

**华夏智胜价值成长股票型发起式
证券投资基金
2022 年中期报告
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：招商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二二年八月三十日

§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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 8 月 26 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 2022 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	1
§2 基金简介.....	3
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	4
3.1 主要会计数据和财务指标.....	4
3.2 基金净值表现.....	5
§4 管理人报告.....	6
§5 托管人报告.....	11
§6 中期报告财务会计报告（未经审计）.....	11
6.1 资产负债表.....	11
6.2 利润表.....	13
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	14
6.4 报表附注.....	15
§7 投资组合报告.....	38
7.1 期末基金资产组合情况.....	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	38
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.....	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	54
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	55
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.....	56
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.....	56
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.....	56
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.....	56
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	56
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	56
7.12 投资组合报告附注.....	56
§8 基金份额持有人信息.....	57
§9 开放式基金份额变动.....	58
§10 重大事件揭示.....	58
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	62
§12 备查文件目录.....	62

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金	
基金简称	华夏智胜价值成长股票	
基金主代码	002871	
交易代码	002871	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 3 月 6 日	
基金管理人	华夏基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	180,919,427.66 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华夏智胜价值成长股票 A	华夏智胜价值成长股票 C
下属分级基金的交易代码	002871	002872
报告期末下属分级基金的份额总额	63,229,594.74 份	117,689,832.92 份

2.2 基金产品说明

投资目标	利用定量投资模型，灵活应用多种策略，把握市场机会，追求资产的长期增值。
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、股指期货投资策略、期权投资策略、国债期货投资策略等。在股票投资策略上，本基金采用混合多种投资策略，包含基本面选股策略、多因子策略，辅助其他投资策略如套利类策略、衍生品交易类策略等。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率*95%+银行活期存款利率(税后)*5%。
风险收益特征	本基金为股票基金，其预期风险和预期收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金还可通过港股通渠道投资于香港证券市场，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还将面临汇率风险、香港市场风险等特殊投资风险。

注：根据本公司于 2022 年 4 月 7 日发布的《华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效公告》，本基金自 2022 年 4 月 7 日起调整投资范围、相应调整投资策略和投资比例限制、修改业绩比较基准等，并相应修订基金合同等法律文件。

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	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李彬	张燕
	联系电话	400-818-6666	0755-83199084

电子邮箱	service@ChinaAMC.com	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话	400-818-6666	95555
传真	010-63136700	0755-83195201
注册地址	北京市顺义区安庆大街甲3号院	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
办公地址	北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座8层	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
邮政编码	100033	518040
法定代表人	杨明辉	缪建民

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（2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日）	
	华夏智胜价值成长股票 A	华夏智胜价值成长股票 C
本期已实现收益	-6,775,731.63	-13,798,351.88
本期利润	-2,350,787.98	-8,309,918.59
加权平均基金份额本期利润	-0.0370	-0.0658
本期加权平均净值利润率	-2.75%	-4.91%
本期基金份额净值增长率	-2.37%	-2.48%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)	
	华夏智胜价值成长股票 A	华夏智胜价值成长股票 C
期末可供分配利润	23,362,769.39	42,532,274.33
期末可供分配基金份额利润	0.3695	0.3614
期末基金资产净值	91,240,960.45	168,775,672.43
期末基金份额净值	1.4430	1.4341

3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)	
	华夏智胜价值成长股票 A	华夏智胜价值成长股票 C
基金份额累计净值增长率	49.46%	58.50%

注：①所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

②本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华夏智胜价值成长股票 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	9.34%	1.08%	6.74%	1.05%	2.60%	0.03%
过去三个月	7.16%	1.64%	3.11%	1.66%	4.05%	-0.02%
过去六个月	-2.37%	1.52%	-1.23%	1.53%	-1.14%	-0.01%
过去一年	0.96%	1.27%	2.73%	1.24%	-1.77%	0.03%
过去三年	64.00%	1.26%	26.29%	1.12%	37.71%	0.14%
自基金转型起至今	49.46%	1.28%	20.38%	1.19%	29.08%	0.09%

华夏智胜价值成长股票 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	9.33%	1.08%	6.74%	1.05%	2.59%	0.03%
过去三个月	7.09%	1.64%	3.11%	1.66%	3.98%	-0.02%
过去六个月	-2.48%	1.52%	-1.23%	1.53%	-1.25%	-0.01%
过去一年	0.70%	1.27%	2.73%	1.24%	-2.03%	0.03%
自 2019 年 12 月 24 日起至今	58.50%	1.32%	23.14%	1.17%	35.36%	0.15%

注：2018 年 3 月 6 日至 2018 年 12 月 25 日，2019 年 1 月 7 日至 2019 年 12 月 23 日期间，华夏智胜价值成长股票 C 类基金份额为零。

3.2.2 自基金转型以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金

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

(2018 年 3 月 6 日至 2022 年 6 月 30 日)

华夏智胜价值成长股票 A



华夏智胜价值成长股票 C



注：2018年3月6日至2018年12月25日，2019年1月7日至2019年12月23日期间，华夏智胜价值成长股票 C 类基金份额为零。

§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,形成了覆盖大盘蓝筹、宽基指数、中小创指数、主题指数、行业指数、Smart Beta 策略、海外市场指数、信用债指数、商品指数等较为完整的产品线。

华夏基金以深入的投资研究为基础,尽力捕捉市场机会,为投资人谋求良好的回报。根据银河证券基金研究中心《中国基金业绩评价报告》,截至 2022 年 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:在偏股型基金(股票上限 95%)(A 类)中华夏兴和混合排序第 1/188、华夏兴华混合(A 类)排序第 16/188;在养老目标日期 FOF(2040)(A 类)中华夏养老 2040 三年持有混合(FOF)排序第 2/14;在定开偏股型基金(A 类)中华夏磐利一年定开混合(A 类)排序第 2/77、华夏磐锐一年定开混合(A 类)排序第 10/77、华夏磐益一年定开混合排序第 11/77、华夏成长精选 6 个月定开混合(A 类)排序第 24/77;在医药医疗健康行业偏股型基金(股票上下限 60%-95%)(A 类)中华夏逸享健康混合(A 类)排序第 9/52;在消费行业偏股型基金(股票上下限 60%-95%)(A 类)中华夏网购精选混合(A 类)排序第 10/53;在偏股型基金(股票上限 80%)(A 类)中华夏经典混合排序第 22/134;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 29/905、华夏产业升级混合(A 类)排序第 55/905、华夏盛世混合排序第 67/905;在标准股票型基金(A 类)中华夏智胜价值成长股票(A 类)排序第 59/286;在灵活配置型基金(基准股票比例 60%-100%)(A 类)中华夏圆和混合(A 类)排序第 74/436。

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)排序第 1/25;在信用债指数债券型基金(A 类)中华夏亚债中国指数(A 类)排序第 3/13;在利率债指数债券型基金(A 类)中华夏中债 3-5 年政金债指数(A 类)排序第 7/98;在中短期纯债债券型基金(A 类)中华夏中短债债券(A 类)排序第 21/84;在长期纯债债券型基金(A 类)中华夏鼎航债券(A 类)排序第 28/642;在偏债型

基金(A类)中华夏磐泰混合(LOF)(A类)排序第 32/350、华夏睿磐泰盛混合排序第 36/350、华夏永康添福混合(A类)排序第 46/350、华夏睿磐泰利混合(A类)排序第 63/350。

指数与量化产品：在 QDII 跨境股票 ETF 基金中华夏纳斯达克 100ETF (QDII) 排序第 4/19；在规模指数股票 ETF 基金中华夏中证 1000ETF 排序第 3/116、华夏中证 500ETF 排序第 18/116；在主题指数股票 ETF 联接基金(A类)中华夏中证四川国改 ETF 联接(A类)排序第 3/60、华夏中证央企 ETF 联接(A类)排序第 15/60；在行业指数股票 ETF 联接基金(A类)中华夏中证全指房地产 ETF 联接(A类)排序第 4/24、华夏中证银行 ETF 联接(A类)排序第 6/24；在行业指数股票 ETF 基金中华夏中证全指房地产 ETF 排序第 7/41、华夏中证银行 ETF 排序第 10/41；在规模指数股票 ETF 联接基金(A类)中华夏中证 500ETF 联接(A类)排序第 15/80；在主题指数股票 ETF 基金中华夏中证新能源 ETF 排序第 14/169、华夏中证四川国改 ETF 排序第 17/169、华夏中证新能源汽车 ETF 排序第 24/169。

在证券时报主办的第十七届中国基金业明星基金奖评选活动上，在最具含金量、最能体现基金公司综合实力的“年度十大明星基金公司奖”评选中，华夏基金凭借在多项业务中的优异中长期表现，成功获奖。此外，凭借 QDII 基金的良好业绩表现，以及在境内外市场的持续布局，华夏基金还获得“三年海外投资明星基金公司奖”。

在客户服务方面，2022 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）华夏基金直销上线北京银行、广发银行快捷等支付方式，拓展支付渠道的同时交易额度也得到进一步提升，满足客户支付需求；（2）华夏基金管家客户端优化资料上传、定投收益展示等功能，增加客户操作便利性；（3）与兰州银行、九江银行、晋商银行、九州证券等代销机构合作，拓展更加丰富的客户理财渠道；（4）开展“压岁钱手账”、“基金视力表”、“与干饭人灵魂相认”、“童言童语话理财”、“FOF 产品不是小透明”等活动，为客户提供了多样化的投资者教育和关怀服务。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
孙蒙	本基金的基金经理	2020-03-17	-	8 年	硕士。曾任中信建投证券股份有限公司研究员、投资经理等。2017 年 7 月加入华夏基金管理有限公司。历任数量投资部研究员、基金经理助理。
孙然晔	本基金的基金经理助理	2020-08-10	-	8 年	博士。曾任美国银行企业投资部资深量化研究员，美国 AQR 资本管理公司量化研究员。

