0.01
371	301395	仁信新材	5,196	138,629.28	0.01
372	688365	光云科技	9,500	136,990.00	0.01
373	600481	双良节能	9,700	135,606.00	0.01
374	300729	乐歌股份	7,590	135,405.60	0.01
375	002332	仙琚制药	10,200	135,150.00	0.01
376	688266	泽璟制药	2,900	134,995.00	0.01
377	832419	路斯股份	19,500	134,550.00	0.01
378	603551	奥普家居	10,400	134,472.00	0.01
379	688249	晶合集成	7,405	133,734.30	0.01
380	300579	数字认证	4,600	132,940.00	0.01
381	832000	安徽凤凰	25,000	131,750.00	0.01
382	000014	沙河股份	11,500	131,560.00	0.01
383	600784	鲁银投资	18,100	131,044.00	0.01
384	605599	菜百股份	9,900	130,779.00	0.01
385	301195	北路智控	2,800	130,368.00	0.01
386	832735	德源药业	5,480	129,218.40	0.01
387	002600	领益智造	18,400	127,144.00	0.01
388	830839	万通液压	18,000	126,180.00	0.01
389	833427	华维设计	23,300	125,587.00	0.01
390	836260	中寰股份	24,700	125,476.00	0.01
391	831039	国义招标	24,600	125,214.00	0.01
392	838924	广脉科技	20,200	124,836.00	0.01

393	002478	常宝股份	16,700	124,415.00	0.01
394	600681	百川能源	26,500	123,755.00	0.01
395	002638	勤上股份	37,100	123,543.00	0.01
396	603920	世运电路	6,300	123,039.00	0.01
397	835174	五新隧装	14,900	122,627.00	0.01
398	834415	恒拓开源	30,900	121,746.00	0.01
399	300259	新天科技	30,300	121,503.00	0.01
400	002381	双箭股份	15,700	121,204.00	0.01
401	002952	亚世光电	6,800	120,564.00	0.01
402	603328	依顿电子	14,500	120,060.00	0.01
403	002133	广宇集团	35,000	118,650.00	0.01
404	603619	中曼石油	7,000	118,440.00	0.01
405	836263	中航泰达	24,600	118,326.00	0.01
406	002304	洋河股份	900	118,215.00	0.01
407	601958	金钼股份	10,600	118,190.00	0.01
408	605158	华达新材	15,500	117,800.00	0.01
409	872925	锦好医疗	12,400	117,552.00	0.01
410	301292	海科新源	5,824	116,421.76	0.01
411	000885	城发环境	8,700	115,797.00	0.01
412	001218	丽臣实业	5,100	115,311.00	0.01
413	600658	电子城	20,700	114,471.00	0.01
414	300970	华绿生物	4,900	114,464.00	0.01
415	603367	辰欣药业	7,400	112,332.00	0.01
416	600728	佳都科技	16,100	111,573.00	0.01
417	603519	立霸股份	7,500	111,150.00	0.01
418	002131	利欧股份	48,200	110,860.00	0.01
419	601086	国芳集团	24,400	108,580.00	0.01
420	002746	仙坛股份	13,700	107,956.00	0.01
421	603230	内蒙新华	8,300	107,070.00	0.01
422	301080	百普赛斯	1,700	106,794.00	0.01
423	603259	药明康德	1,700	105,927.00	0.01
424	002728	特一药业	6,920	105,530.00	0.01
425	301488	豪恩汽电	2,618	104,144.04	0.01
426	688100	威胜信息	3,400	101,354.00	0.01
427	688078	龙软科技	1,900	97,945.00	0.01
428	301358	湖南裕能	2,023	86,766.47	0.01
429	000913	钱江摩托	4,700	85,681.00	0.01
430	601872	招商轮船	14,200	82,218.00	0.01
431	301232	飞沃科技	1,343	81,132.12	0.01
432	301202	朗威股份	3,060	79,009.20	0.01
433	688472	阿特斯	4,633	78,946.32	0.01
434	300582	英飞特	5,800	78,706.00	0.01
435	002050	三花智控	2,600	78,676.00	0.01

