

华夏领先股票型证券投资基金

2021 年中期报告

2021 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：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二一年八月三十日

§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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 月 27 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 2021 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	4
§4 管理人报告	5
§5 托管人报告	10
§6 中期报告财务会计报告（未经审计）	11
6.1 资产负债表	11
6.2 利润表	12
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	13
6.4 报表附注	14
§7 投资组合报告	42
7.1 期末基金资产组合情况	42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	43
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	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	48
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	48
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	48
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	48
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	48
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	48
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	49
7.12 投资组合报告附注	49
§8 基金份额持有人信息	50
§9 开放式基金份额变动	50
§10 重大事件揭示	50
§11 影响投资者决策的其他重要信息	53
§12 备查文件目录	53

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华夏领先股票型证券投资基金
基金简称	华夏领先股票
基金主代码	001042
交易代码	001042
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 5 月 15 日
基金管理人	华夏基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,681,507,316.12 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	把握经济发展趋势和市场运行特征,挖掘经济发展过程中具有领先优势的企业,追求基金资产的长期、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、中小企业私募债券投资策略、权证投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略等。在股票投资策略上,本基金将重点关注具有较强竞争优势和增长潜力且估值合理的领先企业。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为:沪深 300 指数×90%+上证国债指数×10%。
风险收益特征	本基金属于股票基金,风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金,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	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李彬	郭明
	联系电话	400-818-6666	010-66105799
	电子邮箱	service@ChinaAMC.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-818-6666	95588
传真		010-63136700	010-66105798
注册地址		北京市顺义区安庆大街甲3号院	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址		北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座8层	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码		100033	100140
法定代表人		杨明辉	陈四清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
----------------	---------

登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.ChinaAMC.com
基金中期报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	华夏基金管理有限公司	北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 8 层

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	63,678,330.81
本期利润	197,190,905.16
加权平均基金份额本期利润	0.1084
本期加权平均净值利润率	12.45%
本期基金份额净值增长率	12.47%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年6月30日)
期末可供分配利润	-444,954,305.48
期末可供分配基金份额利润	-0.2646
期末基金资产净值	1,653,166,314.98
期末基金份额净值	0.983
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-1.70%

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）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	4.46%	1.54%	-1.80%	0.72%	6.26%	0.82%
过去三个月	24.27%	1.54%	3.24%	0.88%	21.03%	0.66%
过去六个月	12.47%	1.90%	0.48%	1.18%	11.99%	0.72%

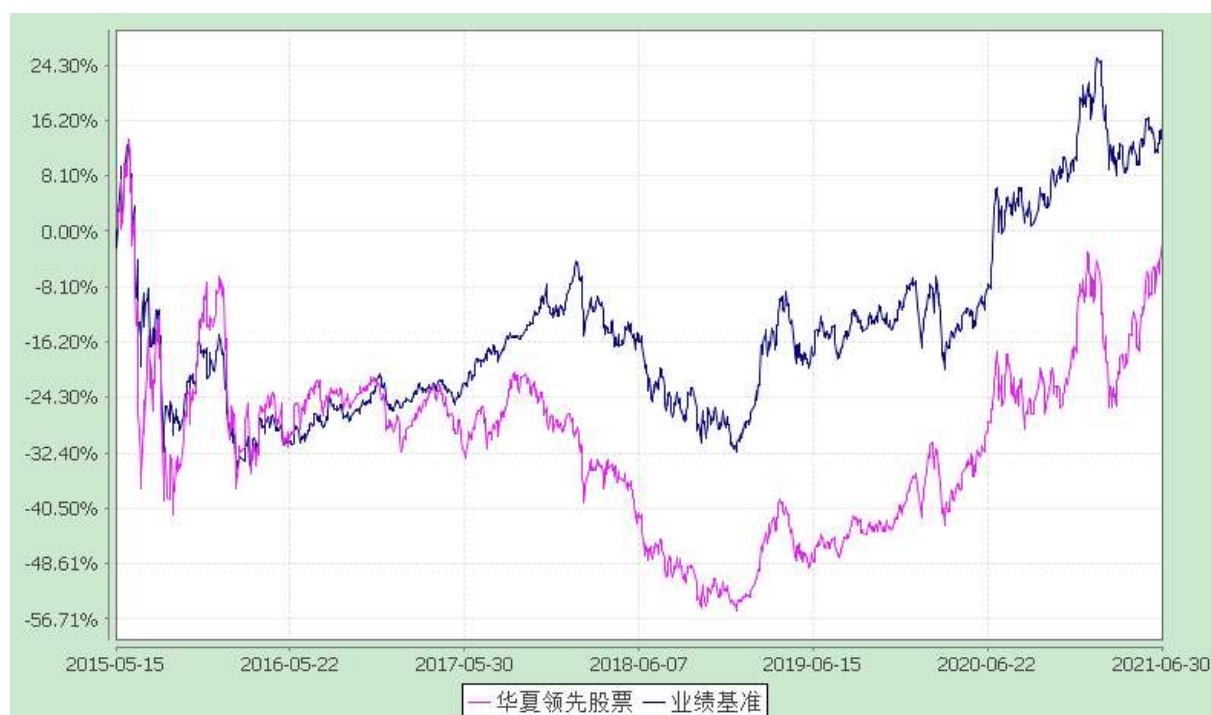
过去一年	33.74%	1.80%	23.18%	1.20%	10.56%	0.60%
过去三年	83.05%	1.58%	45.65%	1.23%	37.40%	0.35%
自基金合同生效起至今	-1.70%	1.85%	14.23%	1.34%	-15.93%	0.51%

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

华夏领先股票型证券投资基金

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

(2015 年 5 月 15 日至 2021 年 6 月 30 日)