					2019 年 8 月加入华夏基金管理有限公司。历任数量投资部研究员、基金经理助理。
--	--	--	--	--	---

注：①上述“任职日期”和“离任日期”为根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。首任基金经理的，其“任职日期”为基金合同生效日。

②证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

③自 2022 年 7 月 4 日起，孙然晔先生不再担任本基金基金经理助理。

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 54 次，其中 3 次为投资策略需要所致，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；其余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，外部形势较为复杂，全球通胀和衰退风险给中国外需带来了一定的压力。美国与欧洲均面临高通胀的困扰，全球 PMI 进入下降周期，多个指标表明全球经济面临衰退风险。国内方面，上半年疫情对经济带来了一定程度的冲击，但近期负面影响正在逐步消退。在克服了国际环境复杂多变、国内疫情反复冲击等诸多不利因素后，5 月主要经济指标降幅收窄，6 月多项经济数据企稳回升，二季度经济实现正增长。6 月我国消费增速由负转正，同比增长 3.1%；服务业生产指数同比增

长 1.3%；总体来看，上半年国内生产总值同比增长 2.5%，其中二季度国内生产总值同比增长 0.4%。

市场方面，煤炭及稳增长相关行业表现较好，而科技成长行业表现较差。量化因子表现波动较大，市场下跌阶段大盘、价值表现较好，而市场反弹阶段小盘、成长表现较好。整体上估值、反转因子表现较好，而盈利、成长表现较差，量化策略表现处于历史平均水平。

基金投资运作方面，本基金以多因子量化投资策略为主，我们在依据量化模型进行股票投资决策之外，还积极参与了科创板、创业板新股申购，获取较为确定性的收益增厚机会。同时，本基金秉承尽职尽责的态度，认真应对投资者日常申购、赎回等工作。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2022 年 6 月 30 日，华夏智胜价值成长股票 A 基金份额净值为 1.4430 元，本报告期份额净值增长率为-2.37%；华夏智胜价值成长股票 C 基金份额净值为 1.4341 元，本报告期份额净值增长率为-2.48%，同期业绩比较基准增长率为-1.23%。

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，国际方面，全球通胀水平持续攀升，主要经济体偿债压力不断加大，稳定外需难度也在明显增加，外部环境更趋复杂严峻。随着美联储等海外主要央行货币紧缩进程的加快，当前国际金融市场的关注焦点正从通胀转向衰退。国内方面，下半年外部不稳定、不确定的因素仍较多，但随着一系列稳增长政策措施的落地见效，以及高效统筹疫情防控和经济社会发展成效的持续显现，下半年我国经济有望继续回升并运行在合理区间。展望下半年，预计市场呈现震荡上行走势，行业或者风格板块呈现轮动特征。

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

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

托管人声明：

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本年度中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，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：华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	16,101,296.57	60,105,136.93
结算备付金		1,953,692.33	4,603,101.31
存出保证金		595,302.89	1,552,442.13

交易性金融资产	6.4.7.2	242,497,221.73	303,447,568.07
其中：股票投资		242,489,521.68	303,374,908.47
基金投资		-	-
债券投资		7,700.05	72,659.60
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		381,376.70	90,881.58
应收股利		-	-
应收申购款		54.99	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	6,996.11
资产总计		261,528,945.21	369,806,126.13
负债和净资产	附注号	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		472,049.02	1,611.50
应付赎回款		34,849.76	37,881,377.77
应付管理人报酬		205,792.03	395,087.09
应付托管费		41,158.39	79,017.42
应付销售服务费		33,435.94	59,389.53
应付投资顾问费		-	-
应交税费		0.47	41,269.32
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	725,026.72	1,275,941.89
负债合计		1,512,312.33	39,733,694.52
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	180,919,427.66	224,124,467.98
未分配利润	6.4.7.8	79,097,205.22	105,947,963.63
净资产合计		260,016,632.88	330,072,431.61
负债和净资产总计		261,528,945.21	369,806,126.13

注：①报告截止日 2022 年 6 月 30 日，华夏智胜价值成长股票 A 基金份额净值 1.4430 元，华夏智胜价值成长股票 C 基金份额净值 1.4341 元；华夏智胜价值成长股票基金份额总额 180,919,427.66 份（其中 A 类 63,229,594.74 份，C 类 117,689,832.92 份）。

②以下比较数据已根据本年《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》中的资产负债表格式的要求进行列示：2021 年年度报告资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目的“本期末”余额合并列示在 2022 年中期报告资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额，2021 年年度报告资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在 2022 年中期报告资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额。

6.2 利润表

会计主体：华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-8,789,518.22	82,223,955.43
1.利息收入		50,061.63	86,215.65
其中：存款利息收入	6.4.7.9	50,061.63	85,787.16
债券利息收入		-	428.49
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-18,758,522.57	66,020,912.71
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-20,943,486.98	62,931,812.58
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	252,624.69	90,071.19
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	-782,710.07	505,993.52
股利收益	6.4.7.14	2,715,049.79	2,493,035.42
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	9,913,376.94	15,502,962.92
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	5,565.78	613,864.15
减：二、营业总支出		1,871,188.35	6,797,572.74
1.管理人报酬		1,264,567.61	1,879,353.08
2.托管费		252,913.50	375,870.66
3.销售服务费		210,364.94	50,590.03
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		-	-

其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.信用减值损失	6.4.7.17	-	-
7.税金及附加		0.98	1,518.69
8.其他费用	6.4.7.18	143,341.32	4,490,240.28
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-10,660,706.57	75,426,382.69
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-10,660,706.57	75,426,382.69
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-10,660,706.57	75,426,382.69

注：以下比较数据已根据本年《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》中的利润表格式的要求进行列示：2021 年中期报告利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在 2022 年中期报告利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 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）	224,124,467.98	-	105,947,963.63	330,072,431.61
二、本期期初净资产（基金净值）	224,124,467.98	-	105,947,963.63	330,072,431.61
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-43,205,040.32	-	-26,850,758.41	-70,055,798.73
（一）、综合收益总额	-	-	-10,660,706.57	-10,660,706.57
（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）	-43,205,040.32	-	-16,190,051.84	-59,395,092.16
其中：1.基金申购款	13,756,771.96	-	5,216,174.25	18,972,946.21
2.基金赎回款	-56,961,812.28	-	-21,406,226.09	-78,368,038.37

(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)	180,919,427.66	-	79,097,205.22	260,016,632.88
项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 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)	401,829,292.83	-	60,550,672.01	462,379,964.84
二、本期期初净资产(基金净值)	401,829,292.83	-	60,550,672.01	462,379,964.84
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	53,246,017.84	-	133,062,182.97	186,308,200.81
(一)、综合收益总额	-	-	75,426,382.69	75,426,382.69
(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)	53,246,017.84	-	57,635,800.28	110,881,818.12
其中：1.基金申购款	439,451,056.78	-	164,466,334.47	603,917,391.25
2.基金赎回款	-386,205,038.94	-	-106,830,534.19	-493,035,573.13
(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)	455,075,310.67	-	193,612,854.98	648,688,165.65

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

根据原华夏新锦源灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“华夏新锦源混合”）基金份额持有人大会审议通过的《关于华夏新锦源灵活配置混合型证券投资基金转型为华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金有关事项的议案》以及相关法律法规的规定，并向中国证券监督管理委员会备案，华夏新锦源混合于 2018 年 3 月 6 日转型为华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）。本基金为契约型开放式，存续期限为不定期。本基金的基金管理人为华夏基金管理有限公司，基金托管人为招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》和本基金基金合同的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括创业板、存托凭证及其他中国证监会注册或核准上市的股票）、港股通标的股票、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、公开发行的次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、衍生品（包括股指期货、国债期货、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。

本基金可根据相关法律法规和《基金合同》的约定，参与融资业务。

本基金投资组合比例为：股票投资占基金资产的比例为 80%–95%，港股通标的股票投资占股票资产的比例为 0-50%，每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货、期权合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布和修订的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及其他相关规定(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

除下述变更后的会计政策外，本基金报告期所采用的其他会计政策、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

根据《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》、《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（统称“新金融工具准则”）、《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》的规定和相关法律法规的要求，本基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。根据衔接规定，对可比期间信息不予调整，首日执行新金融工具准则的累积影响数调整本报告期初未分配利润。

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

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

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

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

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、应收利息和应收证券清算款，金额分别为 60,105,136.93 元、4,603,101.31 元、1,552,442.13 元、6,996.11 元和 90,881.58 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、其他资产-应收利息和应收清算款，金额分别为 60,109,256.01 元、4,605,810.91 元、1,552,603.06 元、0.00 元和 90,881.58 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 303,447,568.07 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 303,447,574.57 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付证券清算款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 1,611.50 元、37,881,377.77 元、395,087.09 元、79,017.42 元、59,389.53 元、947,491.45 元和 328,450.44 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付清算款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、其他负债-应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 1,611.50 元、37,881,377.77 元、395,087.09 元、79,017.42 元、59,389.53 元、947,491.45 元和 328,450.44 元。

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 2022 年 6 月 30 日
活期存款	16,101,296.57
等于：本金	16,099,746.79
加：应计利息	1,549.78

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	16,101,296.57

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	230,738,732.02	-	242,489,521.68	11,750,789.66
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	0.05	7,700.05	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	0.05	7,700.05	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	230,746,432.02	0.05	242,497,221.73	11,750,789.66

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 2022 年 6 月 30 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	3,292,680.00	-	-	-
其中：股指期货	3,292,680.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	3,292,680.00	-	-	-

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
IC2212	中证 500 期货 IC2212 合约	3.00	3,756,120.00	463,440.00
合计	-	-	-	463,440.00
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	463,440.00
净额	-	-	-	-

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

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 其他资产

无。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	56.70
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	625,791.07
其中：交易所市场	625,791.07
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	99,178.95
合计	725,026.72