436	600690	海尔智家	3,300	77,484.00	0.01
437	605336	帅丰电器	4,500	77,400.00	0.01
438	300804	广康生化	2,257	77,134.83	0.01
439	688603	天承科技	1,391	76,505.00	0.01
440	688469	中芯集成	13,800	74,658.00	0.01
441	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	0.01
442	300911	亿田智能	1,900	72,143.00	0.01
443	002945	华林证券	5,200	71,136.00	0.01
444	601066	中信建投	2,900	70,180.00	0.01
445	601788	光大证券	4,400	69,916.00	0.01
446	601377	兴业证券	11,300	69,156.00	0.01
447	600958	东方证券	7,100	68,870.00	0.01
448	601688	华泰证券	5,000	68,850.00	0.01
449	601881	中国银河	5,900	68,499.00	0.01
450	300059	东方财富	4,800	68,160.00	0.01
451	000776	广发证券	4,600	67,666.00	0.01
452	301260	格力博	2,762	65,266.06	0.01
453	601689	拓普集团	800	64,560.00	0.01
454	002920	德赛西威	400	62,324.00	0.01
455	601799	星宇股份	500	61,800.00	0.01
456	603786	科博达	900	59,130.00	0.01
457	300863	卡倍亿	900	56,619.00	0.01
458	002965	祥鑫科技	1,000	55,680.00	0.01
459	603596	伯特利	700	55,482.00	0.01
460	688361	中科飞测	831	53,740.77	0.01
461	600933	爱柯迪	2,300	53,567.00	0.01
462	002594	比亚迪	200	51,654.00	0.01
463	688533	上声电子	1,100	51,403.00	0.01
464	002997	瑞鹄模具	1,700	50,541.00	0.01
465	601633	长城汽车	2,000	50,340.00	0.01
466	688531	日联科技	346	47,045.62	0.00
467	600150	中国船舶	1,200	39,492.00	0.00
468	301325	曼恩斯特	364	39,293.80	0.00
469	688146	中船特气	1,011	38,549.43	0.00
470	688033	天宜上佳	2,000	38,240.00	0.00
471	688516	奥特维	200	37,680.00	0.00
472	300161	华中数控	700	37,464.00	0.00
473	688121	卓然股份	1,000	37,400.00	0.00
474	688484	南芯科技	1,008	37,003.68	0.00
475	603667	五洲新春	2,400	35,712.00	0.00
476	300887	谱尼测试	900	35,622.00	0.00
477	603283	赛腾股份	800	35,600.00	0.00
478	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.00

