
华夏新能源车龙头混合型发起式证券投资基金

2022 年年度报告

2022 年 12 月 31 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

送出日期：二〇二三年三月三十日

§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。本年度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 2023 年 3 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中的财务资料经审计，普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2022 年 1 月 1 日起至 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况	4
3.1 主要会计数据和财务指标.....	4
3.2 基金净值表现.....	5
3.3 过去三年基金的利润分配情况	8
§4 管理人报告.....	8
§5 托管人报告.....	15
§6 审计报告.....	16
§7 年度财务报表.....	18
7.1 资产负债表.....	18
7.2 利润表.....	19
7.3 净资产（基金净值）变动表.....	20
7.4 报表附注.....	22
§8 投资组合报告	55
8.1 期末基金资产组合情况	55
8.3 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	56
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	58
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	64
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	64
8.7 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	64
8.8 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	64
8.9 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	64
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	64
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	64
8.12 投资组合报告附注	64
§9 基金份额持有人信息.....	65
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	65
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	65
9.3 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	65
§10 开放式基金份额变动.....	66
§11 重大事件揭示.....	66
§12 影响投资者决策的其他重要信息	70
§13 备查文件目录.....	70

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华夏新能源车龙头混合型发起式证券投资基金	
基金简称	华夏新能源车龙头混合发起式	
基金主代码	013395	
交易代码	013395	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 9 月 15 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	1,699,641,662.34 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华夏新能源车龙头混合发起式 A	华夏新能源车龙头混合发起式 C
下属分级基金的交易代码	013395	013396
报告期末下属分级基金的份额总额	720,812,298.23 份	978,829,364.11 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的前提下，精选新能源车龙头主题投资标的，追求超越业绩比较基准的投资回报。
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，可转换债券、可交换债券投资策略，资产支持证券投资策略，股指期货投资策略，股票期权投资策略，国债期货投资策略等。 本基金界定的新能源车是以清洁能源为能量来源，通过搭载先进动力系统、传感器、控制器、执行器等装置，运用信息通信、互联网、大数据、人工智能等新技术，由单纯交通工具逐步向智能移动空间和应用终端转变，成为新兴业态的重要载体。新能源车相关产业主要包括三类：一是为新能源车制造提供材料设备和技术服务的相关行业，包括传统整车及配件、汽车电子、新材料、信息通信、车用芯片设计制造、车联网等。二是为新能源车运行提供能量来源、动力系统、传动系统的相关行业，包括锂电池、氢燃料电池、电机电控、充电设施、各种类型的清洁能源等。三是与新能源车下游终端应用相关的行业，包括交通运输、无人驾驶等。 本基金所指的新能源车龙头是指新能源车相关产业中拥有较强的先发优势、稳定或独特盈利模式、较高的“护城河”、具备“定价权”、优秀的管理层、市场空间广阔，已经或者未来有望成为所在细分领域龙头的相关企业。新能源车相关产业范畴会随着科学技术及商业模式的发展不断变化，基金管理人将持续跟踪相关产业的发展变化，在履行适当程序后，根据实际情况对新能源车相关产业及公司的界定进行动态更新。
业绩比较基准	中证新能源汽车产业指数收益率×60%+中证港股通综合指数收益率×20%+中债综合（全价）指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为混合基金，理论上其预期风险和预期收益低于股票基金，高于债券基金与货币市场基金。本基金还将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。

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》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.ChinaAMC.com
基金年度报告备置地点	基金管理人和/或基金托管人的住所/办公地址

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼
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、基金净值表现及利润分配情况