6.4.7.7 实收基金

华夏智胜价值成长股票 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	63,878,697.48	63,878,697.48
本期申购	1,030,329.55	1,030,329.55
本期赎回（以“-”号填列）	-1,679,432.29	-1,679,432.29
本期末	63,229,594.74	63,229,594.74

华夏智胜价值成长股票 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	160,245,770.50	160,245,770.50
本期申购	12,726,442.41	12,726,442.41
本期赎回（以“-”号填列）	-55,282,379.99	-55,282,379.99
本期末	117,689,832.92	117,689,832.92

6.4.7.8 未分配利润

华夏智胜价值成长股票 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
本期期初	30,392,507.93	138,324.02	30,530,831.95
本期利润	-6,775,731.63	4,424,943.65	-2,350,787.98
本期基金份额交易产生的变动数	-254,006.91	85,328.65	-168,678.26
其中：基金申购款	428,870.03	-40,206.20	388,663.83
基金赎回款	-682,876.94	125,534.85	-557,342.09
本期已分配利润	-	-	-
本期末	23,362,769.39	4,648,596.32	28,011,365.71

华夏智胜价值成长股票 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	75,124,046.64	293,085.04	75,417,131.68
本期利润	-13,798,351.88	5,488,433.29	-8,309,918.59
本期基金份额交易产生的变动数	-18,793,420.43	2,772,046.85	-16,021,373.58
其中：基金申购款	5,174,774.14	-347,263.72	4,827,510.42
基金赎回款	-23,968,194.57	3,119,310.57	-20,848,884.00
本期已分配利润	-	-	-
本期末	42,532,274.33	8,553,565.18	51,085,839.51

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	30,201.31
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	18,199.73
其他	1,660.59
合计	50,061.63

6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	984,886,219.58
减：卖出股票成本总额	1,003,836,389.08
减：交易费用	1,993,317.48
买卖股票差价收入	-20,943,486.98

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 2022年1月1日至2022年6月30日
债券投资收益——利息收入	268.03
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	252,356.66
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	252,624.69

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 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,590,651.48
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,338,000.00
减：应计利息总额	282.70

减：交易费用	12.12
买卖债券差价收入	252,356.66

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 2022年1月1日至2022年6月30日
股指期货投资收益	-782,710.07

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资产生的股利收益	2,715,049.79
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	2,715,049.79

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
1.交易性金融资产	9,687,236.94
——股票投资	9,707,896.54
——债券投资	-20,659.60
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	226,140.00
——权证投资	-
——期货投资	226,140.00
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	9,913,376.94

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
基金赎回费收入	5,565.78
基金申购费收入	-
合计	5,565.78

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 2022年1月1日至2022年6月30日
审计费用	39,671.58
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	4,162.37
其他	40,000.00
合计	143,341.32

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
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	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
上海华夏财富投资管理有限公司（“华夏财富”）	基金管理人的子公司
中信证券华南股份有限公司（“中信证券（华南）”）	基金管理人股东控股的公司
中信证券（山东）有限责任公司（“中信证券（山东）”）	基金管理人股东控股的公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021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	430,515,365.09	22.53%	2,613,924,416.03	57.77%

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 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021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	1,150,334.08	72.32%	1,552,654.30	64.83%

6.4.10.1.4 债券回购交易

无。

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 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	185,692.11	22.53%	168,262.94	26.89%
关联方名称	上年度可比期间 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	1,127,373.53	64.24%	1,073,218.59	74.22%

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 2022年1月1日至2022年6月 30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,264,567.61	1,879,353.08
其中：支付销售机构的客户维护费	28,927.07	2,118.47

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

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

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月 30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30 日
当期发生的基金应支付的托管费	252,913.50	375,870.66

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 2022年1月1日至2022年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华夏智胜价值成长股 票 A	华夏智胜价值成长股票 C	合计
华夏基金管 理有限公司	-	185,727.32	185,727.32
中信证券	-	835.69	835.69
华夏财富	-	152.55	152.55
中信证券 (山东)	-	3.43	3.43

中信证券 (华南)	-	1.81	1.81
合计	-	186,720.80	186,720.80
获得销售服 务费的各关 联方名称	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日 当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华夏智胜价值成长股 票 A	华夏智胜价值成长股票 C	合计
华夏基金管 理有限公司	-	49,431.21	49,431.21
华夏财富	-	144.30	144.30
中信证券 (华南)	-	13.60	13.60
中信证券	-	6.73	6.73
合计	-	49,595.84	49,595.84

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 0.25% 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 × 0.25% / 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

份额单位：份

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日	
	华夏智胜价值成长 股票A	华夏智胜价值成长 股票C	华夏智胜价值成长 股票A	华夏智胜价值成长 股票C

期初持有的基金份额	10,608,423.83	-	10,608,423.83	-
期间申购/买入总份额	-	-	-	-
期间因拆分变动份额	-	-	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-	-	-
期末持有的基金份额	10,608,423.83	-	10,608,423.83	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	16.78%	-	8.86%	-

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 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021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
招商银行活期存款	16,101,296.57	30,201.31	225,930,565.17	51,981.46

注：本基金的活期银行存款由基金托管人招商银行保管，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 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	688302	海创药业	新股发行	5,959	255,760.28
中信证券	688223	晶科能源	新股发行	41,748	208,740.00
中信证券	301200	大族数控	新股发行	1,713	131,147.28
中信证券	688326	经纬恒润	新股发行	986	119,306.00
中信证券	301302	华如科技	新股发行	2,272	118,212.16
中信证券	301109	军信股份	新股发行	3,185	110,869.85
中信证券	688290	景业智能	新股发行	3,040	103,025.60
中信证券	688150	莱特光电	新股发行	3,979	87,736.95
中信证券	600938	中国海油	新股发行	4,000	43,200.00
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
上年度可比期间 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	600905	三峡能源	网下申购	1,296,803	3,436,527.95
中信证券	688819	天能股份	网下申购	7,521	314,302.59
中信证券	688617	惠泰医疗	网下申购	1,673	124,571.58
中信证券	688276	百克生物	网下申购	1,609	58,487.15
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	688690	纳微科技	网下申购	3,477	28,059.39
中信证券	603529	爱玛科技	网下申购	849	23,653.14
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

注：本期“网上申购”和“网下申购”两种发行方式合并披露为“新股发行”。

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

无。

6.4.12 期末（2022 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600941	中国移动	2021-12-24	6个月	新发流通受限	57.58	60.26	87,363	5,030,361.54	5,264,494.38	-
688297	中无人机	2022-06-17	6个月	新发流通受限	32.35	45.88	5,437	175,886.95	249,449.56	-
688302	海创药业	2022-04-01	6个月	新发流通受限	42.92	38.35	5,959	255,760.28	228,527.65	-
688045	必易微	2022-05-19	6个月	新发流通受限	55.15	61.98	2,600	143,390.00	161,148.00	-
301139	元道通信	2022-06-30	1个月内(含)	新发流通受限	38.46	38.46	2,695	103,649.70	103,649.70	-
688282	理工导航	2022-03-10	6个月	新发流通受限	65.21	45.37	1,323	86,272.83	60,024.51	-
301122	采纳股份	2022-01-19	6个月	新发流通受限	50.31	70.37	232	11,671.92	16,325.84	-
301286	侨源股份	2022-06-06	6个月	新发流通受限	16.91	19.79	681	11,515.71	13,476.99	-
301298	东利机械	2022-05-27	6个月	新发流通受限	12.68	20.83	634	8,039.12	13,206.22	-
301302	华如科技	2022-06-16	6个月	新发流通受限	52.03	56.42	228	11,862.84	12,863.76	-
301212	联盛化学	2022-04-07	6个月	新发流通受限	29.67	33.28	379	11,244.93	12,613.12	-
301259	艾布鲁	2022-04-18	6个月	新发流通受限	18.39	24.94	483	8,882.37	12,046.02	-
301139	元道通信	2022-06-30	6个月	新发流通	38.46	38.46	300	11,538.00	11,538.00	-

				受限						
3012 20	亚香 股份	2022-0 6-15	6 个月	新发 流通 受限	35.98	39.15	285	10,254 .30	11,157.75	-
3010 97	天益 医疗	2022-0 3-25	6 个月	新发 流通 受限	52.37	47.83	209	10,945 .33	9,996.47	-
3012 48	杰创 智能	2022-0 4-13	6 个月	新发 流通 受限	39.07	29.87	319	12,463 .33	9,528.53	-
3012 06	三元 生物	2022-0 1-26	6 个月	新发 流通 受限	109.30	45.69	203	14,755 .50	9,275.07	含 证 券 送 配
3012 36	软通 动力	2022-0 3-08	6 个月	新发 流通 受限	72.88	31.38	291	14,138 .72	9,131.58	含 证 券 送 配
3011 03	何氏 眼科	2022-0 3-14	6 个月	新发 流通 受限	42.50	32.02	281	9,180. 00	8,997.62	含 证 券 送 配
3011 25	腾亚 精工	2022-0 5-27	6 个月	新发 流通 受限	22.49	27.42	327	7,354. 23	8,966.34	-
3011 63	宏德 股份	2022-0 4-11	6 个月	新发 流通 受限	26.27	32.33	277	7,276. 79	8,955.41	-
3011 30	西点 药业	2022-0 2-16	6 个月	新发 流通 受限	22.55	37.70	237	5,344. 35	8,934.90	-
3012 00	大族 数控	2022-0 2-18	6 个月	新发 流通 受限	76.56	51.92	172	13,168 .32	8,930.24	-
3011 50	中一 科技	2022-0 4-14	6 个月	新发 流通 受限	163.56	82.76	104	11,285 .64	8,607.04	含 证 券 送 配
3011 02	兆讯 传媒	2022-0 3-15	6 个月	新发 流通	39.88	31.09	266	10,608 .08	8,269.94	-