§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

华夏基金管理有限公司成立于 1998 年 4 月 9 日,是经中国证监会批准成立的首批全国性基金管理公司之一。公司总部设在北京,在北京、上海、深圳、成都、南京、杭州、广州和青岛设有分公司,在香港、深圳、上海设有子公司。公司是首批全国社保基金管理人、首批企业年金基金管理人、境内首批 QDII 基金管理人、境内首只 ETF 基金管理人、境内首只沪港通 ETF 基金管理人、首批内地与香港基金互认基金管理人、首批基本养老保险基金投资管理人资格、首家加入联合国责任投资原则组织的公募基金公司、首批公募 FOF 基金管理人、首批公募养老目标基金管理人、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，以及特定客户资产管理人、保险资金投资管理人，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，目前旗下管理上证 50ETF(510050)、300ETF 基金(510330)、MSCIA 股 ETF(512990)、500ETF 基金(512500)、中小 100(159902)、双创基金(159783)、创业板 HX(159957)、科创 50ETF(588000)、中证 1000(159845)、央企改革 ETF(512950)、四川国改(159962)、浙江国资 ETF(515760)、战略新兴 ETF(512770)、5GETF(515050)、人工智能 AIETF(515070)、芯片 ETF(159995)、新能源车 ETF(515030)、智能车(159888)、高端装备 ETF(516320)、大湾区(159983)、沪港深 ETF(517170)、消费 ETF 基金(510630)、金融地产 ETF(510650)、医药卫生 ETF(510660)、食品饮料 ETF(515170)、券商 ETF 基金(515010)、银行 ETF 华夏(515020)、房地产 ETF 基金(515060)、大数据 50ETF(516000)、生物科技 ETF(516500)、新能源 80ETF(516850)、游戏 ETF(159869)、有色 50ETF(516650)、创蓝筹(159966)、创成长(159967)、恒生 ETF(513660)、恒生 ETF(159920)、恒生科技指数 ETF(513180)、恒生互联网 ETF(513330)、H 股 50(159850)、日经 ETF(513520)、纳斯达克 ETF(513300)、中期信用 ETF(511280)、豆粕 ETF(159985)、黄金 ETF9999(518850)，初步形成了覆盖大盘蓝筹、宽基指数、中小创指数、主题指数、行业指数、Smart Beta 策略、海外市场指数、信用债指数、商品指数等较为完整的产品线。

华夏基金以深入的投资研究为基础，尽力捕捉市场机会，为投资人谋求良好的回报。根据银河证券基金研究中心《中国基金业绩评价报告》，截至 2021 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 QDII 混合基金（A 类）中华夏新时代混合（QDII）排序第 1/36、华夏移动互联混合（QDII）排序第 4/36；在其他行业股票型基金（A 类）中华夏能源革新股票排序第 2/36；在消费行业偏股型基金（股票上下限 60%-95%）（A 类）中华夏新兴消费混合(A 类)排序第 2/21；在标准股票型基金（A 类）中华夏潜龙精选股票排序第 37/226；在绝对收益目标基金（A 类）中华夏回报混合(A 类)排序第 25/139、华夏回报二号混合排序第 27/139；在灵活配置型基金（股票上下限 0-95%+基准股票比例 30%60%）（A 类）中华夏军工安全混合排序第 39/491；在灵活配置型基金（股票上下限 0-95%+基准股票比例 30%-60%）（A 类）中华夏高端制造混合排序第 15/491、华夏稳盛混合排序第 54/491；在偏股型基金（股票上下限 60%-95%）（A 类）中华夏行业景气混合排序第 9/566、华夏行业龙头混合排序第 36/566；在偏股型基金（股票上限 80%）（A 类）中华夏经典混合排序第 11/128；在偏股型基金（股票上限 95%）（A 类）中华夏兴和混合排序第 11/168、华夏兴华混合(A 类)排序第 32/168、华夏大盘精选混合(A 类)排序第 40/168；在偏债型基金（A 类）中华夏睿磐泰茂混合

(A 类)排序第 44/149。FOF 类产品中,在养老目标风险 FOF(权益资产 0-30%)(A 类)中华夏稳健养老一年持有混合(FOF)排序第 4/20;在 QDII 混合基金(A 类)中华夏全球聚享(QDII)(A 类)排序第 10/36;

固收与固收+产品:在普通债券型基金(可投转债)(A 类)中华夏聚利债券排序第 1/196、华夏双债债券(A 类)排序第 3/196、华夏债券(A/B 类)排序第 12/196;在可转换债券型基金(A 类)中华夏可转债增强债券(A 类)排序第 3/34;在定期开放式纯债债券型基金(摊余成本法)(A 类)中华夏恒泰 64 个月定开债券排序第 12/73;在短期纯债债券型基金(A 类)中华夏短债债券(A 类)排序第 12/53;在偏债型基金(A 类)中华夏永康添福混合排序第 18/149;在普通债券型基金(二级)(A 类)中华夏安康债券(A 类)排序第 40/248、华夏鼎利债券(A 类)排序第 41/248。在 QDII 债券型基金(非 A 类)中华夏收益债券(QDII)(A 类)(美元)排序第 2/35、华夏大中华信用债券(QDII)(A 类)(美元)排序第 4/35;

指数与量化产品:在策略指数股票 ETF 基金中华夏创成长 ETF 排序第 1/22、华夏创蓝筹 ETF 排序第 6/22;在规模指数股票 ETF 基金中华夏创业板 ETF 排序第 1/90、华夏 MSCI 中国 A 股国际通 ETF 排序第 26/90;在行业指数股票 ETF 基金中华夏消费 ETF 排序第 4/39、华夏医药 ETF 排序第 5/39;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)排序第 6/93;在主题指数股票 ETF 基金中华夏中证新能源汽车 ETF 排序第 3/88、华夏中证四川国改 ETF 排序第 8/88、华夏战略新兴成指 ETF 排序第 11/88。

在《上海证券报》主办的第十八届“金基金”奖评选活动上,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,荣膺四大奖项:公司层面,华夏基金荣获“金基金 被动投资基金管理公司奖”;产品层面,华夏创新前沿股票荣获“金基金 股票型基金三年期奖”,华夏沪深 300ETF 荣获“金基金 指数基金三年期奖”,华夏能源革新股票荣获“金基金 社会责任投资(ESG)基金奖”。

在客户服务方面,2021 年上半年度,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)华夏基金管家客户端上线理财小管家和微信登录等功能,方便客户及时了解市场观点、投资者教育等信息,也为客户提供了多样的登录方式;(2)华夏基金公众号上线选基助手微信小程序,包含花样选基、目标选基、我的实验田等 5 大功能模块,帮助客户进行产品筛选;(3)与民商基金销售、众惠基金等代销机构合作,提供更多便捷的理财渠道;(4)开展“都 2021 年了,你还要自己记么?”、“震荡市需要口服镇心丸”、“风往哪吹”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	证券从业	说明
----	----	-----------	------	----

		(助理) 期限		年限	
		任职日期	离任日期		
刘平	本基金的基金经理	2020-07-21	-	14 年	硕士。2007 年 2 月加入华夏基金管理有限公司。曾任行业研究员、投资经理、机构投资部总监、华夏优势增长混合型证券投资基金基金经理（2015 年 11 月 30 日至 2020 年 7 月 28 日期间）等。
翟宇航	本基金的基金经理助理	2020-01-08	-	6 年	硕士。2015 年 7 月加入华夏基金管理有限公司。曾任投资研究部研究员等。