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	2022 年		2021 年 9 月 15 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日	
	华夏新能源车龙头混合发起式 A	华夏新能源车龙头混合发起式 C	华夏新能源车龙头混合发起式 A	华夏新能源车龙头混合发起式 C
本期已实现收益	-53,373,196.25	-49,642,172.82	-1,966,280.47	-1,126,065.62
本期利润	-70,176,482.85	-99,800,459.46	-6,497,873.51	-4,563,104.19
加权平均基金份额本期利润	-0.1497	-0.1701	-0.0472	-0.0540
本期加权平均净值利润率	-15.53%	-17.65%	-4.41%	-5.06%
本期基金	-12.99%	-13.50%	3.63%	3.45%

份 额 净 值 增 长 率				
3.1.2 期末数 据和指标	2022 年末		2021 年末	
	华夏新能源车龙头混合发 起式 A	华夏新能源车龙头混合发 起式 C	华夏新能源车龙头混合发 起式 A	华夏新能源车龙头混合发 起式 C
期 末 可 供 分 配 利 润	-86,871,569.67	-124,803,804.84	-1,225,010.08	-1,050,491.90
期 末 可 供 分 配 基 金 份 额 利 润	-0.1205	-0.1275	-0.0057	-0.0075
期 末 基 金 资 产 净 值	649,956,014.87	875,863,410.94	222,602,611.54	144,421,646.76
期 末 基 金 份 额 净 值	0.9017	0.8948	1.0363	1.0345
3.1.3 累计期 末指标	2022 年末		2021 年末	
	华夏新能源车龙头混合发 起式 A	华夏新能源车龙头混合发 起式 C	华夏新能源车龙头混合 发起式 A	华夏新能源车龙头混合 发起式 C
基 金 份 额 累 计 净 值 增 长 率	-9.83%	-10.52%	3.63%	3.45%

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

华夏新能源车龙头混合发起式 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
过去三个月	0.97%	1.92%	-0.42%	1.39%	1.39%	0.53%
过去六个月	-15.93%	1.85%	-18.55%	1.34%	2.62%	0.51%
过去一年	-12.99%	2.22%	-18.81%	1.59%	5.82%	0.63%
自基金合同生 效起至今	-9.83%	2.16%	-23.03%	1.52%	13.20%	0.64%

华夏新能源车龙头混合发起式 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
过去三个月	0.82%	1.92%	-0.42%	1.39%	1.24%	0.53%
过去六个月	-16.18%	1.85%	-18.55%	1.34%	2.37%	0.51%
过去一年	-13.50%	2.23%	-18.81%	1.59%	5.31%	0.64%
自基金合同生 效起至今	-10.52%	2.16%	-23.03%	1.52%	12.51%	0.64%