				受限						
301135	瑞德智能	2022-04-01	6 个月	新发流通受限	31.98	26.26	308	9,849.84	8,088.08	-
301123	奕东电子	2022-01-14	6 个月	新发流通受限	37.23	25.39	306	11,392.38	7,769.34	-
301109	军信股份	2022-04-06	6 个月	新发流通受限	34.81	16.14	479	11,104.39	7,731.06	含证券送配
301237	和顺科技	2022-03-16	6 个月	新发流通受限	56.69	41.86	183	10,374.27	7,660.38	-
301228	实朴检测	2022-01-21	6 个月	新发流通受限	20.08	20.34	373	7,489.84	7,586.82	-
301196	唯科科技	2022-01-04	6 个月	新发流通受限	64.08	37.52	192	12,303.36	7,203.84	-
301148	嘉戎技术	2022-04-14	6 个月	新发流通受限	38.39	23.90	297	11,401.83	7,098.30	-
301181	标榜股份	2022-02-11	6 个月	新发流通受限	40.25	30.59	231	9,297.75	7,066.29	-
301279	金道科技	2022-04-06	6 个月	新发流通受限	31.20	22.81	296	9,235.20	6,751.76	-
301219	腾远钴业	2022-03-10	6 个月	新发流通受限	173.98	87.82	72	6,959.20	6,323.04	含证券送配
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
123150	九强转债	2022-06-30	1 个月内(含)	新发流通受限	100.00	100.00	77	7,700.00	7,700.05	期末估值单

										价为含息价格
--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--------

注：①本基金通过大宗交易方式受让的原上市公司大股东减持或者特定股东减持的股份，在受让后 6 个月内，不得转让所受让的股份。本基金所认购非公开发行股份，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。

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

③根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限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。

6.4.12.2 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内。

6.4.13.2 信用风险

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

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

6.4.13.3 流动性风险

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

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

模和期限的匹配。

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日		上年度末 2021 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	242,489,521.68	93.26	303,374,908.47	91.91
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	7,700.05	0.00	72,659.60	0.02
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	242,497,221. 73	93.26	303,447,568.0 7	91.93

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 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
	-5%	-11,964,865.01	-13,376,668.09
	+5%	11,964,865.01	13,376,668.09

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 2022 年 6 月 30 日
第一层次	236,153,828.18
第二层次	115,187.70
第三层次	6,228,205.85
合计	242,497,221.73

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。本基金政策以报告期初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 2022 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	242,489,521.68	92.72
	其中：股票	242,489,521.68	92.72
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	7,700.05	0.00
	其中：债券	7,700.05	0.00
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	18,054,988.90	6.90
8	其他各项资产	976,734.58	0.37
9	合计	261,528,945.21	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	1,879,631.00	0.72
B	采矿业	7,352,515.28	2.83
C	制造业	144,903,433.95	55.73
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,774,930.20	1.84
E	建筑业	5,801,966.15	2.23

F	批发和零售业	3,677,665.00	1.41
G	交通运输、仓储和邮政业	6,423,912.64	2.47
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	26,274,714.46	10.11
J	金融业	18,614,997.20	7.16
K	房地产业	6,404,143.00	2.46
L	租赁和商务服务业	7,228,786.75	2.78
M	科学研究和技术服务业	617,430.46	0.24
N	水利、环境和公共设施管理业	4,841,570.15	1.86
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	92,967.62	0.04
R	文化、体育和娱乐业	3,094,384.82	1.19
S	综合	506,473.00	0.19
	合计	242,489,521.68	93.26

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	600941	中国移动	87,363	5,264,494.38	2.02
2	600718	东软集团	328,300	3,778,733.00	1.45
3	600325	华发股份	479,900	3,632,843.00	1.40
4	002128	电投能源	232,700	3,332,264.00	1.28
5	688516	奥特维	11,588	3,093,416.60	1.19
6	300017	网宿科技	528,600	2,833,296.00	1.09
7	300748	金力永磁	74,000	2,723,200.00	1.05
8	002756	永兴材料	17,400	2,648,454.00	1.02
9	002344	海宁皮城	537,400	2,509,658.00	0.97
10	600846	同济科技	316,400	2,499,560.00	0.96
11	300769	德方纳米	6,020	2,460,253.60	0.95
12	603236	移远通信	18,330	2,449,987.80	0.94
13	002913	奥士康	75,900	2,402,235.00	0.92
14	300696	爱乐达	50,740	2,230,023.00	0.86
15	601881	中国银河	229,300	2,217,331.00	0.85
16	000415	渤海租赁	922,500	2,001,825.00	0.77
17	002034	旺能环境	95,779	1,966,342.87	0.76
18	688016	心脉医疗	10,077	1,963,100.37	0.75
19	688099	晶晨股份	19,065	1,925,565.00	0.74
20	603896	寿仙谷	48,040	1,862,991.20	0.72
21	002276	万马股份	237,700	1,858,814.00	0.71
22	000598	兴蓉环境	349,900	1,787,989.00	0.69
23	688396	华润微	29,800	1,760,286.00	0.68

24	601886	江河集团	205,991	1,740,623.95	0.67
25	002294	信立泰	61,200	1,719,720.00	0.66
26	002850	科达利	10,800	1,717,200.00	0.66
27	600519	贵州茅台	800	1,636,000.00	0.63
28	000567	海德股份	106,355	1,574,054.00	0.61
29	002080	中材科技	55,800	1,534,500.00	0.59
30	688389	普门科技	87,483	1,530,077.67	0.59
31	603613	国联股份	16,868	1,494,504.80	0.57
32	002041	登海种业	67,500	1,423,575.00	0.55
33	000627	天茂集团	415,200	1,415,832.00	0.54
34	600028	中国石化	343,500	1,401,480.00	0.54
35	688065	凯赛生物	12,503	1,397,835.40	0.54
36	600282	南钢股份	443,100	1,395,765.00	0.54
37	600018	上港集团	232,300	1,354,309.00	0.52
38	002966	苏州银行	211,900	1,292,590.00	0.50
39	601009	南京银行	119,760	1,247,899.20	0.48
40	002832	比音勒芬	49,500	1,247,400.00	0.48
41	002906	华阳集团	27,500	1,246,025.00	0.48
42	300855	图南股份	28,750	1,201,462.50	0.46
43	600845	宝信软件	21,900	1,195,740.00	0.46
44	601628	中国人寿	37,600	1,168,608.00	0.45
45	688536	思瑞浦	2,057	1,155,190.63	0.44
46	601319	中国人保	224,200	1,134,452.00	0.44
47	600926	杭州银行	74,600	1,117,508.00	0.43
48	002293	罗莱生活	84,500	1,112,865.00	0.43
49	000733	振华科技	8,100	1,101,357.00	0.42
50	000885	城发环境	117,900	1,096,470.00	0.42
51	000631	顺发恒业	289,100	1,087,016.00	0.42
52	600694	大商股份	60,400	1,081,160.00	0.42
53	600378	昊华科技	27,500	1,059,300.00	0.41
54	688018	乐鑫科技	9,376	1,053,862.40	0.41
55	002545	东方铁塔	91,800	1,044,684.00	0.40
56	603868	飞科电器	13,700	1,037,775.00	0.40
57	600452	涪陵电力	88,920	1,032,361.20	0.40
58	603599	广信股份	36,640	1,031,416.00	0.40
59	300357	我武生物	19,600	1,019,788.00	0.39
60	300389	艾比森	97,300	1,010,947.00	0.39
61	688100	威胜信息	48,059	1,008,758.41	0.39
62	000915	华特达因	24,000	992,400.00	0.38
63	688358	祥生医疗	27,400	980,646.00	0.38
64	688585	上纬新材	101,253	978,103.98	0.38
65	600438	通威股份	16,100	963,746.00	0.37
66	600486	扬农化工	7,200	959,616.00	0.37

67	300770	新媒股份	25,200	953,316.00	0.37
68	688981	中芯国际	20,800	939,536.00	0.36
69	603950	长源东谷	65,400	931,950.00	0.36
70	601838	成都银行	55,900	926,822.00	0.36
71	300316	晶盛机电	13,700	925,983.00	0.36
72	688183	生益电子	84,700	925,771.00	0.36
73	688050	爱博医疗	4,085	915,857.00	0.35
74	002841	视源股份	12,100	911,372.00	0.35
75	002203	海亮股份	78,800	910,140.00	0.35
76	300673	佩蒂股份	52,250	902,880.00	0.35
77	601928	凤凰传媒	126,000	900,900.00	0.35
78	600959	江苏有线	272,900	889,654.00	0.34
79	603605	珀莱雅	5,340	882,061.20	0.34
80	603799	华友钴业	9,170	876,835.40	0.34
81	300805	电声股份	109,800	872,910.00	0.34
82	000729	燕京啤酒	89,300	862,638.00	0.33
83	600054	黄山旅游	70,000	859,600.00	0.33
84	002615	哈尔斯	136,300	847,786.00	0.33
85	600639	浦东金桥	61,300	833,067.00	0.32
86	603669	灵康药业	127,000	830,580.00	0.32
87	002318	久立特材	51,760	827,642.40	0.32
88	003033	征和工业	30,600	820,080.00	0.32
89	300363	博腾股份	10,500	818,895.00	0.31
90	603489	八方股份	4,200	816,858.00	0.31
91	300487	蓝晓科技	13,350	814,350.00	0.31
92	002851	麦格米特	30,700	806,182.00	0.31
93	603380	易德龙	20,700	805,230.00	0.31
94	002594	比亚迪	2,400	800,376.00	0.31
95	600563	法拉电子	3,900	800,124.00	0.31
96	300045	华力创通	104,200	799,214.00	0.31
97	688625	呈和科技	18,200	794,248.00	0.31
98	600546	山煤国际	40,800	793,968.00	0.31
99	600085	同仁堂	14,900	787,912.00	0.30
100	600851	海欣股份	112,300	783,854.00	0.30
101	000785	居然之家	175,200	779,640.00	0.30
102	300861	美畅股份	8,400	778,596.00	0.30
103	603013	亚普股份	55,700	778,129.00	0.30
104	688586	江航装备	29,188	776,692.68	0.30
105	300979	华利集团	10,600	774,648.00	0.30
106	002014	永新股份	114,800	768,012.00	0.30
107	002460	赣锋锂业	5,100	758,370.00	0.29
108	603568	伟明环保	22,600	754,162.00	0.29
109	300514	友讯达	72,200	753,046.00	0.29