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 41 次，其中 20 次为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易，其余 21 次为不同基金经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易，有关基金经理已根据公司管理要求提供决策依据。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

国内经济方面，经济活动继续恢复，新冠疫苗有序广泛接种。今年春节倡导就地过年减少人员集中流动，有利于保障生产侧的供给。两会将 2021 年 GDP 增长目标设定为 6% 以上的弹性数据，是底线目标，意在保持政策目标的连续性并引导市场和地方政府将更多精力集中在结构调整上，引领经济高质量发展。经济恢复处于中后期，且结构上呈现分化，制造业投资增速较好，消费复苏较缓慢，同时二季度 PPI 加速上冲，但是 CPI 的抬升较为温和，货币政策还是以稳货币、紧信用为主，国内经济形势整体上稳中加固、稳中向好，但还存在不均衡的问题。

A 股市场在上半年的走势较为波折，开年上涨，2 月中旬春节假期结束后，因为“通胀预期上升，利率走高”大幅回调一个多月，影响市场的风格和估值，估值从扩张走向收缩，但到 3 月底市场企稳，随后整个 2 季度上涨。从上半年来看，行业分化和风格分化都很明显。以创业板指数（涨 17.2%）为代表的成长股表现好于传统行业为主的沪深 300 指数（涨+0.2%），且创业板指数创出新高。从行业内部来看也是分化严重，涨幅前三的行业是化工+25.7%、钢铁+24.7%、电力设备（新能源）+24.3%，跌幅最大的行业是非银金融-17.5%、家电-14.4%。总结来看上涨的有两种类型：一是商品价格上涨推升的周期板块如化工、钢铁、煤炭、有色等行业涨幅靠前；二是成长性板块中有两大方向的股价表现尤其突出，分别是碳中和（新能源车和光伏新能源）和自主可控（半导体和华为鸿蒙）。香港市场也体现出分化的特征，恒生指数上半年上涨 5.9%，但是恒生科技指数因为受到互联网反垄断和教育政策的压制，上半年下跌 3.2%。

上半年，本基金围绕着行业景气度进行投资，重点配置了新能源智能汽车、to B 的企业级服务 SaaS 公司和清洁家电等。本基金在高仓位积极运作，优化了持仓结构，主要是减持了一些景气度一般的行业信息化标的，增加了 VR/AR 标的配置、并增加了半导体的配置权重。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2021 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 0.983 元，本报告期份额净值增长率为 12.47%，同期业绩比较基准增长率为 0.48%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从长期的角度看，我们对如企业级服务的云计算 SaaS、新能源车、汽车电子等赛道的前景仍很看好，将密切跟踪抄底机会。我们依然坚信，科技创新仍是未来中国经济发展的核心驱动力，规范后的市场以及承担起社会责任的巨头都将迎来更健康的可持续发展。对于短期，经历了快速杀跌后，市场风险偏好有所下行，又回到前期下限的极值区域即到了安全边际，这就显示出恐慌情绪有所释放。在盈利仍旧上行、流动性环境尚可的情形下，不必过度悲观，我们对下半年大势的判断仍是总体维持震荡格局，我们将寻找结构性机会，优质个股在经历有效回调后估值消化会带来未来回报率的提升。

珍惜基金份额持有人的每一分投资和每一份信任，本基金将继续奉行华夏基金管理有限公司“为信任奉献回报”的经营理念，规范运作，审慎投资，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求长期、稳定的回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对华夏领先股票型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，华夏领先股票型证券投资基金的管理人——华夏基金管理有限公司在华夏领先股票型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对华夏基金管理有限公司编制和披露的华夏领先股票型证券投资基金 2021 年中期报告中财务指标、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进行了核查，

以上内容真实、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：华夏领先股票型证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	6.4.7.1	13,421,200.18	34,682,769.35
结算备付金		804,182.13	853,272.57
存出保证金		146,767.74	345,325.95
交易性金融资产	6.4.7.2	1,629,155,913.98	1,709,480,230.38
其中：股票投资		1,549,123,913.98	1,626,701,823.68
基金投资		-	-
债券投资		80,032,000.00	82,778,406.70
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		29,236,601.79	-
应收利息	6.4.7.5	1,881,739.57	880,411.72
应收股利		-	-
应收申购款		693,576.73	519,944.08
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,675,339,982.12	1,746,761,954.05
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 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		-	-
应付证券清算款		-	9.05
应付赎回款		18,228,388.59	8,719,839.28
应付管理人报酬		1,995,643.79	2,067,074.04
应付托管费		332,607.32	344,512.34

应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	1,513,994.76	2,222,445.96
应交税费		-	10.92
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	103,032.68	195,910.72
负债合计		22,173,667.14	13,549,802.31
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.7.9	1,681,507,316.12	1,984,087,312.11
未分配利润	6.4.7.10	-28,341,001.14	-250,875,160.37
所有者权益合计		1,653,166,314.98	1,733,212,151.74
负债和所有者权益总计		1,675,339,982.12	1,746,761,954.05

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.983 元，基金份额总额 1,681,507,316.12 份。

6.2 利润表

会计主体：华夏领先股票型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		212,300,801.40	351,724,759.61
1.利息收入		1,066,387.91	1,803,323.38
其中：存款利息收入	6.4.7.11	61,348.21	419,462.54
债券利息收入		1,005,039.70	753,466.87
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	630,393.97
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		77,053,270.24	204,523,606.82
其中：股票投资收益	6.4.7.12	72,945,179.07	193,361,038.39
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	1,307,160.41	184,128.40
资产支持证券投资收益	6.4.7.14	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-	4,825,126.22
股利收益	6.4.7.17	2,800,930.76	6,153,313.81
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	133,512,574.35	145,210,338.02
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	668,568.90	187,491.39

减：二、费用		15,109,896.24	20,731,239.01
1.管理人报酬		11,851,845.63	12,614,319.12
2.托管费		1,975,307.67	2,102,386.59
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	6.4.7.20	1,162,853.90	5,880,246.87
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.税金及附加		4.08	14,477.77
7.其他费用	6.4.7.21	119,884.96	119,808.66
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		197,190,905.16	330,993,520.60
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		197,190,905.16	330,993,520.60

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华夏领先股票型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,984,087,312.11	-250,875,160.37	1,733,212,151.74
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	197,190,905.16	197,190,905.16
三、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）	-302,579,995.99	25,343,254.07	-277,236,741.92
其中：1.基金申购款	250,534,853.29	-28,196,070.75	222,338,782.54
2.基金赎回款	-553,114,849.28	53,539,324.82	-499,575,524.46
四、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）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	1,681,507,316.12	-28,341,001.14	1,653,166,314.98
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	2,852,504,114.61	-1,124,000,677.97	1,728,503,436.64

