

华夏睿磐泰盛混合型证券投资基金

2022 年第 2 季度报告

2022 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：二〇二二年七月二十日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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 2022 年 7 月 18 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华夏睿磐泰盛混合
基金主代码	003697
交易代码	003697
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017 年 3 月 15 日
报告期末基金份额总额	113,081,213.68 份
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、固定收益品种投资策略、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、股票期权投资策略等。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×15%+上证国债指数收益率×85%。
风险收益特征	本基金为混合基金，其长期平均风险和预期收益率低于股票基金，高于债券基金、货币市场基金。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期
	(2022 年 4 月 1 日-2022 年 6 月 30 日)

1.本期已实现收益	3,726,743.49
2.本期利润	9,370,800.53
3.加权平均基金份额本期利润	0.0669
4.期末基金资产净值	143,167,985.45
5.期末基金份额净值	1.2661

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。

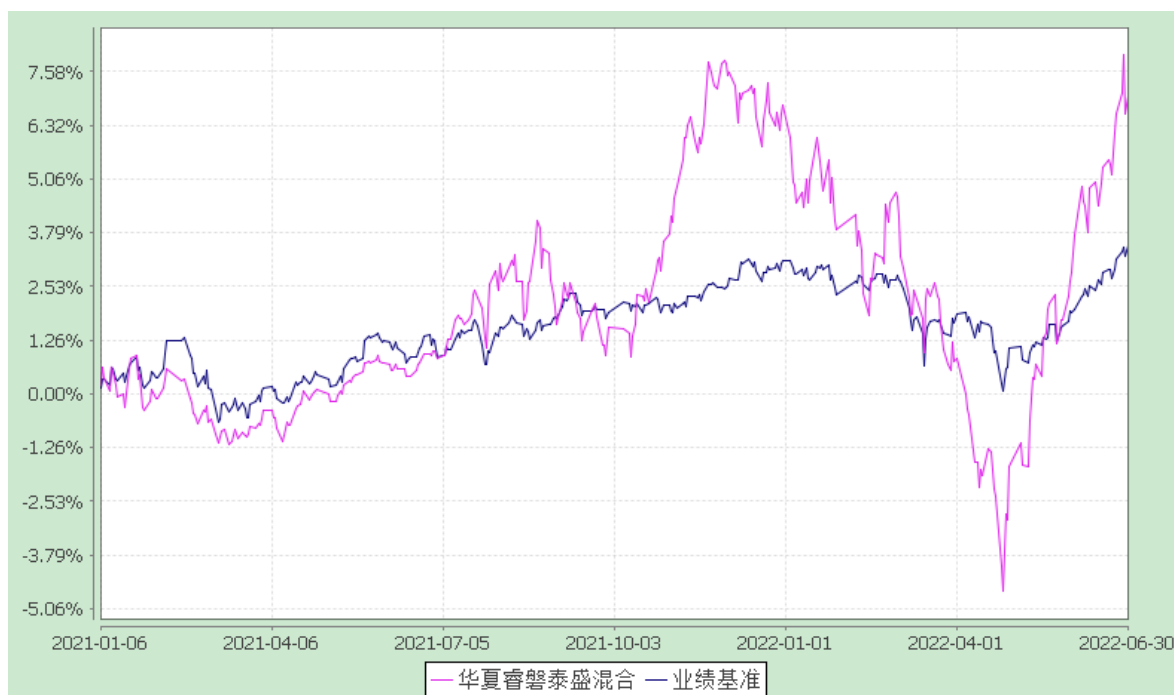
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	6.21%	0.66%	1.78%	0.23%	4.43%	0.43%
过去六个月	0.19%	0.62%	0.30%	0.22%	-0.11%	0.40%
过去一年	5.94%	0.52%	2.14%	0.19%	3.80%	0.33%
自基金转型起至今	7.01%	0.44%	3.47%	0.19%	3.54%	0.25%

3.2.2 自基金转型以来基金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

华夏睿磐泰盛混合型证券投资基金
 累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
 (2021 年 1 月 6 日至 2022 年 6 月 30 日)