479	300990	同飞股份	700	35,210.00	0.00
480	300757	罗博特科	400	35,204.00	0.00
481	688378	奥来德	700	34,580.00	0.00
482	603589	口子窖	700	34,545.00	0.00
483	603856	东宏股份	2,600	34,294.00	0.00
484	002529	海源复材	2,200	33,770.00	0.00
485	688408	中信博	400	33,732.00	0.00
486	601717	郑煤机	2,700	33,615.00	0.00
487	603338	浙江鼎力	600	33,606.00	0.00
488	002837	英维克	1,100	32,934.00	0.00
489	603966	法兰泰克	2,600	32,838.00	0.00
490	300092	科新机电	2,000	32,800.00	0.00
491	300416	苏试试验	1,500	32,340.00	0.00
492	603187	海容冷链	1,600	31,984.00	0.00
493	001287	中电港	1,386	29,133.72	0.00
494	688576	西山科技	240	28,898.40	0.00
495	301246	宏源药业	931	28,591.01	0.00
496	688352	颀中科技	2,361	28,497.27	0.00
497	688661	和林微纳	400	28,120.00	0.00
498	600038	中直股份	700	27,874.00	0.00
499	688507	索辰科技	222	27,108.42	0.00
500	301310	鑫宏业	409	26,760.87	0.00
501	688582	芯动联科	648	26,360.64	0.00
502	301293	三博脑科	333	23,782.86	0.00
503	301303	真兰仪表	1,058	23,614.56	0.00
504	688552	航天南湖	956	22,466.00	0.00
505	688570	天玛智控	884	22,391.72	0.00
506	301307	美利信	687	21,887.82	0.00
507	688543	国科军工	410	21,750.50	0.00
508	301322	绿通科技	392	20,870.08	0.00
509	688458	美芯晟	221	20,057.96	0.00
510	688581	安杰思	163	19,238.89	0.00
511	301317	鑫磊股份	694	18,161.98	0.00
512	301262	海看股份	692	17,646.00	0.00
513	301383	天键股份	493	17,609.96	0.00
514	688562	航天软件	726	16,197.06	0.00
515	301439	泓淋电力	949	16,038.10	0.00
516	301332	德尔玛	1,122	15,405.06	0.00
517	301399	英特科技	293	15,110.01	0.00
518	301305	朗坤环境	753	14,826.57	0.00
519	601222	林洋能源	1,800	14,742.00	0.00
520	301387	光大同创	307	13,925.52	0.00
521	688512	慧智微	721	13,814.36	0.00

522	301382	蜂助手	408	13,398.72	0.00
523	688433	华曙高科	418	13,167.00	0.00
524	301360	荣旗科技	134	12,408.40	0.00
525	301345	涛涛车业	266	12,406.24	0.00
526	300274	阳光电源	100	11,663.00	0.00
527	688523	航天环宇	472	11,257.20	0.00
528	603135	中重科技	628	11,234.92	0.00
529	301141	中科磁业	262	11,184.78	0.00
530	301225	恒勃股份	333	11,075.58	0.00
531	301429	森泰股份	499	10,488.98	0.00
532	601065	江盐集团	875	10,360.00	0.00
533	688631	莱斯信息	336	10,036.32	0.00
534	688479	友车科技	332	9,790.68	0.00
535	301376	致欧科技	420	9,454.20	0.00
536	301355	南王科技	563	9,430.25	0.00
537	301357	北方长龙	190	9,194.10	0.00
538	301386	未来电器	378	8,992.62	0.00
539	301323	新莱福	228	8,974.08	0.00
540	688429	时创能源	346	8,833.38	0.00
541	301170	锡南科技	250	8,732.50	0.00
542	301281	科源制药	338	8,483.80	0.00
543	002085	万丰奥威	1,200	8,316.00	0.00
544	688535	华海诚科	161	8,248.03	0.00
545	601133	柏诚股份	664	8,140.64	0.00
546	301157	华塑科技	150	7,939.50	0.00
547	301295	美硕科技	215	7,755.05	0.00
548	301203	国泰环保	225	7,740.00	0.00
549	301337	亚华电子	232	7,045.84	0.00
550	301428	世纪恒通	229	7,007.40	0.00
551	002895	川恒股份	300	5,910.00	0.00
552	001380	华纬科技	170	5,232.60	0.00
553	603237	五芳斋	140	4,246.20	0.00
554	603125	常青科技	160	3,924.80	0.00
555	001328	登康口腔	145	3,696.05	0.00
556	001282	三联锻造	105	3,468.15	0.00
557	001360	南矿集团	177	2,631.99	0.00
558	001324	长青科技	114	2,234.40	0.00
559	001367	海森药业	55	2,171.40	0.00
560	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	600547	山东黄金	8,160,817.00	0.53
2	600489	中金黄金	7,728,975.00	0.51
3	000975	银泰黄金	7,700,531.00	0.50
4	600988	赤峰黄金	5,290,211.00	0.35
5	300750	宁德时代	4,497,073.00	0.29
6	600519	贵州茅台	4,210,243.08	0.28
7	601155	新城控股	3,733,733.00	0.24
8	601318	中国平安	3,652,581.00	0.24
9	600941	中国移动	3,585,821.00	0.23
10	600050	中国联通	3,542,938.00	0.23
11	000065	北方国际	3,181,347.00	0.21
12	601800	中国交建	3,172,430.00	0.21
13	600938	中国海油	3,017,901.00	0.20
14	601857	中国石油	2,801,137.00	0.18
15	601728	中国电信	2,717,156.00	0.18
16	601186	中国铁建	2,530,855.00	0.17
17	601390	中国中铁	2,516,969.00	0.16
18	600028	中国石化	2,516,344.00	0.16
19	300003	乐普医疗	2,496,114.00	0.16
20	300146	汤臣倍健	2,481,244.00	0.16