110	002179	中航光电	11,820	748,442.40	0.29
111	300750	宁德时代	1,400	747,600.00	0.29
112	603879	永悦科技	108,800	744,192.00	0.29
113	600908	无锡银行	130,800	736,404.00	0.28
114	300378	鼎捷软件	44,500	732,915.00	0.28
115	688388	嘉元科技	8,587	728,778.69	0.28
116	601857	中国石油	135,800	719,740.00	0.28
117	600575	淮河能源	226,300	706,056.00	0.27
118	001216	华瓷股份	54,900	705,465.00	0.27
119	002214	大立科技	55,100	700,872.00	0.27
120	601801	皖新传媒	142,800	689,724.00	0.27
121	601518	吉林高速	258,000	688,860.00	0.26
122	300196	长海股份	35,620	672,861.80	0.26
123	002332	仙琚制药	66,700	654,994.00	0.25
124	600704	物产中大	127,500	654,075.00	0.25
125	002129	TCL 中环	10,800	636,012.00	0.24
126	600784	鲁银投资	84,800	614,800.00	0.24
127	605118	力鼎光电	43,100	613,744.00	0.24
128	002091	江苏国泰	56,400	606,300.00	0.23
129	000709	河钢股份	261,200	590,312.00	0.23
130	002582	好想你	78,600	588,714.00	0.23
131	600273	嘉化能源	54,100	587,526.00	0.23
132	000531	穗恒运 A	79,360	584,089.60	0.22
133	000597	东北制药	105,000	577,500.00	0.22
134	603093	南华期货	54,500	577,155.00	0.22
135	601939	建设银行	94,100	570,246.00	0.22
136	688085	三友医疗	26,001	562,921.65	0.22
137	603979	金诚信	28,900	558,059.00	0.21
138	603995	甬金股份	16,535	556,568.10	0.21
139	600285	羚锐制药	44,100	552,573.00	0.21
140	301076	新瀚新材	20,070	547,911.00	0.21
141	600475	华光环能	67,730	546,581.10	0.21
142	688819	天能股份	15,600	539,448.00	0.21
143	688519	南亚新材	19,000	538,270.00	0.21
144	603551	奥普家居	57,700	534,879.00	0.21
145	300568	星源材质	18,400	534,336.00	0.21
146	603822	嘉澳环保	11,400	533,406.00	0.21
147	601012	隆基绿能	8,000	533,040.00	0.21
148	601869	长飞光纤	17,100	528,732.00	0.20
149	600873	梅花生物	46,200	521,136.00	0.20
150	688017	绿的谐波	4,375	520,625.00	0.20
151	300211	亿通科技	59,900	515,739.00	0.20
152	600094	大名城	139,800	513,066.00	0.20

153	000156	华数传媒	63,600	506,892.00	0.19
154	603676	卫信康	50,000	504,000.00	0.19
155	000878	云南铜业	43,400	494,326.00	0.19
156	300833	浩洋股份	5,639	491,495.24	0.19
157	605318	法狮龙	33,600	488,880.00	0.19
158	601898	中煤能源	46,900	486,822.00	0.19
159	600073	上海梅林	60,900	485,373.00	0.19
160	300369	绿盟科技	46,000	483,920.00	0.19
161	001965	招商公路	62,800	479,164.00	0.18
162	688093	世华科技	24,760	478,363.20	0.18
163	002597	金禾实业	10,900	472,297.00	0.18
164	601019	山东出版	72,600	471,174.00	0.18
165	300573	兴齐眼药	3,000	459,960.00	0.18
166	600673	东阳光	50,900	457,591.00	0.18
167	600456	宝钛股份	7,700	457,380.00	0.18
168	003043	华亚智能	7,600	452,504.00	0.17
169	603713	密尔克卫	3,300	451,110.00	0.17
170	603956	威派格	41,500	450,275.00	0.17
171	300761	立华股份	11,300	449,175.00	0.17
172	600796	钱江生化	82,700	448,234.00	0.17
173	300025	华星创业	88,700	439,065.00	0.17
174	600089	特变电工	16,000	438,240.00	0.17
175	300477	合纵科技	56,300	433,510.00	0.17
176	002815	崇达技术	33,728	432,055.68	0.17
177	603067	振华股份	34,300	429,779.00	0.17
178	605123	派克新材	3,000	422,160.00	0.16
179	688037	芯源微	2,900	420,413.00	0.16
180	300009	安科生物	41,300	417,543.00	0.16
181	601398	工商银行	87,000	414,990.00	0.16
182	688355	明志科技	19,300	413,213.00	0.16
183	600380	健康元	33,400	412,490.00	0.16
184	301082	久盛电气	22,200	411,810.00	0.16
185	600167	联美控股	54,900	411,201.00	0.16
186	300218	安利股份	28,800	410,976.00	0.16
187	600039	四川路桥	38,600	406,458.00	0.16
188	603112	华翔股份	27,200	405,552.00	0.16
189	300215	电科院	58,400	401,208.00	0.15
190	601288	农业银行	131,500	397,130.00	0.15
191	000409	云鼎科技	72,200	392,046.00	0.15
192	300666	江丰电子	6,300	384,300.00	0.15
193	600765	中航重机	11,800	379,724.00	0.15
194	300689	澄天伟业	21,900	379,089.00	0.15
195	603499	翔港科技	48,200	377,888.00	0.15

196	002961	瑞达期货	20,900	377,036.00	0.15
197	002818	富森美	29,600	372,664.00	0.14
198	300798	锦鸡股份	50,500	371,175.00	0.14
199	601668	中国建筑	67,700	360,164.00	0.14
200	605088	冠盛股份	26,600	358,568.00	0.14
201	000534	万泽股份	26,300	355,313.00	0.14
202	300773	拉卡拉	18,300	348,798.00	0.13
203	002733	雄韬股份	20,000	348,200.00	0.13
204	002736	国信证券	36,100	345,477.00	0.13
205	003036	泰坦股份	31,700	339,507.00	0.13
206	300620	光库科技	10,200	338,538.00	0.13
207	002375	亚厦股份	66,200	331,662.00	0.13
208	002275	桂林三金	25,300	329,659.00	0.13
209	300107	建新股份	62,000	329,220.00	0.13
210	600970	中材国际	33,900	328,491.00	0.13
211	002149	西部材料	24,100	327,760.00	0.13
212	300957	贝泰妮	1,500	326,295.00	0.13
213	601717	郑煤机	22,600	325,666.00	0.13
214	603208	江山欧派	4,500	325,035.00	0.13
215	300101	振芯科技	15,700	324,048.00	0.12
216	601615	明阳智能	9,500	321,100.00	0.12
217	002088	鲁阳节能	15,200	319,960.00	0.12
218	600480	凌云股份	35,800	318,262.00	0.12
219	605166	聚合顺	24,800	316,448.00	0.12
220	688633	星球石墨	6,756	314,289.12	0.12
221	300286	安科瑞	11,500	312,225.00	0.12
222	600188	兖矿能源	7,900	311,892.00	0.12
223	600551	时代出版	27,400	309,894.00	0.12
224	002368	太极股份	16,100	309,281.00	0.12
225	300037	新宙邦	5,840	306,950.40	0.12
226	600537	亿晶光电	62,078	306,044.54	0.12
227	301042	安联锐视	9,100	304,122.00	0.12
228	002459	晶澳科技	3,840	302,976.00	0.12
229	603682	锦和商管	52,800	302,544.00	0.12
230	601825	沪农商行	47,900	300,333.00	0.12
231	603949	雪龙集团	10,900	298,878.00	0.11
232	600885	宏发股份	7,140	298,809.00	0.11
233	300424	航新科技	26,300	296,664.00	0.11
234	600810	神马股份	32,900	296,100.00	0.11
235	688468	科美诊断	23,900	294,687.00	0.11
236	002090	金智科技	32,500	289,900.00	0.11
237	600549	厦门钨业	13,100	283,222.00	0.11
238	300522	世名科技	23,000	276,920.00	0.11

239	000672	上峰水泥	17,500	276,150.00	0.11
240	002857	三晖电气	17,300	275,416.00	0.11
241	300409	道氏技术	10,600	275,388.00	0.11
242	000596	古井贡酒	1,100	274,626.00	0.11
243	601689	拓普集团	4,000	273,720.00	0.11
244	688588	凌志软件	23,700	272,787.00	0.10
245	601326	秦港股份	95,600	270,548.00	0.10
246	603290	斯达半导	700	270,130.00	0.10
247	603045	福达合金	17,000	267,070.00	0.10
248	688656	浩欧博	6,800	266,084.00	0.10
249	300523	辰安科技	9,500	264,955.00	0.10
250	688200	华峰测控	736	262,310.40	0.10
251	002003	伟星股份	27,600	262,200.00	0.10
252	300694	蠡湖股份	24,000	260,880.00	0.10
253	601816	京沪高铁	51,900	260,538.00	0.10
254	002258	利尔化学	10,960	258,875.20	0.10
255	002867	周大生	16,600	257,798.00	0.10
256	600120	浙江东方	64,100	257,041.00	0.10
257	000988	华工科技	10,900	252,553.00	0.10
258	300628	亿联网络	3,300	251,295.00	0.10
259	300724	捷佳伟创	2,800	250,180.00	0.10
260	688297	中无人机	5,437	249,449.56	0.10
261	600685	中船防务	15,100	248,999.00	0.10
262	002286	保龄宝	21,600	247,320.00	0.10
263	603786	科博达	4,000	246,280.00	0.09
264	300219	鸿利智汇	27,900	242,730.00	0.09
265	688526	科前生物	9,300	241,707.00	0.09
266	600681	百川能源	54,400	240,992.00	0.09
267	600660	福耀玻璃	5,700	238,317.00	0.09
268	000016	深康佳 A	38,934	235,550.70	0.09
269	601166	兴业银行	11,800	234,820.00	0.09
270	301179	泽宇智能	5,700	232,617.00	0.09
271	002948	青岛银行	64,200	232,404.00	0.09
272	603722	阿科力	4,600	231,978.00	0.09
273	688302	海创药业	5,959	228,527.65	0.09
274	601992	金隅集团	79,400	219,938.00	0.08
275	300123	亚光科技	35,400	219,480.00	0.08
276	603659	璞泰来	2,600	219,440.00	0.08
277	601677	明泰铝业	9,220	219,436.00	0.08
278	603585	苏利股份	11,200	217,616.00	0.08
279	603787	新日股份	14,500	215,180.00	0.08
280	000035	中国天楹	40,900	214,725.00	0.08
281	000987	越秀金控	30,410	213,782.30	0.08