二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	330,993,520.60	330,993,520.60
三、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)	-419,956,658.94	147,988,226.10	-271,968,432.84
其中：1.基金申购款	113,229,284.10	-40,852,192.37	72,377,091.73
2.基金赎回款	-533,185,943.04	188,840,418.47	-344,345,524.57
四、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)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	2,432,547,455.67	-645,018,931.27	1,787,528,524.40

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

华夏领先股票型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2015]98 号《关于准予华夏领先股票型证券投资基金注册的批复》的核准，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》、《华夏领先股票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 2015 年 5 月 11 日至 2015 年 5 月 13 日期间共募集 5,017,977,648.86 元（不含认购资金利息），业经德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）德师报（验）字（15）第 0634 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华夏领先股票型证券投资基金基金合同》于 2015 年 5 月 15 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 5,018,238,445.95 份基金份额，其中认购资金利息折合 260,797.09 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，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华夏领先股票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（包括创业板、中小板、存托凭证及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（含中小企业私募债券、可转换债券）、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货、国债期货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基金净值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 5%、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 2021 年 6 月 30 日
活期存款	13,421,200.18
定期存款	-
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	-
合计	13,421,200.18

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	969,459,915.10	1,549,123,913.98	579,663,998.88
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	79,800,320.00	80,032,000.00
	合计	79,800,320.00	80,032,000.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	1,049,260,235.10	1,629,155,913.98	579,895,678.88

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	1,470.01
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	378.90
应收债券利息	1,879,824.66
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	66.00
合计	1,881,739.57

6.4.7.6 其他资产

无。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	1,513,994.76
银行间市场应付交易费用	-
合计	1,513,994.76

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	8,813.13
应付证券出借违约金	-
预提费用	94,219.55
合计	103,032.68

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,984,087,312.11	1,984,087,312.11
本期申购	250,534,853.29	250,534,853.29

本期赎回（以“-”号填列）	-553,114,849.28	-553,114,849.28
本期末	1,681,507,316.12	1,681,507,316.12

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-594,061,673.78	343,186,513.41	-250,875,160.37
本期利润	63,678,330.81	133,512,574.35	197,190,905.16
本期基金份额交易产生的变动数	85,429,037.49	-60,085,783.42	25,343,254.07
其中：基金申购款	-72,133,498.82	43,937,428.07	-28,196,070.75
基金赎回款	157,562,536.31	-104,023,211.49	53,539,324.82
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-444,954,305.48	416,613,304.34	-28,341,001.14

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	54,627.28
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	4,954.01
其他	1,766.92
合计	61,348.21

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	520,011,935.80
减：卖出股票成本总额	447,066,756.73
买卖股票差价收入	72,945,179.07

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	2,984,487.91
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,674,300.00
减：应收利息总额	3,027.50

买卖债券差价收入	1,307,160.41
----------	--------------

6.4.7.14 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.15 贵金属投资收益

6.4.7.15.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.15.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.15.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.15.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.16 衍生工具收益

6.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	2,800,930.76
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	2,800,930.76

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
1.交易性金融资产	133,512,574.35
——股票投资	134,584,681.05
——债券投资	-1,072,106.70
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-

——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	133,512,574.35

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
基金赎回费收入	668,568.90
合计	668,568.90

6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
交易所市场交易费用	1,162,853.90
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	1,162,853.90

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021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	7,065.41
银行间账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	119,884.96

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华夏基金管理有限公司	基金管理人
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	基金托管人
中信证券股份有限公司（“中信证券”）	基金管理人的股东

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 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020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	717,634,276.16	96.40%	2,401,186,854.36	56.86%

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020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	2,984,487.91	100.00%	215,862.93	9.44%

6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020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	-	-	2,868,100,000.00	79.05%

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 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	525,239.03	96.40%	525,239.03	34.69%
关联方名称	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 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	1,756,080.15	55.76%	1,756,080.15	61.60%

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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	11,851,845.63	12,614,319.12
其中：支付销售机构的客户维护费	4,406,710.71	4,250,763.38

注：①支付基金管理人的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

②基金管理人报酬计算公式为：日基金管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.50% / 当年天数。

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30
----	----------------------------------	--

	30日	日
当期发生的基金应支付的托管费	1,975,307.67	2,102,386.59

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 0.25%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×0.25%/当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

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 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020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
中国工商银行活期存款	13,421,200.18	54,627.28	103,865,011.96	201,626.89

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

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2021年1月1日至2021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	688819	天能股份	网下申购	27,815	1,162,388.85
中信证券	688660	电气风电	网下申购	51,238	278,734.72
中信证券	688276	百克生物	网下申购	3,486	126,716.10

中信证券	688617	惠泰医疗	网下申购	1,673	124,571.58
中信证券	688575	亚辉龙	网下申购	3,435	50,838.00
中信证券	300982	苏文电能	网下申购	3,170	50,181.10
中信证券	300993	玉马遮阳	网下申购	4,097	49,573.70
中信证券	688315	诺禾致源	网下申购	3,711	47,352.36
中信证券	300997	欢乐家	网下申购	9,279	45,838.26
中信证券	688607	康众医疗	网下申购	1,890	43,866.90
中信证券	300930	屹通新材	网下申购	3,220	42,214.20
中信证券	603529	爱玛科技	网下申购	1,019	28,389.34
中信证券	688690	纳微科技	网下申购	3,477	28,059.39
中信证券	300966	共同药业	网下申购	2,858	23,549.92
中信证券	688565	力源科技	网下申购	2,464	23,136.96
中信证券	688226	威腾电气	网下申购	2,693	17,289.06
中信证券	600916	中国黄金	网下申购	3,371	16,821.29
中信证券	605060	联德股份	网下申购	883	13,765.97
中信证券	605488	福莱新材	网下申购	416	8,498.88
中信证券	001208	华菱线缆	网下申购	1,754	6,437.18
中信证券	003040	楚天龙	网下申购	1,101	5,086.62
中信证券	601279	英利汽车	网下申购	2,004	4,148.28
上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 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
-	-	-	-	-	-

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（2021 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	可流 通日	流 通 受 限 类	认购 价格	期末估 值单价	数量(单 位：股)	期末 成本总额	期末 估值总额	备 注