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	300750	宁德时代	13,424,900.00	0.88
2	600519	贵州茅台	11,643,117.60	0.76
3	601166	兴业银行	6,649,351.00	0.43
4	600489	中金黄金	5,675,510.52	0.37
5	601318	中国平安	5,673,230.00	0.37
6	600547	山东黄金	5,412,933.00	0.35
7	000975	银泰黄金	5,114,078.18	0.33
8	600036	招商银行	4,914,742.26	0.32
9	600988	赤峰黄金	4,870,405.00	0.32
10	300760	迈瑞医疗	4,583,791.00	0.30
11	300009	安科生物	4,460,357.00	0.29
12	601012	隆基绿能	4,030,789.00	0.26
13	601857	中国石油	3,736,148.00	0.24
14	603259	药明康德	3,531,622.00	0.23
15	000001	平安银行	3,501,725.25	0.23

16	000568	泸州老窖	3,261,355.00	0.21
17	600048	保利发展	2,966,660.00	0.19
18	000065	北方国际	2,961,968.00	0.19
19	600438	通威股份	2,888,557.00	0.19
20	601800	中国交建	2,844,801.00	0.19

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	704,810,804.94
卖出股票收入（成交）总额	733,617,315.07

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	50,616,809.79	5.18
2	央行票据	-	-
3	金融债券	294,213,540.76	30.12
	其中：政策性金融债	45,386,086.91	4.65
4	企业债券	30,143,178.08	3.09
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	413,556,593.28	42.34
7	可转债（可交换债）	400,602.16	0.04
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	788,930,724.07	80.77

#### 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	2120018	21 东莞银行二级 01	500,000	52,638,114.75	5.39
2	102000166	20 陕延油 MTN002	500,000	51,287,808.22	5.25
3	2228006	22 中国银行二级 01	500,000	51,012,739.73	5.22
4	019688	22 国债 23	500,000	50,559,630.14	5.18
5	102381322	23 大唐集	500,000	50,021,311.48	5.12

		MTN004			
--	--	--------	--	--	--

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，中国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	1,899,323.81
2	应收清算款	30,268,393.43
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	46,012.37
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	32,213,729.61

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	110091	合力转债	63,963.15	0.01
2	127070	大中转债	19,631.86	0.00
3	123169	正海转债	5,805.04	0.00
4	118014	高测转债	4,985.70	0.00
5	127061	美锦转债	774.50	0.00

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
华夏睿磐泰兴混合 A	5,427	147,439.04	710,394,949.77	88.78%	89,756,705.57	11.22%
华夏睿磐泰兴混合 C	35	362,755.32	11,908,020.26	93.79%	788,415.85	6.21%
合计	5,462	148,818.76	722,302,970.03	88.86%	90,545,121.42	11.14%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	华夏睿磐泰兴混合 A	377,359.10	0.05%
	华夏睿磐泰兴混合 C	0.76	0.00%
	合计	377,359.86	0.05%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
----	------	--------------------