282	601988	中国银行	65,400	213,204.00	0.08
283	300138	晨光生物	13,600	211,752.00	0.08
284	002920	德赛西威	1,400	207,200.00	0.08
285	603876	鼎胜新材	4,500	203,400.00	0.08
286	600919	江苏银行	28,000	199,360.00	0.08
287	300395	菲利华	4,400	198,000.00	0.08
288	002430	杭氧股份	6,300	196,938.00	0.08
289	600901	江苏租赁	37,800	193,914.00	0.07
290	002301	齐心集团	29,200	192,720.00	0.07
291	300406	九强生物	11,000	190,190.00	0.07
292	002115	三维通信	45,600	189,240.00	0.07
293	300775	三角防务	3,900	187,785.00	0.07
294	605338	巴比食品	6,100	186,111.00	0.07
295	688300	联瑞新材	2,386	185,272.90	0.07
296	601958	金铂股份	20,800	183,872.00	0.07
297	600035	楚天高速	54,400	177,888.00	0.07
298	600152	维科技术	28,900	176,579.00	0.07
299	002792	通宇通讯	14,500	174,870.00	0.07
300	688314	康拓医疗	3,600	174,780.00	0.07
301	603516	淳中科技	13,900	172,082.00	0.07
302	603707	健友股份	6,000	169,200.00	0.07
303	002303	美盈森	48,600	167,670.00	0.06
304	300935	盈建科	5,300	165,784.00	0.06
305	300811	铂科新材	1,700	165,444.00	0.06
306	688698	伟创电气	8,100	164,835.00	0.06
307	600229	城市传媒	25,033	163,715.82	0.06
308	603790	雅运股份	15,400	163,702.00	0.06
309	002453	华软科技	11,500	162,495.00	0.06
310	601369	陕鼓动力	16,900	162,240.00	0.06
311	600523	贵航股份	6,900	162,150.00	0.06
312	000060	中金岭南	36,300	161,898.00	0.06
313	688019	安集科技	760	161,819.20	0.06
314	603038	华立股份	19,100	161,777.00	0.06
315	688045	必易微	2,600	161,148.00	0.06
316	600233	圆通速递	7,900	161,081.00	0.06
317	688123	聚辰股份	1,500	159,780.00	0.06
318	300462	华铭智能	16,500	158,895.00	0.06
319	600130	波导股份	41,100	157,413.00	0.06
320	605008	长鸿高科	11,000	154,220.00	0.06
321	600461	洪城环境	18,600	150,474.00	0.06
322	002311	海大集团	2,500	150,025.00	0.06
323	603279	景津装备	4,740	146,987.40	0.06
324	002142	宁波银行	4,100	146,821.00	0.06

325	601872	招商轮船	25,400	146,304.00	0.06
326	002441	众业达	15,500	146,010.00	0.06
327	600967	内蒙一机	16,000	145,920.00	0.06
328	605168	三人行	1,337	144,569.81	0.06
329	688066	航天宏图	1,832	144,361.60	0.06
330	603386	骏亚科技	9,200	144,348.00	0.06
331	688202	美迪西	424	143,994.64	0.06
332	300346	南大光电	3,960	142,480.80	0.05
333	601658	邮储银行	26,400	142,296.00	0.05
334	300407	凯发电气	17,200	141,212.00	0.05
335	002807	江阴银行	31,000	140,430.00	0.05
336	600983	惠而浦	18,000	139,500.00	0.05
337	300183	东软载波	9,400	139,026.00	0.05
338	605005	合兴股份	8,000	138,720.00	0.05
339	300429	强力新材	14,600	138,554.00	0.05
340	603506	南都物业	9,800	136,808.00	0.05
341	688095	福昕软件	1,896	134,616.00	0.05
342	601158	重庆水务	24,900	133,215.00	0.05
343	002567	唐人神	15,500	131,905.00	0.05
344	300030	阳普医疗	18,100	131,768.00	0.05
345	601827	三峰环境	18,300	130,296.00	0.05
346	600292	远达环保	21,000	129,780.00	0.05
347	688518	联赢激光	3,777	128,380.23	0.05
348	688508	芯朋微	1,718	127,991.00	0.05
349	002741	光华科技	6,400	127,552.00	0.05
350	002372	伟星新材	5,300	127,412.00	0.05
351	002891	中宠股份	5,000	127,100.00	0.05
352	688268	华特气体	1,800	126,468.00	0.05
353	688081	兴图新科	6,000	124,500.00	0.05
354	603931	格林达	6,160	123,816.00	0.05
355	002555	三七互娱	5,800	123,134.00	0.05
356	603890	春秋电子	12,400	122,264.00	0.05
357	003027	同兴环保	7,000	122,150.00	0.05
358	600269	赣粤高速	34,900	121,103.00	0.05
359	600985	淮北矿业	8,300	120,848.00	0.05
360	002533	金杯电工	17,000	120,530.00	0.05
361	300151	昌红科技	6,300	119,070.00	0.05
362	002929	润建股份	3,300	118,470.00	0.05
363	600029	南方航空	16,000	116,960.00	0.04
364	301139	元道通信	2,995	115,187.70	0.04
365	688033	天宜上佳	5,401	114,717.24	0.04
366	002063	远光软件	16,100	113,183.00	0.04
367	603596	伯特利	1,400	112,252.00	0.04

368	600768	宁波富邦	12,200	111,996.00	0.04
369	601995	中金公司	2,500	111,225.00	0.04
370	600837	海通证券	11,300	110,853.00	0.04
371	002371	北方华创	400	110,848.00	0.04
372	002012	凯恩股份	20,400	108,732.00	0.04
373	000429	粤高速 A	13,500	108,675.00	0.04
374	688393	安必平	4,800	108,672.00	0.04
375	000750	国海证券	29,700	107,811.00	0.04
376	600528	中铁工业	13,200	106,260.00	0.04
377	688026	洁特生物	2,300	105,846.00	0.04
378	600348	华阳股份	6,700	103,582.00	0.04
379	002410	广联达	1,900	103,436.00	0.04
380	600499	科达制造	5,000	103,200.00	0.04
381	000728	国元证券	16,500	102,630.00	0.04
382	600989	宝丰能源	7,000	102,550.00	0.04
383	603586	金麒麟	7,900	102,068.00	0.04
384	600129	太极集团	4,500	98,865.00	0.04
385	002404	嘉欣丝绸	17,100	98,325.00	0.04
386	300441	鲍斯股份	14,400	97,200.00	0.04
387	002950	奥美医疗	7,700	97,174.00	0.04
388	300634	彩讯股份	7,600	96,520.00	0.04
389	605099	共创草坪	3,600	95,724.00	0.04
390	002690	美亚光电	4,400	95,392.00	0.04
391	603529	爱玛科技	1,820	95,331.60	0.04
392	603053	成都燃气	10,200	95,268.00	0.04
393	000708	中信特钢	4,700	94,705.00	0.04
394	000801	四川九洲	13,900	94,659.00	0.04
395	300453	三鑫医疗	9,500	94,430.00	0.04
396	300627	华测导航	2,700	92,853.00	0.04
397	600153	建发股份	7,100	92,797.00	0.04
398	603129	春风动力	800	90,976.00	0.03
399	300789	唐源电气	4,500	90,765.00	0.03
400	300993	玉马遮阳	7,100	90,738.00	0.03
401	603022	新通联	9,700	88,561.00	0.03
402	601933	永辉超市	20,600	88,168.00	0.03
403	605090	九丰能源	4,340	87,971.80	0.03
404	301067	显盈科技	2,200	86,812.00	0.03
405	600481	双良节能	5,100	85,935.00	0.03
406	002543	万和电气	12,100	84,942.00	0.03
407	300244	迪安诊断	2,700	83,970.00	0.03
408	600690	海尔智家	3,000	82,380.00	0.03
409	300405	科隆股份	13,900	81,176.00	0.03
410	000776	广发证券	4,200	78,540.00	0.03