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

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
董阳阳	本基金的基金经理、投委会成员	2021-02-22	-	14 年	硕士。曾任中国国际金融有限公司投行业务部 经理。2009 年 8 月加入华夏基金管理有限公司。历任研究员、基金经理助理、投资经理、华夏蓝筹核心混合型证券投资基金（LOF）基金经理（2013 年 3 月 11 日至 2017 年

					<p>2 月 24 日期间)、华夏磐晟定期开放灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) 基金经理 (2018 年 1 月 17 日至 2018 年 12 月 13 日期间)、华夏圆和灵活配置混合型证券投资基金基金经理 (2016 年 12 月 29 日至 2020 年 5 月 7 日期间)、华夏鼎沛债券型证券投资基金基金经理 (2018 年 6 月 26 日至 2020 年 5 月 7 日期间)、华夏产业升级混合型证券投资基金基金经理 (2018 年 8 月 24 日至 2020 年 6 月 18 日期间)、华夏成长证券投资基金基金经理 (2015 年 1 月 7 日至 2021 年 2 月 22 日期间) 等。</p>
毛颖	本基金的基金经理	2022-01-20	-	20 年	<p>硕士。曾任西南证券研究员等。2003 年 8 月加入原中信基金。历任研究员、基金经理助理、华夏基金固定收益部研究员，华</p>

					<p>夏磐泰混合型证券投资基金(LOF)基金经理(2018年7月17日至2019年1月14日期间)、华夏新锦略灵活配置混合型证券投资基金基金经理(2017年9月8日至2018年5月22日期间)、华夏磐泰定期开放混合型证券投资基金(LOF)基金经理(2017年1月18日至2018年7月16日期间)、华夏新锦图灵活配置混合型证券投资基金基金经理(2017年9月8日至2018年9月10日期间)、华夏新锦绣灵活配置混合型证券投资基金基金经理(2016年8月24日至2018年12月17日期间)、华夏新趋势灵活配置混合型证券投资基金基金经理(2017年9月8日至2018年12月17日期间)、华夏圆和灵活配置混合型证券</p>
--	--	--	--	--	--

					<p>投资基金基金经理（2017 年 9 月 8 日至 2018 年 12 月 17 日期间）、华夏鼎诺三个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理（2017 年 10 月 13 日至 2018 年 12 月 17 日期间）、华夏鼎瑞三个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理（2017 年 10 月 17 日至 2018 年 12 月 17 日期间）、华夏鼎祥三个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理（2017 年 10 月 18 日至 2018 年 12 月 17 日期间）、华夏稳定双利债券型证券投资基金基金经理（2013 年 5 月 13 日至 2019 年 1 月 14 日期间）、华夏恒融一年定期开放债券型证券投资基金基金经理（2017 年 9 月 8 日至 2019 年 5 月 7 日期间）、华夏恒融债券型证券投</p>
--	--	--	--	--	--

					资基金基金经 理（2017 年 9 月 8 日至 2019 年 5 月 7 日期 间）、华夏睿磐 泰荣混合型证 券投资基金基 金经理（2018 年 1 月 8 日至 2022 年 1 月 20 日期间）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 公平交易专项说明

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，本公司严格执行了《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 22 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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

今年 4 月份，市场依然笼罩在国内疫情、海外加息、俄乌冲突等带来的阴影中，而 4 月中开始，疫情区域的物流、复工复产状况开始出现边际改善，政府的一系列稳增长政策开始发力，推动 4 月末至 6 月市场显著反弹，特别是汽车、新能源、军工等成长板块。

基于上述对市场趋势的判断，本基金在 4 月中下旬的时候便将权益仓位打满，同时坚持既有投资策略，积极拥抱创新成长方向，取得了良好的效果。基金权益部分的整体持仓仍以半导体、智能电动车、能源（锂电/光伏/绿电/海风）、军工、计算机等核心成长赛道为主，其中 4~5 月加仓智能电动车、光伏、军工等赛道，6 月将部分短期涨幅较高的持仓获利了结，同时增量布局半导体材料、工控等赛道，主要是考虑到季度业绩兑现节奏、周期位置以及基本面边际变化等。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2022 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.2661 元，本报告期份额净值增长率为 6.21%，同期业绩比较基准增长率为 1.78%。