				型						
002230	科大讯飞	2019-07-17	2021-07-19	非公开发 行流通 受限	27.10	65.92	97,786	2,650,000.60	6,446,053.12	-
688538	和辉光电	2021-05-20	2021-11-29	新发流 通受限	2.65	3.38	375,156	994,163.40	1,268,027.28	-
688819	天能股份	2021-01-07	2021-07-19	新发流 通受限	41.79	43.69	27,815	1,162,388.85	1,215,237.35	-
688617	惠泰医疗	2020-12-30	2021-07-07	新发流 通受限	74.46	373.24	1,673	124,571.58	624,430.52	-
688131	皓元医药	2021-06-01	2021-12-08	新发流 通受限	64.99	247.10	1,955	127,055.45	483,080.50	-
688626	翔宇医疗	2021-03-23	2021-10-08	新发流 通受限	28.82	104.16	3,652	105,250.64	380,392.32	-
688690	纳微科	2021-06-16	2021-12-23	新发流	8.07	79.89	3,477	28,059.39	277,777.53	-

	技			通 受 限						
300957	贝 泰 妮	2021-03-18	2021-09-27	新发 流通 受限	47.33	251.96	853	40,372.49	214,921.88	-
688269	凯 立 新 材	2021-06-01	2021-12-09	新发 流通 受限	18.94	100.92	1,941	36,762.54	195,885.72	-
688687	凯 因 科 技	2021-01-29	2021-08-09	新发 流通 受限	18.98	27.98	5,354	101,618.92	149,804.92	-
688097	博 众 精 工	2021-04-29	2021-11-12	新发 流通 受限	11.27	28.01	3,983	44,888.41	111,563.83	-
688656	浩 欧 博	2021-01-06	2021-07-13	新发 流通 受限	35.26	72.60	1,371	48,341.46	99,534.60	-
300919	中 伟 股 份	2020-12-15	2021-07-02	新发 流通 受限	24.60	163.00	610	15,006.00	99,430.00	-
688639	华 恒 生 物	2021-04-14	2021-10-22	新发 流通 受	23.16	42.28	2,302	53,314.32	97,328.56	-

				限						
688499	利元亨	2021-06-23	2021-07-01	新发流通受限	38.85	38.85	2,149	83,488.65	83,488.65	-
300979	华利集团	2021-04-15	2021-10-26	新发流通受限	33.22	87.50	925	30,728.50	80,937.50	-
688359	三孚新科	2021-05-14	2021-11-22	新发流通受限	11.03	26.35	2,213	24,409.39	58,312.55	-
688239	航宇科技	2021-06-25	2022-01-05	新发流通受限	11.48	11.48	4,926	56,550.48	56,550.48	-
300981	中红医疗	2021-04-19	2021-10-27	新发流通受限	48.59	90.39	601	29,202.59	54,324.39	-
688087	英科再生	2021-06-30	2021-07-09	新发流通受限	21.96	21.96	2,469	54,219.24	54,219.24	-
688195	腾景科技	2021-03-18	2021-09-27	新发流通受限	13.60	19.87	2,693	36,624.80	53,509.91	-
301017	漱	2021-06-23	2021-07-05	新	8.86	8.86	4,995	44,255.70	44,255.70	-

	玉平民			发流通受限						
300973	立高食品	2021-04-08	2021-10-15	新发流通受限	28.28	115.71	360	10,180.80	41,655.60	-
301020	密封科技	2021-06-28	2021-07-06	新发流通受限	10.64	10.64	3,789	40,314.96	40,314.96	-
688067	爱威科技	2021-06-07	2021-12-16	新发流通受限	14.71	24.83	1,259	18,519.89	31,260.97	-
301021	英诺激光	2021-06-28	2021-07-06	新发流通受限	9.46	9.46	2,609	24,681.14	24,681.14	-
300953	震裕科技	2021-03-11	2021-09-22	新发流通受限	28.77	99.85	240	6,904.80	23,964.00	-
300941	创识科技	2021-02-02	2021-08-09	新发流通受限	21.31	49.94	399	8,502.69	19,926.06	-
301015	百洋医	2021-06-22	2021-12-30	新发流	7.64	38.83	462	3,529.68	17,939.46	-

	药			通受限						
688226	威腾电气	2021-06-28	2021-07-07	新发流通受限	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	-
300982	苏文电能	2021-04-19	2021-10-27	新发流通受限	15.83	45.29	317	5,018.11	14,356.93	-
300968	格林精密	2021-04-06	2021-10-15	新发流通受限	6.87	12.07	1,162	7,982.94	14,025.34	-
300940	南极光	2021-01-27	2021-08-03	新发流通受限	12.76	43.38	307	3,917.32	13,317.66	-
300614	百川畅银	2021-05-18	2021-11-25	新发流通受限	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02	-
300937	药易购	2021-01-20	2021-07-27	新发流通受限	12.25	53.71	244	2,989.00	13,105.24	-
301013	利和兴	2021-06-21	2021-12-29	新发流通受	8.72	27.11	471	4,107.12	12,768.81	-

				限						
300942	易瑞生物	2021-02-02	2021-08-09	新发流通受限	5.31	28.52	443	2,352.33	12,634.36	-
300997	欢乐家	2021-05-26	2021-12-02	新发流通受限	4.94	13.05	928	4,584.32	12,110.40	-
300933	中辰股份	2021-01-15	2021-07-22	新发流通受限	3.37	10.44	1,112	3,747.44	11,609.28	-
301002	崧盛股份	2021-05-27	2021-12-07	新发流通受限	18.71	57.62	201	3,760.71	11,581.62	-
605287	德才股份	2021-06-28	2021-07-06	新发流通受限	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-
300955	嘉亨家化	2021-03-16	2021-09-24	新发流通受限	16.53	46.07	232	3,834.96	10,688.24	-
300996	普联软件	2021-05-26	2021-12-03	新发流通受限	20.81	42.23	241	5,015.21	10,177.43	-
300956	英	2021-03-16	2021-09-27	新	12.85	25.80	371	4,767.35	9,571.80	-

	力股份			发流通受限						
300962	中金辐照	2021-03-29	2021-10-11	新发流通受限	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12	-
300952	恒辉安防	2021-03-03	2021-09-13	新发流通受限	11.72	27.08	340	3,984.80	9,207.20	-
301016	雷尔伟	2021-06-23	2021-12-30	新发流通受限	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50	-
300966	共同药业	2021-03-31	2021-10-11	新发流通受限	8.24	31.54	286	2,356.64	9,020.44	-
300945	曼卡龙	2021-02-03	2021-08-10	新发流通受限	4.56	18.88	474	2,161.44	8,949.12	-
300948	冠中生态	2021-02-18	2021-08-25	新发流通受限	13.00	27.42	324	2,808.00	8,884.08	-
300931	通用电	2021-01-13	2021-07-21	新发流	4.31	13.11	672	2,896.32	8,809.92	-