411	600584	长电科技	2,900	78,300.00	0.03
412	002468	申通快递	6,500	77,480.00	0.03
413	002989	中天精装	5,360	77,291.20	0.03
414	600875	东方电气	4,600	75,670.00	0.03
415	000698	沈阳化工	17,300	75,428.00	0.03
416	300447	全信股份	3,700	75,369.00	0.03
417	600048	保利发展	4,300	75,078.00	0.03
418	688005	容百科技	580	75,075.20	0.03
419	300277	海联讯	10,600	74,094.00	0.03
420	600132	重庆啤酒	500	73,300.00	0.03
421	688590	新致软件	5,100	73,083.00	0.03
422	300341	麦克奥迪	8,000	72,720.00	0.03
423	600488	天药股份	16,900	72,670.00	0.03
424	601555	东吴证券	10,450	72,418.50	0.03
425	002416	爱施德	7,700	71,610.00	0.03
426	600308	华泰股份	12,500	71,375.00	0.03
427	300373	扬杰科技	1,000	71,250.00	0.03
428	601609	金田股份	9,400	70,594.00	0.03
429	601318	中国平安	1,500	70,035.00	0.03
430	600929	雪天盐业	7,500	69,600.00	0.03
431	000408	藏格矿业	2,100	69,174.00	0.03
432	301213	观想科技	1,600	68,624.00	0.03
433	603823	百合花	5,200	68,380.00	0.03
434	002120	韵达股份	4,000	68,240.00	0.03
435	002267	陕天然气	9,700	67,803.00	0.03
436	603880	南卫股份	11,500	67,390.00	0.03
437	603989	艾华集团	2,300	64,860.00	0.02
438	603677	奇精机械	5,100	63,291.00	0.02
439	300034	钢研高纳	1,500	63,270.00	0.02
440	603392	万泰生物	403	62,585.90	0.02
441	601001	晋控煤业	3,500	62,125.00	0.02
442	000048	京基智农	3,300	61,281.00	0.02
443	601577	长沙银行	7,700	61,061.00	0.02
444	002829	星网宇达	2,000	61,000.00	0.02
445	002161	远望谷	12,100	60,621.00	0.02
446	000600	建投能源	14,300	60,346.00	0.02
447	688282	理工导航	1,323	60,024.51	0.02
448	000153	丰原药业	7,100	59,356.00	0.02
449	601390	中国中铁	9,400	57,716.00	0.02
450	301101	明月镜片	1,100	56,463.00	0.02
451	002032	苏泊尔	1,000	56,340.00	0.02
452	688301	奕瑞科技	119	56,291.76	0.02
453	300791	仙乐健康	1,800	56,196.00	0.02

454	688096	京源环保	4,100	55,596.00	0.02
455	000962	东方钨业	5,200	54,444.00	0.02
456	603588	高能环境	4,700	54,191.00	0.02
457	300539	横河精密	5,900	54,044.00	0.02
458	601011	宝泰隆	12,800	53,504.00	0.02
459	000623	吉林敖东	3,600	53,136.00	0.02
460	300755	华致酒行	1,200	52,620.00	0.02
461	300251	光线传媒	5,500	52,085.00	0.02
462	300322	硕贝德	5,900	51,684.00	0.02
463	000922	佳电股份	6,100	51,667.00	0.02
464	300684	中石科技	3,700	51,615.00	0.02
465	688788	科思科技	1,120	50,635.20	0.02
466	300450	先导智能	800	50,544.00	0.02
467	688188	柏楚电子	227	49,949.08	0.02
468	688138	清溢光电	3,100	49,879.00	0.02
469	601211	国泰君安	3,251	49,415.20	0.02
470	000568	泸州老窖	200	49,308.00	0.02
471	300410	正业科技	5,800	49,300.00	0.02
472	603278	大业股份	5,800	48,314.00	0.02
473	603861	白云电器	5,900	48,085.00	0.02
474	300358	楚天科技	2,700	48,033.00	0.02
475	600057	厦门象屿	5,400	47,466.00	0.02
476	300419	浩丰科技	8,700	47,328.00	0.02
477	601088	中国神华	1,400	46,620.00	0.02
478	300615	欣天科技	4,200	46,284.00	0.02
479	300625	三雄极光	3,800	45,676.00	0.02
480	600662	外服控股	6,600	44,550.00	0.02
481	601686	友发集团	5,600	42,784.00	0.02
482	688051	佳华科技	1,500	42,735.00	0.02
483	300331	苏大维格	2,400	42,624.00	0.02
484	301086	鸿富瀚	700	42,385.00	0.02
485	603708	家家悦	2,900	41,296.00	0.02
486	300398	飞凯材料	1,800	41,148.00	0.02
487	002422	科伦药业	2,200	41,140.00	0.02
488	300953	震裕科技	300	41,097.00	0.02
489	000778	新兴铸管	8,300	40,006.00	0.02
490	600151	航天机电	3,600	39,996.00	0.02
491	000543	皖能电力	9,900	39,501.00	0.02
492	600900	长江电力	1,700	39,304.00	0.02
493	002308	威创股份	9,900	38,115.00	0.01
494	002484	江海股份	1,600	37,344.00	0.01
495	300308	中际旭创	1,200	37,260.00	0.01
496	300815	玉禾田	2,120	36,866.80	0.01

497	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.01
498	300726	宏达电子	600	36,702.00	0.01
499	600117	西宁特钢	10,300	36,565.00	0.01
500	600548	深高速	3,800	36,252.00	0.01
501	688036	传音控股	400	35,692.00	0.01
502	300697	电工合金	3,400	35,564.00	0.01
503	300504	天邑股份	2,000	35,520.00	0.01
504	000009	中国宝安	2,600	35,074.00	0.01
505	002871	伟隆股份	3,500	35,000.00	0.01
506	605499	东鹏饮料	200	34,172.00	0.01
507	603725	天安新材	4,800	33,936.00	0.01
508	688116	天奈科技	200	33,896.00	0.01
509	600376	首开股份	6,900	33,879.00	0.01
510	603277	银都股份	1,600	33,776.00	0.01
511	300035	中科电气	1,200	33,540.00	0.01
512	600688	上海石化	10,400	33,072.00	0.01
513	600809	山西汾酒	100	32,480.00	0.01
514	600710	苏美达	5,500	32,450.00	0.01
515	300630	普利制药	900	31,635.00	0.01
516	601003	柳钢股份	7,800	31,590.00	0.01
517	603259	药明康德	300	31,197.00	0.01
518	300260	新莱应材	600	30,522.00	0.01
519	688356	键凯科技	123	29,742.63	0.01
520	603187	海容冷链	800	29,240.00	0.01
521	002821	凯莱英	100	28,900.00	0.01
522	002244	滨江集团	3,200	27,680.00	0.01
523	603385	惠达卫浴	3,600	27,252.00	0.01
524	301193	家联科技	1,000	27,150.00	0.01
525	000811	冰轮环境	2,600	27,118.00	0.01
526	688599	天合光能	400	26,100.00	0.01
527	300496	中科创达	200	26,096.00	0.01
528	601336	新华保险	800	25,752.00	0.01
529	300930	屹通新材	700	25,144.00	0.01
530	002369	卓翼科技	5,600	25,032.00	0.01
531	002833	弘亚数控	1,500	25,020.00	0.01
532	603565	中谷物流	1,572	24,947.64	0.01
533	605369	拱东医疗	200	24,840.00	0.01
534	688598	金博股份	83	24,460.10	0.01
535	603689	皖天然气	3,360	23,721.60	0.01
536	002975	博杰股份	600	22,950.00	0.01
537	300177	中海达	2,800	22,652.00	0.01
538	688330	宏力达	263	22,615.37	0.01
539	600390	五矿资本	4,600	22,494.00	0.01

540	600377	宁沪高速	2,500	21,425.00	0.01
541	003038	鑫铂股份	420	21,168.00	0.01
542	688700	东威科技	252	21,001.68	0.01
543	000931	中关村	3,200	20,992.00	0.01
544	300162	雷曼光电	2,900	20,619.00	0.01
545	688196	卓越新能	260	20,020.00	0.01
546	300354	东华测试	600	19,290.00	0.01
547	688029	南微医学	219	19,096.80	0.01
548	000402	金融街	3,200	19,040.00	0.01
549	300713	英可瑞	1,200	18,360.00	0.01
550	002304	洋河股份	100	18,315.00	0.01
551	002314	南山控股	4,300	17,802.00	0.01
552	600176	中国巨石	1,000	17,410.00	0.01
553	300618	寒锐钴业	300	17,376.00	0.01
554	600299	安迪苏	1,800	17,244.00	0.01
555	300457	赢合科技	600	17,046.00	0.01
556	600795	国电电力	4,300	16,813.00	0.01
557	605117	德业股份	60	16,793.40	0.01
558	002773	康弘药业	1,100	16,434.00	0.01
559	301122	采纳股份	232	16,325.84	0.01
560	000983	山西焦煤	1,200	16,068.00	0.01
561	002198	嘉应制药	2,800	15,372.00	0.01
562	300797	钢研纳克	1,100	14,982.00	0.01
563	002848	高斯贝尔	1,400	14,700.00	0.01
564	600128	弘业股份	1,700	14,348.00	0.01
565	600958	东方证券	1,400	14,294.00	0.01
566	000551	创元科技	1,600	13,808.00	0.01
567	301286	侨源股份	681	13,476.99	0.01
568	688101	三达膜	900	13,230.00	0.01
569	301298	东利机械	634	13,206.22	0.01
570	301302	华如科技	228	12,863.76	0.00
571	301212	联盛化学	379	12,613.12	0.00
572	605016	百龙创园	300	12,606.00	0.00
573	605111	新洁能	100	12,581.00	0.00
574	688023	安恒信息	85	12,551.10	0.00
575	000036	华联控股	2,900	12,528.00	0.00
576	301259	艾布鲁	483	12,046.02	0.00
577	600012	皖通高速	1,600	11,952.00	0.00
578	001268	联合精密	409	11,337.48	0.00
579	301220	亚香股份	285	11,157.75	0.00
580	600195	中牧股份	900	11,034.00	0.00
581	301097	天益医疗	209	9,996.47	0.00
582	301248	杰创智能	319	9,528.53	0.00