效起至今						
------	--	--	--	--	--	--

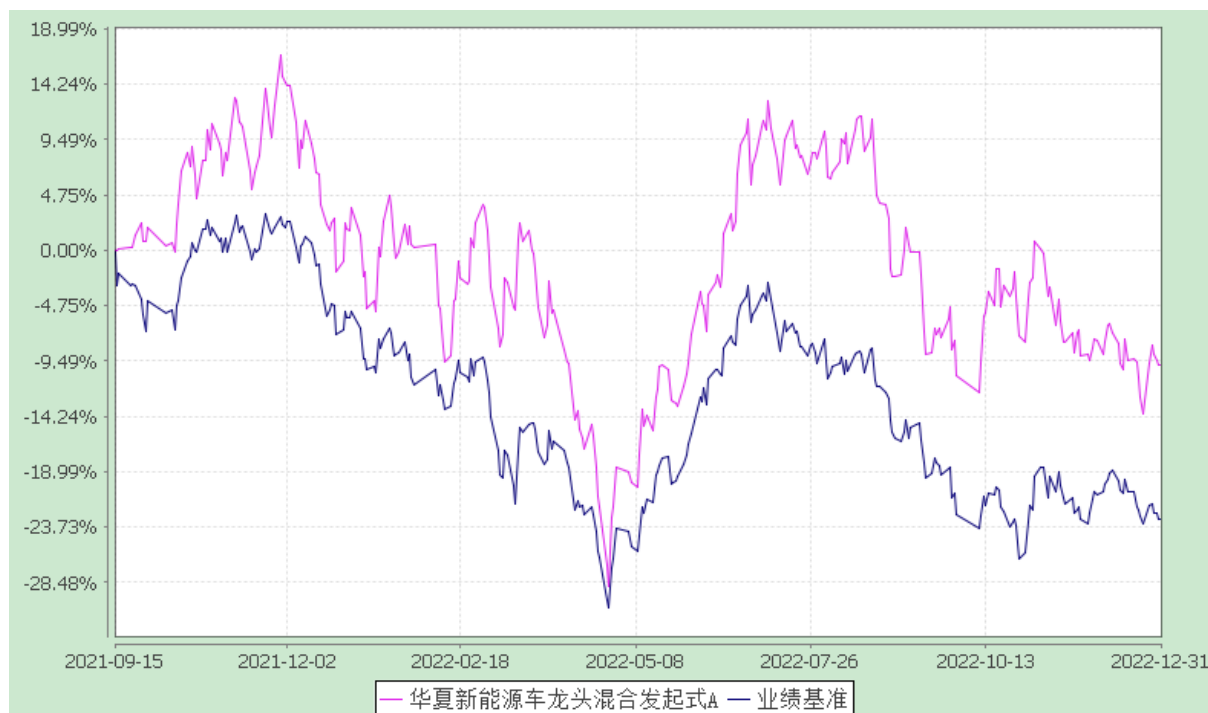
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华夏新能源车龙头混合型发起式证券投资基金

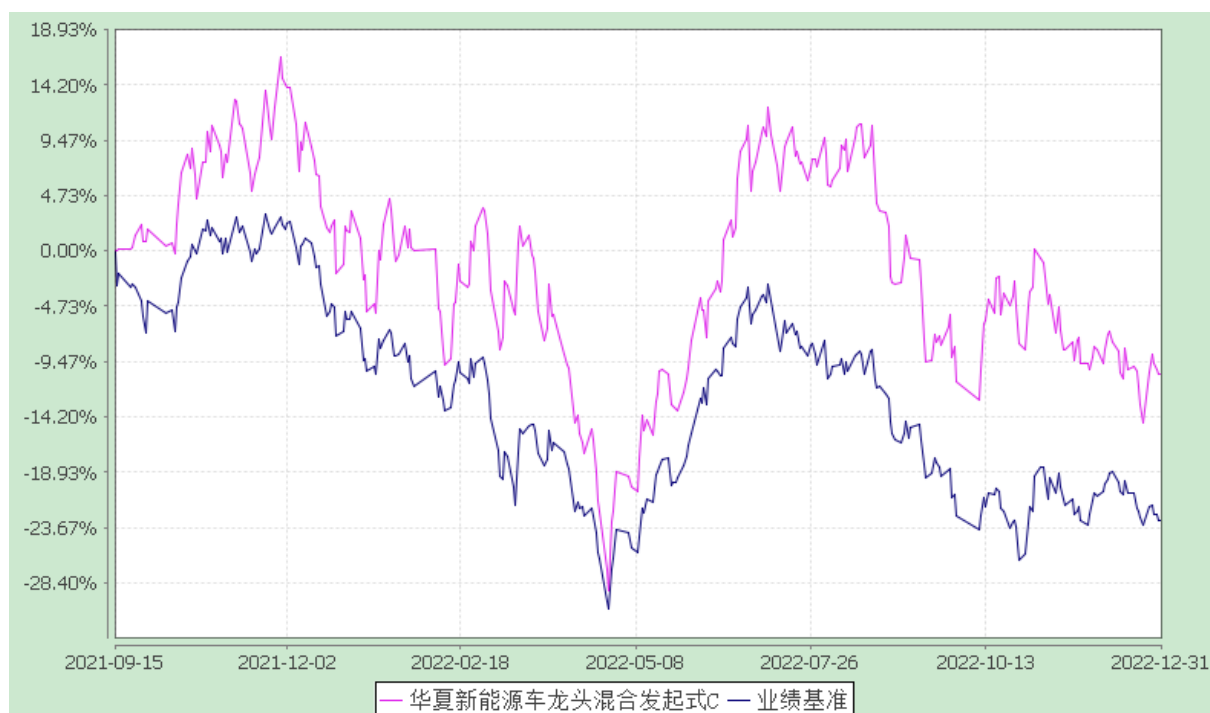
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2021 年 9 月 15 日至 2022 年 12 月 31 日)