	梯			通受限						
300961	深水海纳	2021-03-23	2021-09-30	新发流通受限	8.48	22.07	394	3,341.12	8,695.58	-
300950	德固特	2021-02-24	2021-09-03	新发流通受限	8.41	39.13	219	1,841.79	8,569.47	-
605162	新中港	2021-06-29	2021-07-07	新发流通受限	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39	-
300958	建工修复	2021-03-18	2021-09-29	新发流通受限	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00	-
300986	志特新材	2021-04-21	2021-11-01	新发流通受限	14.79	30.57	264	3,904.56	8,070.48	-
300987	川网传媒	2021-04-28	2021-11-11	新发流通受限	6.79	26.81	301	2,043.79	8,069.81	-
300926	博俊科技	2020-12-29	2021-07-12	新发流通受限	10.76	22.20	359	3,862.84	7,969.80	-

				限						
300993	玉马遮阳	2021-05-17	2021-11-24	新发流通受限	12.10	19.29	410	4,961.00	7,908.90	-
300930	屹通新材	2021-01-13	2021-07-21	新发流通受限	13.11	24.48	322	4,221.42	7,882.56	-
300985	致远新能	2021-04-21	2021-10-29	新发流通受限	24.90	24.81	295	7,345.50	7,318.95	-
300971	博亚精工	2021-04-07	2021-10-15	新发流通受限	18.24	28.29	245	4,468.80	6,931.05	-
301004	嘉益股份	2021-06-18	2021-12-27	新发流通受限	7.81	21.94	312	2,436.72	6,845.28	-
300991	创益通	2021-05-12	2021-11-22	新发流通受限	13.06	26.51	254	3,317.24	6,733.54	-
300927	江天化学	2020-12-29	2021-07-07	新发流通受限	13.39	30.10	217	2,905.63	6,531.70	-
300975	商	2021-04-14	2021-10-21	新	5.48	13.03	492	2,696.16	6,410.76	-

	络电子			发流通受限						
300963	中洲特材	2021-03-30	2021-10-11	新发流通受限	12.13	22.49	283	3,432.79	6,364.67	-
301011	华立科技	2021-06-09	2021-12-17	新发流通受限	14.20	33.84	175	2,485.00	5,922.00	-
300943	春晖智控	2021-02-03	2021-08-10	新发流通受限	9.79	23.01	255	2,496.45	5,867.55	-
300967	晓鸣股份	2021-04-02	2021-10-13	新发流通受限	4.54	11.54	507	2,301.78	5,850.78	-
300972	万辰生物	2021-04-08	2021-10-19	新发流通受限	7.19	12.65	430	3,091.70	5,439.50	-
300929	华骐环保	2021-01-12	2021-07-21	新发流通受限	13.87	29.55	183	2,538.21	5,407.65	-
300960	通业科	2021-03-22	2021-09-29	新发流	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04	-

	技			通 受 限						
301017	漱 玉 平 民	2021-06-23	2022-01-05	新发 流通 受限	8.86	8.86	555	4,917.30	4,917.30	-
301020	密 封 科 技	2021-06-28	2022-01-06	新发 流通 受限	10.64	10.64	421	4,479.44	4,479.44	-
300995	奇 德 新 材	2021-05-17	2021-11-26	新发 流通 受限	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	-
301007	德 迈 仕	2021-06-04	2021-12-16	新发 流通 受限	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	-
300998	宁 波 方 正	2021-05-25	2021-12-02	新发 流通 受限	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	-
301012	扬 电 科 技	2021-06-15	2021-12-22	新发 流通 受限	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20	-
300992	泰 福 泵 业	2021-05-17	2021-11-25	新发 流通 受	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00	-

				限						
301010	晶雪节能	2021-06-09	2021-12-20	新发流通受限	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	-
301021	英诺激光	2021-06-28	2022-01-06	新发流通受限	9.46	9.46	290	2,743.40	2,743.40	-

注：①根据中国证监会《上市公司证券发行管理办法》、《创业板上市公司证券发行管理暂行办法》以及《上市公司非公开发行股票实施细则》，本基金作为特定投资者所认购的 2020 年 2 月 14 日前发行完毕的非公开发行股份，自发行结束之日起 12 个月内不得转让。根据《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》，本基金持有的上市公司非公开发行股份，采取集中竞价交易方式的，在任意连续 90 日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的 1%，且自股份解除限售之日起 12 个月内，通过集中竞价交易减持的数量不得超过本基金持有该次非公开发行股份数量的 50%；采取大宗交易方式的，在任意连续 90 日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的 2%。本基金通过大宗交易方式受让的原上市公司大股东减持或者特定股东减持的股份，在受让后 6 个月内，不得转让所受让的股份。

根据中国证监会《关于修改<上市公司证券发行管理办法>的决定》、《关于修改<创业板上市公司证券发行管理暂行办法>的决定》以及《关于修改<上市公司非公开发行股票实施细则>的决定》，本基金所认购的 2020 年 2 月 14 日(含)后发行完毕的非公开发行股份，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。此外，本基金减持上述非公开发行股份不适用《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》的有关规定。

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

③根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期为自发行人股票上市之日起 6 个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方

式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

④根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于 6 个月的限售期。

⑤基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

⑥以上“可流通日”是根据上市公司公告估算的流通日期，最终日期以上市公司公告为准。

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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	合计
银行存款	13,421,200.18	-	-	13,421,200.18
结算备付金	804,182.13	-	-	804,182.13
结算保证金	146,767.74	-	-	146,767.74
债券投资	80,032,000.00	-	-	80,032,000.00
资产支持证券	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-
应收直销申购款	-	-	-	-
上年度末 2020 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	合计
银行存款	34,682,769.35	-	-	34,682,769.35
结算备付金	853,272.57	-	-	853,272.57
结算保证金	345,325.95	-	-	345,325.95
债券投资	82,778,406.70	-	-	82,778,406.70
资产支持证券	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-
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 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
	利率下降 25 个基点	15,136.00	113,707.33
	利率上升 25 个基点	-15,130.42	-113,388.38

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 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 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	1,549,123,913.98	93.71	1,626,701,823.68	93.85
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	2,794,406.70	0.16
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	1,549,123,913.98	93.71	1,629,496,230.38	94.02

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 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
	-5%	-97,088,692.15	-87,824,717.90
	+5%	97,088,692.15	87,824,717.90