本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	华夏睿磐泰兴混合 A	0
	华夏睿磐泰兴混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	华夏睿磐泰兴混合 A	0
	华夏睿磐泰兴混合 C	0
	合计	0

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华夏睿磐泰兴混合 A	华夏睿磐泰兴混合 C
基金合同生效日（2017 年 7 月 14 日）基金份额总额	471,904,646.30	-
本报告期期初基金份额总额	1,306,216,118.07	373,478.50
本报告期基金总申购份额	130,285,686.17	13,150,831.57
减：本报告期基金总赎回份额	636,350,148.90	827,873.96
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	800,151,655.34	12,696,436.11

注：本基金自 2022 年 11 月 14 日增加 C 类基金份额类别。

## §10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期未发生影响基金管理人经营或基金运营业务的诉讼。

本报告期无涉及基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金所聘用的会计师事务所未发生改变。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人及其高级管理人员在本报告期内无受稽查或处罚等情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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	
长江证券	3	443,666,099.35	31.26%	191,353.27	31.19%	-
广发证券	1	420,370,211.17	29.62%	181,301.53	29.55%	-
国盛证券	2	301,935,310.58	21.28%	130,225.49	21.23%	-
国泰君安证券	2	241,600,124.05	17.02%	104,203.72	16.99%	-
中金公司	2	11,607,975.97	0.82%	6,384.94	1.04%	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-

注：①为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择券商的标准，即：

i 经营行为规范。

ii 公司财务状况良好。

iii 有良好的内控制度，在业内有良好的声誉。

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

v 建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯和服务。

②券商专用交易单元选择程序：

i 本基金管理人根据上述标准进行评估并确定选用的券商。

ii 本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议/证券经纪服务协议。

③除本表列示外，本基金还选择了安信证券、北京高华证券、财通证券、长城证券、川财证券、德邦证券、东方证券、东吴证券、东兴证券、东莞证券、方正证券、高华证券、光大证券、国海证券、国信证券、海通证券、华创证券、华西证券、汇丰前海证券、江海证券、开源证券、民生证券、平安证券、申万宏源证券、天风证券、万联证券、西部证券、信达证券、银河证券、招商证券、中国银河证券、中航证券、中信建投证券、中信证券、中邮证券的交易单元作为本基金交易单元，本报告期无股票交易及应付佣金。

④在上述租用的券商交易单元中，中邮证券的交易单元为本基金本期新增的交易单元。本期没有剔除的券商交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
长江证券	-	-	70,000,000.00	2.10%	-	-	-	-
广发证券	63,273,114.00	38.12%	1,060,000,000.00	31.75%	-	-	-	-
国盛证券	42,134,962.00	25.39%	2,163,500,000.00	64.80%	-	-	-	-
国泰君安证券	-	-	45,000,000.00	1.35%	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	60,555,000.00	36.49%	-	-	-	-	-	-

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	2023-02-24

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	2023-03-03
5	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-03-11
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	2023-03-23
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	2023-03-30
8	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-04-01
9	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-04-13
10	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-04-15
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	2023-04-27
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	2023-05-13
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	2023-05-27
14	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-05-31

## §11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20% 的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2023-01-01 至 2023-06-30	717,307,940.61	-	350,000,000.00	367,307,940.61	45.19%
产品特有风险							
<p>本基金在报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额20%的情形，在市场流动性不足的情况下，如遇投资者巨额赎回或集中赎回，基金管理人可能无法以合理的价格及时变现基金资产，有可能对基金净值产生一定的影响，甚至可能引发基金的流动性风险。</p> <p>在特定情况下，若持有基金份额占比较高的投资者大量赎回本基金，可能导致在其赎回后本基金资产规模持续低于</p>							

正常运作水平，面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。

## §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、《华夏睿磐泰兴混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《华夏睿磐泰兴混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、法律意见书；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照。

### 12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

### 12.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的住所免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

华夏基金管理有限公司

二〇二三年八月三十日