华夏新能源车龙头混合发起式 A



华夏新能源车龙头混合发起式 C



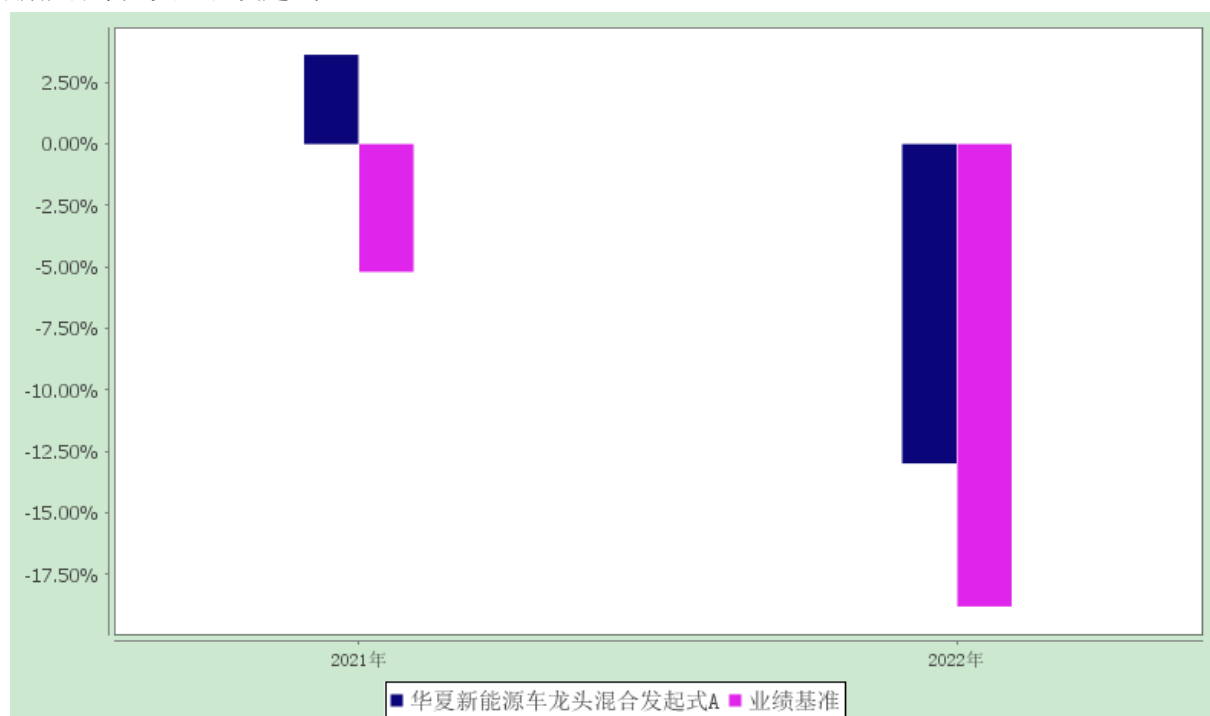
注：根据本基金的基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同中投资范围、投资限制的有关约定。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