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

（1）金融工具公允价值计量的方法

根据企业会计准则的相关规定，以公允价值计量的金融工具，其公允价值的计量可分为三个层次：

第一层次：对存在活跃市场报价的金融工具，可以相同资产/负债在活跃市场上的报价确定公允价值。

第二层次：对估值日活跃市场无报价的金融工具，可以类似资产/负债在活跃市场上的报价为依

据做必要调整确定公允价值；对估值日不存在活跃市场的金融工具，可以相同或类似资产/负债在非活跃市场上的报价为依据做必要调整确定公允价值。

第三层次：对无法获得相同或类似资产可比市场交易价格的金融工具，可以其他反映市场参与者对资产/负债定价时所使用的参数为依据确定公允价值。

（2）各层次金融工具公允价值

截至 2021 年 6 月 30 日止，本基金持有的以公允价值计量的金融工具第一层次的余额为 1,536,684,519.89 元，第二层次的余额为 92,471,394.09 元，第三层次的余额为 0 元。（截至 2020 年 12 月 31 日止：第一层次的余额为 1,546,981,472.01 元，第二层次的余额为 162,498,758.37 元，第三层次的余额为 0 元。）

（3）公允价值所属层次间的重大变动

对于特殊事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)的股票，本基金将相关股票公允价值所属层次于其进行估值调整之日起从第一层次转入第二层次或第三层次，于股票复牌能体现公允价值并恢复市价估值之日起从第二层次或第三层次转入第一层次。对于持有的非公开发行股票，本基金于限售期内将相关股票公允价值所属层次列入第二层次，于限售期满并恢复市价估值之日起从第二层次转入第一层次。

（4）第三层次公允价值本期变动金额

本基金持有的以公允价值计量的金融工具第三层次公允价值本期未发生变动。

§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	1,549,123,913.98	92.47
	其中：股票	1,549,123,913.98	92.47
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	80,032,000.00	4.78
	其中：债券	80,032,000.00	4.78
	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	14,225,382.31	0.85
8	其他各项资产	31,958,685.83	1.91
9	合计	1,675,339,982.12	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	11,290.28	0.00
B	采矿业	-	-
C	制造业	979,849,305.70	59.27
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	50,047.59	0.00
E	建筑业	25,371.37	0.00
F	批发和零售业	328,753.90	0.02
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	423,692,632.69	25.63
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	54,807,719.50	3.32
M	科学研究和技术服务业	11,641,080.50	0.70
N	水利、环境和公共设施管理业	44,438.33	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	32,394,136.32	1.96
R	文化、体育和娱乐业	46,279,137.80	2.80
S	综合	-	-
	合计	1,549,123,913.98	93.71

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	300782	卓胜微	269,968	145,107,800.00	8.78
2	300750	宁德时代	264,498	141,453,530.40	8.56
3	300450	先导智能	1,647,360	99,072,230.40	5.99
4	002410	广联达	1,415,572	96,542,010.40	5.84
5	002230	科大讯飞	1,429,183	96,421,862.38	5.83
6	688169	石头科技	74,465	93,900,365.00	5.68
7	300454	深信服	295,848	76,766,639.04	4.64

8	002475	立讯精密	1,644,509	75,647,414.00	4.58
9	688111	金山办公	157,667	62,246,931.60	3.77
10	002241	歌尔股份	1,413,647	60,419,272.78	3.65
11	603486	科沃斯	255,896	58,364,759.68	3.53
12	300896	爱美客	70,074	55,279,977.12	3.34
13	300413	芒果超媒	674,623	46,279,137.80	2.80
14	603799	华友钴业	386,300	44,115,460.00	2.67
15	002985	北摩高科	375,969	36,656,977.50	2.22
16	300015	爱尔眼科	456,384	32,394,136.32	1.96
17	000858	五 粮 液	101,298	30,175,661.22	1.83
18	688083	中望软件	54,476	30,087,094.80	1.82
19	601888	中国中免	98,115	29,444,311.50	1.78
20	601633	长城汽车	667,986	29,117,509.74	1.76
21	002460	赣锋锂业	221,700	26,845,653.00	1.62
22	603039	泛微网络	398,216	26,501,274.80	1.60
23	300662	科锐国际	418,400	25,363,408.00	1.53
24	600862	中航高科	709,027	21,823,851.06	1.32
25	002179	中航光电	216,674	17,121,579.48	1.04
26	688002	睿创微纳	170,929	17,063,842.07	1.03
27	002153	石基信息	705,039	16,575,466.89	1.00
28	300760	迈瑞医疗	29,606	14,212,360.30	0.86
29	300012	华测检测	350,000	11,158,000.00	0.67
30	688188	柏楚电子	23,600	10,289,600.00	0.62
31	688023	安恒信息	30,406	7,662,312.00	0.46
32	002841	视源股份	41,500	5,158,035.00	0.31
33	300957	贝泰妮	8,523	2,298,784.18	0.14
34	688538	和辉光电	375,156	1,268,027.28	0.08
35	688819	天能股份	27,815	1,215,237.35	0.07
36	688617	惠泰医疗	1,673	624,430.52	0.04
37	688699	明微电子	1,869	533,263.08	0.03
38	688131	皓元医药	1,955	483,080.50	0.03
39	688626	翔宇医疗	3,652	380,392.32	0.02
40	688161	威高骨科	3,069	325,467.45	0.02
41	688690	纳微科技	3,477	277,777.53	0.02
42	301015	百洋医药	4,614	251,115.78	0.02
43	688269	凯立新材	1,941	195,885.72	0.01
44	688687	凯因科技	5,354	149,804.92	0.01
45	301016	雷尔伟	2,747	115,711.58	0.01
46	688097	博众精工	3,983	111,563.83	0.01
47	688656	浩欧博	1,371	99,534.60	0.01
48	300919	中伟股份	610	99,430.00	0.01
49	688639	华恒生物	2,302	97,328.56	0.01
50	301004	嘉益股份	3,115	90,654.98	0.01

51	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.01
52	300979	华利集团	925	80,937.50	0.00
53	688571	杭华股份	8,200	73,882.00	0.00
54	688359	三孚新科	2,213	58,312.55	0.00
55	688239	航宇科技	4,926	56,550.48	0.00
56	300981	中红医疗	601	54,324.39	0.00
57	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.00
58	688195	腾景科技	2,693	53,509.91	0.00
59	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.00
60	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.00
61	300973	立高食品	360	41,655.60	0.00
62	600032	浙江新能	3,045	37,027.20	0.00
63	688067	爱威科技	1,259	31,260.97	0.00
64	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.00
65	300953	震裕科技	240	23,964.00	0.00
66	300941	创识科技	399	19,926.06	0.00
67	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
68	300925	法本信息	600	15,774.00	0.00
69	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00
70	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.00
71	300940	南极光	307	13,317.66	0.00
72	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
73	300937	药易购	244	13,105.24	0.00
74	301013	利和兴	471	12,768.81	0.00
75	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00
76	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
77	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
78	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.00
79	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
80	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
81	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
82	300996	普联软件	241	10,177.43	0.00
83	300956	英力股份	371	9,571.80	0.00
84	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
85	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
86	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
87	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
88	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
89	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
90	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
91	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
92	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
93	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00