583	601588	北辰实业	4,000	9,360.00	0.00
584	300384	三联虹普	500	9,300.00	0.00
585	301206	三元生物	203	9,275.07	0.00
586	300825	阿尔特	600	9,162.00	0.00
587	301236	软通动力	291	9,131.58	0.00
588	301103	何氏眼科	281	8,997.62	0.00
589	301125	腾亚精工	327	8,966.34	0.00
590	301163	宏德股份	277	8,955.41	0.00
591	301130	西点药业	237	8,934.90	0.00
592	301200	大族数控	172	8,930.24	0.00
593	603610	麒盛科技	652	8,808.52	0.00
594	301150	中一科技	104	8,607.04	0.00
595	301102	兆讯传媒	266	8,269.94	0.00
596	301135	瑞德智能	308	8,088.08	0.00
597	300768	迪普科技	500	8,075.00	0.00
598	301123	奕东电子	306	7,769.34	0.00
599	301109	军信股份	479	7,731.06	0.00
600	301237	和顺科技	183	7,660.38	0.00
601	688122	西部超导	83	7,652.60	0.00
602	301228	实朴检测	373	7,586.82	0.00
603	688139	海尔生物	102	7,428.66	0.00
604	301196	唯科科技	192	7,203.84	0.00
605	600971	恒源煤电	900	7,110.00	0.00
606	301148	嘉戎技术	297	7,098.30	0.00
607	301181	标榜股份	231	7,066.29	0.00
608	688098	申联生物	900	7,056.00	0.00
609	600097	开创国际	700	6,881.00	0.00
610	301279	金道科技	296	6,751.76	0.00
611	301219	腾远钴业	72	6,323.04	0.00
612	002377	国创高新	1,800	5,976.00	0.00
613	603589	口子窖	100	5,861.00	0.00
614	600819	耀皮玻璃	1,100	5,687.00	0.00
615	688008	澜起科技	92	5,573.36	0.00
616	603079	圣达生物	400	5,324.00	0.00
617	688568	中科星图	76	5,149.76	0.00
618	300529	健帆生物	100	5,089.00	0.00
619	688168	安博通	122	4,379.80	0.00
620	688258	卓易信息	124	4,260.64	0.00
621	300335	迪森股份	800	3,880.00	0.00
622	600531	豫光金铅	700	3,689.00	0.00
623	688685	迈信林	127	3,632.20	0.00
624	688607	康众医疗	129	3,312.72	0.00
625	688329	艾隆科技	102	3,299.70	0.00

626	300950	德固特	200	3,260.00	0.00
627	688109	品茗股份	103	3,182.70	0.00
628	688006	杭可科技	45	3,152.70	0.00
629	688191	智洋创新	185	3,145.00	0.00
630	000059	华锦股份	500	2,960.00	0.00
631	688278	特宝生物	98	2,889.04	0.00
632	603719	良品铺子	100	2,863.00	0.00
633	688266	泽璟制药	63	2,261.07	0.00
634	603978	深圳新星	100	2,131.00	0.00
635	688208	道通科技	64	2,106.88	0.00
636	601225	陕西煤业	96	2,033.28	0.00
637	600980	北矿科技	100	1,652.00	0.00
638	300150	世纪瑞尔	400	1,612.00	0.00
639	688020	方邦股份	31	1,208.69	0.00
640	688030	山石网科	56	1,162.00	0.00
641	300226	上海钢联	40	906.00	0.00
642	688106	金宏气体	46	899.30	0.00
643	002839	张家港行	100	529.00	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	600325	华发股份	5,330,427.00	1.61
2	002128	电投能源	4,973,133.00	1.51
3	300769	德方纳米	4,688,819.80	1.42
4	002276	万马股份	4,594,818.00	1.39
5	600919	江苏银行	4,564,076.00	1.38
6	300750	宁德时代	4,433,130.00	1.34
7	603896	寿仙谷	4,411,221.20	1.34
8	601009	南京银行	4,400,240.20	1.33
9	000627	天茂集团	4,143,904.74	1.26
10	600846	同济科技	4,018,090.00	1.22
11	601928	凤凰传媒	3,981,937.79	1.21
12	603613	国联股份	3,949,644.00	1.20
13	300696	爱乐达	3,846,968.00	1.17
14	300401	花园生物	3,733,728.00	1.13
15	688516	奥特维	3,727,608.90	1.13
16	601225	陕西煤业	3,662,978.00	1.11
17	002254	泰和新材	3,581,662.80	1.09
18	688100	威胜信息	3,579,355.46	1.08
19	688016	心脉医疗	3,541,305.51	1.07

20	600718	东软集团	3,529,175.00	1.07
----	--------	------	--------------	------

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	600919	江苏银行	6,190,736.00	1.88
2	601928	凤凰传媒	5,004,429.76	1.52
3	000733	振华科技	4,982,177.00	1.51
4	002203	海亮股份	4,924,585.00	1.49
5	601225	陕西煤业	4,847,051.00	1.47
6	688030	山石网科	4,724,738.86	1.43
7	688050	爱博医疗	4,584,246.88	1.39
8	601009	南京银行	4,433,616.20	1.34
9	601158	重庆水务	4,343,835.00	1.32
10	000090	天健集团	4,300,406.00	1.30
11	601857	中国石油	3,941,671.00	1.19
12	603260	合盛硅业	3,915,160.00	1.19
13	688586	江航装备	3,910,623.26	1.18
14	002696	百洋股份	3,884,939.00	1.18
15	603610	麒盛科技	3,808,186.68	1.15
16	601666	平煤股份	3,785,831.00	1.15
17	300401	花园生物	3,716,412.00	1.13
18	688200	华峰测控	3,667,317.22	1.11
19	600155	华创阳安	3,560,127.00	1.08
20	688168	安博通	3,534,848.25	1.07

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	933,243,105.75
卖出股票收入（成交）总额	984,886,219.58

注：“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-

3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	7,700.05	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	7,700.05	0.00

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	123150	九强转债	77	7,700.05	0.00
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末无国债期货投资。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货投资。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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	595,302.89
2	应收清算款	381,376.70
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	54.99
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	976,734.58

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	600941	中国移动	5,264,494.38	2.02	新发流通受限

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

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
华夏智胜价值成长股票 A	377	167,717.76	59,672,335.06	94.37%	3,557,259.68	5.63%
华夏智胜价值	137	859,049.88	113,127,259.34	96.12%	4,562,573.58	3.88%

成长股票 C						
合计	514	351,983.32	172,799,594.40	95.51%	8,119,833.26	4.49%

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	华夏智胜价值成长股票 A	457,133.82	0.72%
	华夏智胜价值成长股票 C	103,357.95	0.09%
	合计	560,491.77	0.31%

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	华夏智胜价值成长股票 A	0~10
	华夏智胜价值成长股票 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	华夏智胜价值成长股票 A	0~10
	华夏智胜价值成长股票 C	0
	合计	0~10

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

截至 2021 年 3 月 6 日,华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金的基金合同生效届满三年。

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华夏智胜价值成长股票 A	华夏智胜价值成长股票 C
基金合同生效日（2018 年 3 月 6 日）基金份额总额	10,903,772.92	-
本报告期期初基金份额总额	63,878,697.48	160,245,770.50
本报告期基金总申购份额	1,030,329.55	12,726,442.41
减：本报告期基金总赎回份额	1,679,432.29	55,282,379.99
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	63,229,594.74	117,689,832.92

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金于 2022 年 3 月 5 日公告以通讯方式召开基金份额持有人大会，审议《关于华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金修改基金合同有关事项的议案》，会议议案于 2022 年 4 月 6 日获得通过，大会决议自同日起生效。自 2022 年 4 月 7 日起，本基金调整投资范围、相应调整投资策略和投资比例限制、修改业绩比较基准等，并相应修订基金合同等法律文件。

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

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

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	
方正证券	1	620,936,033.16	32.50%	267,804.92	32.50%	-
招商证券	6	589,854,546.31	30.87%	254,407.63	30.87%	-
中信证券	10	430,515,365.09	22.53%	185,692.11	22.53%	-
中金公司	4	183,178,166.74	9.59%	79,010.57	9.59%	-
华西证券	1	86,149,335.10	4.51%	37,157.69	4.51%	-

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，本基金还选择了长江证券、东方证券、东吴证券、光大证券、广发证券、国联证券、国泰君安证券、海通证券、华泰证券、江海证券、金元证券、联储证券、平安证券、申万宏源证券、西部证券、中泰证券、中信建投证券、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 在上述租用的券商交易单元中，国联证券的部分交易单元为本基金本期剔除的交易单元，本期没有新增的券商交易单元。

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
方正证券	229,972.20	14.46%	-	-	-	-	-	-
招商证券	196,151.00	12.33%	-	-	-	-	-	-
中信证券	1,150,334.08	72.32%	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
华西证券	14,194.20	0.89%	-	-	-	-	-	-

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	2022-01-21
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	2022-02-12
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	2022-02-17
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	2022-02-19
5	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-02-23
6	华夏基金管理有限公司关于以通讯方式召开华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金基金份额持有人大会的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-03-05
7	华夏基金管理有限公司关于以通讯方式召开华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-03-07
8	华夏基金管理有限公司关于以通讯方式召开华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-03-08
9	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-03-12
10	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-03-19
11	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-04-02
12	华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-04-07
13	华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金基金份额持有人大会公证书	中国证监会指定报刊及网站	2022-04-07
14	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-04-08
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	2022-04-13
16	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-04-19
17	华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金开放定期定额申购业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-05-19
18	华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金限制申购、定期定额申购及转换转入业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-05-19
19	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-06-18

20	华夏基金管理有限公司关于调整华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金申购、定期定额申购及转换转入业务限额的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-06-23
21	华夏基金管理有限公司公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-06-24
22	华夏基金管理有限公司公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-06-25

§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	2022-01-01 至 2022-06-30	69,557,649.66	-	-	69,557,649.66	38.45%
	2	2022-01-01 至 2022-06-30	48,375,182.37	-	-	48,375,182.37	26.74%
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。							

§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转型的文件；
- 2、《华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《华夏智胜价值成长股票型发起式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

二〇二二年八月三十日