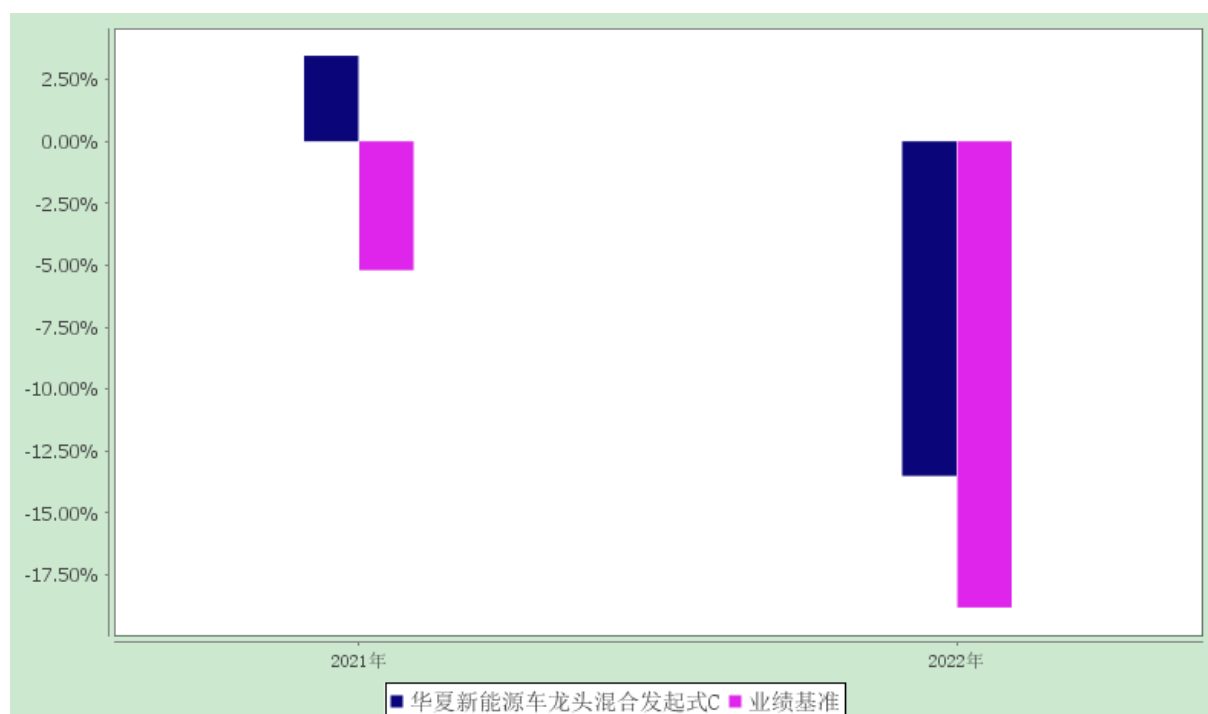
华夏新能源车龙头混合型发起式证券投资基金

自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图

华夏新能源车龙头混合发起式 A



华夏新能源车龙头混合发起式 C



注：本基金合同于 2021 年 9 月 15 日生效，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自基金合同生效以来无利润分配事项。

§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、首批个人养老金基金管理人、境内首批中日互通 ETF 基金管理人、首批商品期货 ETF 基金管理人、首批公募 MOM 基金管理人、首批纳入互联互通 ETF 基金管理人、首批北交所主题基金管理人以及特定客户资产管理人、保险资金投资管理人、公募 REITs 管理人，国内首家承诺“碳中和”具体目标和路径的公募基金公司，香港子公司是首批 RQFII 基金管理人。华夏基金是业务领域最广泛的基金管