94	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
95	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
96	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
97	300993	玉马遮阳	410	7,908.90	0.00
98	300930	屹通新材	322	7,882.56	0.00
99	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00
100	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
101	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
102	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
103	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
104	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
105	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
106	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
107	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
108	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
109	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
110	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
111	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
112	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
113	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
114	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
115	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
116	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
117	301010	晶雪节能	218	3,838.98	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	002241	歌尔股份	58,037,269.60	3.35
2	002230	科大讯飞	33,650,263.08	1.94
3	002460	赣锋锂业	27,466,050.71	1.58
4	688083	中望软件	22,978,561.61	1.33
5	300782	卓胜微	20,161,973.60	1.16
6	300601	康泰生物	20,012,995.00	1.15
7	002410	广联达	12,988,812.00	0.75
8	688188	柏楚电子	8,459,371.79	0.49
9	601888	中国中免	7,906,156.00	0.46
10	002153	石基信息	7,288,577.42	0.42
11	002841	视源股份	5,467,935.00	0.32
12	688819	天能股份	1,162,388.85	0.07
13	688538	和辉光电	994,163.40	0.06

14	300957	贝泰妮	403,393.59	0.02
15	688606	奥泰生物	361,310.01	0.02
16	300979	华利集团	307,152.12	0.02
17	300981	中红医疗	291,685.77	0.02
18	688660	电气风电	278,734.72	0.02
19	688317	之江生物	248,082.80	0.01
20	688183	生益电子	228,453.48	0.01

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	603267	鸿远电子	57,582,254.20	3.32
2	600570	DR 恒生电	54,260,616.72	3.13
3	300699	光威复材	31,746,382.29	1.83
4	300253	卫宁健康	30,358,873.01	1.75
5	002179	中航光电	26,286,027.69	1.52
6	603129	春风动力	24,499,377.41	1.41
7	688169	石头科技	24,273,727.64	1.40
8	002050	三花智控	23,026,173.46	1.33
9	002153	石基信息	21,933,170.95	1.27
10	689009	九号公司	21,772,943.20	1.26
11	600862	中航高科	20,631,199.50	1.19
12	002920	德赛西威	20,334,832.54	1.17
13	603712	七一二	19,852,550.14	1.15
14	603799	华友钴业	17,852,270.00	1.03
15	688002	睿创微纳	16,629,609.19	0.96
16	300601	康泰生物	15,053,365.15	0.87
17	300662	科锐国际	10,282,372.00	0.59
18	688023	安恒信息	10,001,929.77	0.58
19	601633	长城汽车	9,180,482.82	0.53
20	002475	立讯精密	8,560,173.80	0.49

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

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	234,904,165.98
卖出股票的收入（成交）总额	520,011,935.80

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	80,032,000.00	4.84
	其中：政策性金融债	80,032,000.00	4.84
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	80,032,000.00	4.84

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	200309	20 进出 09	800,000	80,032,000.00	4.84
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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无股指期货投资。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末无股指期货投资。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末无国债期货投资。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无国债期货投资。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货投资。

7.12 投资组合报告附注

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

7.12.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	146,767.74
2	应收证券清算款	29,236,601.79
3	应收股利	-
4	应收利息	1,881,739.57
5	应收申购款	693,576.73
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	31,958,685.83

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002230	科大讯飞	6,446,053.12	0.39	非公开发行流通受限

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
40,429	41,591.61	1,227,869.78	0.07%	1,680,279,446.34	99.93%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	1,791,889.95	0.11%

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	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015 年 5 月 15 日）基金份额总额	5,018,238,445.95
本报告期期初基金份额总额	1,984,087,312.11
本报告期基金总申购份额	250,534,853.29
减：本报告期基金总赎回份额	553,114,849.28
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,681,507,316.12

§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

本基金管理人于 2021 年 4 月 9 日发布公告，郑煜女士、孙彬先生担任华夏基金管理有限公司副

总经理，蔡向阳先生担任华夏基金管理有限公司高级管理人员。

中国工商银行股份有限公司（以下简称“本公司”）根据工作需要，任命刘彤女士担任本公司资产托管部总经理，全面主持资产托管部相关工作。刘彤女士的托管人高级管理人员任职信息已经在中国证券投资基金业协会备案。李勇先生不再担任本公司资产托管部总经理职务。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、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

本基金管理人、基金托管人涉及托管业务的部门及其高级管理人员在本报告期内无受稽查或处罚等情况。

10.7 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	6	717,634,276.16	96.40%	525,239.03	96.40%	-
长江证券	1	18,987,820.77	2.55%	13,885.70	2.55%	-
中信建投证券	2	7,807,804.68	1.05%	5,710.02	1.05%	-

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，在近一年内无重大违规行为。

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 有较强的研究能力，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。

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 对交易单元候选券商的研究服务进行评估

本基金管理人组织相关人员依据交易单元选择标准对交易单元候选券商的服务质量和研究实力进行评估，确定选用交易单元的券商。

ii 协议签署及通知托管人

本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。

③除本表列示外，本基金还选择了东北证券、东方证券、方正证券、国金证券、国盛证券、国泰君安、国泰君安证券、华安证券、上海证券、新时代证券、信达证券、兴业证券、银河证券、粤开证券、招商证券、中金公司、中泰证券、中投证券、中银国际、中银国际证券的交易单元作为本基金交易单元，本报告期无股票交易及应付佣金。

④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		回购交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例
中信证券	2,984,487.91	100.00%	-	-
长江证券	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-

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	2021-01-04
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	2021-01-09
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	2021-01-15
4	华夏基金管理有限公司关于终止部分代销机构办理本公司旗下基金销售业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-01-20
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	2021-01-27
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	2021-02-01
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	2021-02-24
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	2021-03-12

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	2021-04-02
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	2021-04-07
11	华夏基金管理有限公司公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-09
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	2021-04-09
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	2021-04-21
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	2021-05-08
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	2021-05-12
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	2021-05-13
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	2021-05-19
18	华夏基金管理有限公司关于深圳分公司营业场所变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-05-25
19	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-05-28
20	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-06-04
21	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-06-09
22	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-06-17
23	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-06-18
24	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-06-19
25	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-06-30

§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、《华夏领先股票型证券投资基金基金合同》；
- 3、《华夏领先股票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

二〇二一年八月三十日