4.5 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	27,856,695.50	17.69
	其中：股票	27,856,695.50	17.69
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	90,426,990.77	57.43
	其中：债券	90,426,990.77	57.43
	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	22,071,000.00	14.02
	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	11,391,738.08	7.24
8	其他资产	5,698,253.45	3.62
9	合计	157,444,677.80	100.00

5.2 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	-	-
B	采矿业	1,332,303.44	0.93
C	制造业	26,438,170.44	18.47
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
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	26,704.38	0.02
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	19,959.78	0.01
M	科学研究和技术服务业	7,586.82	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	15,736.50	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	16,234.14	0.01
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	27,856,695.50	19.46

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净
----	------	------	-------	---------	--------

					值比例 (%)
1	002920	德赛西威	17,800	2,634,400.00	1.84
2	300604	长川科技	49,700	2,243,955.00	1.57
3	002472	双环传动	61,500	1,958,160.00	1.37
4	002436	兴森科技	162,400	1,830,248.00	1.28
5	300395	菲利华	39,500	1,777,500.00	1.24
6	002594	比亚迪	5,200	1,734,148.00	1.21
7	002979	雷赛智能	83,300	1,700,986.00	1.19
8	688106	金宏气体	81,924	1,601,614.20	1.12
9	688082	盛美上海	16,120	1,527,692.40	1.07
10	300655	晶瑞电材	75,444	1,456,069.20	1.02

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	23,998,952.58	16.76
2	央行票据	-	-
3	金融债券	12,333,222.74	8.61
	其中：政策性金融债	12,333,222.74	8.61
4	企业债券	37,658,619.24	26.30
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	8,219,299.02	5.74
7	可转债（可交换债）	8,216,897.19	5.74
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	90,426,990.77	63.16

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量 (张)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	019658	21 国债 10	130,000	13,247,641.10	9.25
2	210005	21 付息国债 05	100,000	10,751,311.48	7.51
3	185148	21 国新 06	100,000	10,318,243.84	7.21
4	160404	16 农发 04	90,000	9,209,778.90	6.43

5	127459	16 广晟 03	50,000	5,160,030.14	3.60
---	--------	----------	--------	--------------	------

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国农业发展银行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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	106,768.14
2	应收证券清算款	5,591,285.43
3	应收股利	-

4	应收利息	-
5	应收申购款	199.88
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,698,253.45

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	127016	鲁泰转债	951,798.05	0.66
2	127040	国泰转债	837,192.93	0.58
3	123083	朗新转债	780,374.96	0.55
4	132018	G 三峡 EB1	699,804.79	0.49
5	123107	温氏转债	698,216.25	0.49
6	128140	润建转债	557,063.13	0.39
7	127020	中金转债	556,539.24	0.39
8	123070	鹏辉转债	457,255.72	0.32
9	127043	川恒转债	339,189.20	0.24
10	118001	金博转债	317,684.81	0.22
11	123120	隆华转债	168,219.18	0.12

5.11.5 报告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。

5.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

本报告期期初基金份额总额	197,499,497.97
报告期期间基金总申购份额	291,233.26
减：报告期期间基金总赎回份额	84,709,517.55
报告期期间基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	113,081,213.68

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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	2022-04-01 至 2022-06-30	74,893,068.15	-	-	74,893,068.15	66.23%

产品特有风险

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。

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。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

1、报告期内披露的主要事项

2022 年 4 月 2 日发布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。

2022 年 4 月 8 日发布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。

2022 年 4 月 13 日发布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。

2022 年 4 月 16 日发布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。

2、其他相关信息

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，首批公募 MOM 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，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。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予基金注册的文件；
- 2、《华夏睿磐泰盛混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《华夏睿磐泰盛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。

9.2 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。

9.3 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

二〇二二年七月二十日