理公司之一。

华夏基金是境内 ETF 基金资产管理规模最大的基金管理公司之一，在 ETF 基金管理方面积累了丰富的经验，形成了覆盖大盘蓝筹、宽基指数、中小创指数、主题指数、行业指数、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 12 月 31 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 TMT 与信息技术行业偏股型基金(A 类)中华夏互联网龙头混合(A 类)排名第 2/22；在低碳环保行业股票型基金(A 类)中华夏节能环保股票(A 类)排名第 2/10；在 TMT 与信息技术行业股票型基金(A 类)中华夏科技成长股票排名第 4/20；在医药医疗健康行业偏股型基金(A 类)中华夏逸享健康混合(A 类)排名第 8/60、华夏乐享健康混合(A 类)排名第 17/60；在消费行业偏股型基金(A 类)中华夏网购精选混合(A 类)排名第 12/61；在标准股票型基金(A 类)中华夏智胜价值成长股票(A 类)排名第 12/307；在灵活配置型基金(基准股票比例 30%-60%)(A 类)中华夏新锦绣混合(A 类)排名第 12/451、华夏新锦升混合(A 类)排名第 18/451、华夏新趋势混合(A 类)排名第 78/451；在偏股型基金(股票上限 80%)(A 类)中华夏经典混合排名第 18/148；在偏股型基金(股票上限 95%)(A 类)中华夏新兴经济一年持有混合(A 类)排名第 17/211、华夏磐利一年定开混合(A 类)排名第 38/211、华夏蓝筹混合(LOF)(A 类)排名第 44/211、华夏磐锐一年定开混合(A 类)排名第 45/211、华夏兴华混合(A 类)排名第 49/211；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)排名第 28/461；在偏债型基金(A 类)中华夏睿磐泰盛混合排名第 30/532、华夏磐泰混合(LOF)(A 类)排名第 43/532；在偏股型基金(股票上下限 60%-95%)(A 类)中华夏价值精选混合排名第 60/1177。

固收与固收+产品：在信用债指数债券型基金(A 类)中华夏亚债中国指数(A 类)排名第 2/14；在普通债券型基金(二级)(A 类)中华夏恒融债券排名第 6/336、华夏稳健增利 4 个月债券(A 类)排名第 16/336；在利率债指数债券型基金(A 类)中华夏中债 1-3 年政金债指数(A 类)排名第 21/107；在普通债券型基金(可投转债)(A 类)中华夏鼎禄三个月定开债券(A 类)排名第 33/357；在长期纯债债券型基金(A 类)中华夏鼎隆债券(A 类)排名第 59/1158、华夏鼎英债券(A 类)排名第 60/1158。

指数与量化产品：在对冲策略绝对收益目标基金(A 类)中华夏安泰对冲策略 3 个月定开混合排名第 1/23；在规模指数股票 ETF 基金中华夏沪港通恒生 ETF 排名第 1/131、华夏中证沪港深 500ETF 排名第 26/131、华夏上证 50ETF 排名第 30/131；在规模指数股票 ETF 联接基金(A 类)中华夏沪港通恒生 ETF 联接(A 类)排名第 1/92、华夏上证 50ETF 联接(A 类)排名第 25/92；在行业指数股票 ETF 联接基金(A 类)中华夏中证银行 ETF 联接(A 类)排名第 2/28、华夏中证全指房地产 ETF 联接

(A 类)排名第 7/28; 在增强规模指数股票型基金(A 类)中华夏中证 500 指数增强(A 类)排名第 2/123、华夏中证 500 指数智选增强(A 类)排名第 4/123、华夏沪深 300 指数增强(A 类)排名第 38/123; 在行业指数股票 ETF 基金中华夏中证银行 ETF 排名第 6/51、华夏中证全指房地产 ETF 排名第 16/51; 在主题指数股票 ETF 基金中华夏金融 ETF 发起式排名第 11/257、华夏中证浙江国资创新发展 ETF 排名第 37/257、华夏中证细分食品饮料产业主题 ETF 排名第 40/257、华夏中证央企 ETF 排名第 47/257、华夏中证细分有色金属产业主题 ETF 排名第 67/257; 在主题指数股票 ETF 联接基金(A 类)中华夏中证浙江国资创新发展 ETF 联接(A 类)排名第 21/89、华夏中证央企 ETF 联接(A 类)排名第 27/89。

在《中国证券报》第十九届中国基金业金牛奖评选中, 华夏基金荣获“被动投资金牛基金公司”, 成为业内连续 7 年获此殊荣的基金公司。在证券时报主办的第十七届中国基金业明星基金奖评选活动上, 在“年度十大明星基金公司奖”评选中, 华夏基金成功获奖。此外, 华夏基金还获得“三年海外投资明星基金公司奖”。在《上海证券报》主办的第十九届“金基金”奖评选活动上, 华夏基金将三大金基金奖项收入囊中: 公司层面, 华夏基金荣获“金基金 被动投资基金管理公司奖”; 产品层面, 华夏能源革新股票荣获“金基金 投资回报基金奖”, 华夏沪深 300ETF 荣获“金基金 指数基金三年期奖”。

在客户服务方面, 2022 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; 养老专区升级, 为个人养老金账户的开立、充值及交易提供一站式服务, 提升客户整体操作感受; (3) 与兰州银行、晋商银行、成都银行、九州证券、瑞银基金销售等代销机构合作, 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”、“童言童语话理财”、“寻找代言人”、“成为首批 Y 星人”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		
杨宇	本基金的基金经理	2021-09-15	-	5 年	硕士。曾任中航工业成都飞机设计研究所工程师。2017 年 7 月加入华夏基金管理有限公司。历任投资研究部研究员、基金经理助理。

注: ①上述“任职日期”和“离任日期”为根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。首任基金经

理的，其“任职日期”为基金合同生效日。

②证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.3 基金经理薪酬机制

本基金管理人旗下基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的，不存在基金经理薪酬激励与其在管私募资产管理计划浮动管理费或产品业绩表现挂钩的情况。

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 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规制定了《华夏基金管理有限公司公平交易制度》。公司通过科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时，通过监察稽核、事后分析和信息披露来保证公平交易过程和结果的监督。

4.3.2 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。

4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

本基金管理人一贯严格执行公平交易原则，对兼任基金经理的交易情况进行持续监测。本年度所有相关组合的交易行为均符合法规、制度和流程要求，未发现违反公平交易原则的情况。本年度同一基金经理管理的不同组合在邻近交易日的同向和反向交易，交易时机和交易价差均可合理解释，未发现异常。

本基金管理人根据《基金经理兼任私募资产管理计划投资经理工作指引（试行）》要求，针对同经理管理多个组合间的收益率差异进行归因分析，本年度各组合间收益率差异均属正常情况，主要原因为业绩基准不同、投资策略不同，收益率差异可以合理解释。

4.3.3 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 113 次，其中 110 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 3 次为投资策略需要所致，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

2022 年是全球宏观经济黑天鹅频出的一年。通胀高企、俄乌冲突、疫情冲击使得全球经济和市场都蒙上了一层阴影，不确定性增加，投资难度增大。2022 年 A 股整体震荡下行，全年上证综指下跌 15.13%，创业板指下跌 29.37%。同时，由于宏观经济的不明朗，市场对于汽车（含新能源车）未来销售走势过度悲观，整体板块跌幅巨大。本基金主要对标的行业基准中证新能源汽车产业指数全年下跌 28.8%。我们努力在板块中自下而上选择产品、技术、成本等方面明显领先竞争对手的优势公司，争取获得超额收益，并取得了一定的效果。本基金净值全年下跌 12.99%（其中四季度上涨 0.97%），相较于行业基准取得了超额收益。

2022 年全球新能源车销量约 1060 万辆，同比增长 72%，高基数下依旧实现高增；从渗透率上看，2022 年全球已达到 14%，同比提升 6pct 以上。分市场来看，国内新能源车批发销量为 687 万辆，同比增长 96%，在车型驱动下再度超出年初预期，其中新能源乘用车出口 60.9 万辆，同比增长 149%，国内市场销量达到 622 万辆左右，内外销同步开花；2022 年国内新能源乘用车渗透率达到 28%，同比提升 13pct，2022Q4 已突破 30% 大关。欧洲新能源车销量全年达到 240 万辆左右，同比增长 20% 左右，基本符合年初预期，节奏上看欧洲市场呈现 V 型走势，3 月以来地缘冲突对供应链的影响压制了产销释放，9 月后显著改善，欧洲放量明显。美国市场全年达到 100 万辆，同比增长 60% 左右，美国市场保持高增长的动力主要是油耗经济性考核，但略低于年初预期则是因为新车量产偏慢、税收抵免加码低预期。中美欧以外的市场销量也达到 40 万辆左右，同比翻倍左右增长，是未来全球重要的增长点。

锂电池需求延续高增，考虑 3C、两轮车等市场，预计全球锂电需求达到 850GWh 左右，同比增长 60% 以上；其中国内企业根据高工锂电数据，动力电池的出货量达 480GWh，同比增长 110%；储能电池出货量 130GWh，同比增长 170%。产业链盈利方面，2022 年锂资源供需紧张，价格一度上涨至 60 万元/吨，产业链利润向资源环节转移；不过锂电池龙头也实现了成本疏导，盈利能力保持稳定。材料环节随着 2021 年以来的扩张，逐步进入供给过剩的阶段，例如 2022Q2 的六氟磷酸锂、磷酸铁锂正极、铜箔，以及 2022Q4 的负极石墨化、磷酸铁，不过其中有成本优势、卡位技术进步

或受益于平台化业务延伸到企业，还是充分受益了行业的高成长。

除了动力电池市场延续高增，2023 年全球储能也进入爆发期，欧洲户储得益于地缘冲突、能源涨价，装机量达到 7-8GWh，同比增长 200%左右；国内商业模式理顺，在电网侧独立储能和用户侧储能带动下，国内装机量达到 13-15GWh，增速同样接近 200%；美国市场尽管有锂电池涨价、组件进口限制的负面影响，增速预计也将超过 50%。

在汽车智能化方面，当下汽车行业智能电动变革趋势明确，其发展趋势十分类似智能手机行业的发展历程，综合汽车行业远期发展空间及格局，汽车有望继智能手机成为长期优质成长赛道之一，并在中国诞生大市值公司。随着新能源汽车竞争提升，配置竞赛不断升级，2022 年电动化、智能化和科技化驱动大量细分赛道渗透率快速提升，也同时构成零部件企业的阿尔法。受新能源车对续航里程提升的需求，热管理、轻量化、一体压铸以及电机电控等将跟随新能源放量，迎来市场快速增长，同时国内企业在这些领域均具备较强的竞争力，有望充分受益行业成长红利。智能化方面，智能化时代下，购车者关注重点发生了根本改变，智能化逐渐成为整车厂的胜负手。智能驾驶主要环节如传感器、底盘电子、域控制等均迎来渗透率快速提升的阶段，国内企业在相关环节，如线控制动等零部件的突破将享受蓝海市场。智能座舱持续升级，国内企业已获得一定份额，盈利开始兑现。科技化方面，近年我国汽车消费升级趋势显著，随着购买力提升+增换购比例提升，2022 年乘用车平均购车单价已升至 17 万元，同比提升约 0.5 万元，更高级的配置也逐步普及。同时，新势力快速崛起，在高端智能电动的品牌定位之下对于新兴、高端配置的接受度更高、更愿意使用，竞争之下，行业对于高端科技化功能配置的进程有望加速。差异化配置带动智能大灯、天幕玻璃、多功能座椅、空气悬架等领域的放量，国内企业有望抓住自主对于差异化配置的旺盛需求实现大幅配套。

格局方面，过去受历史发展原因，海外巨头往往技术领先且覆盖面广，配套头部整车企业。但在电动化智能化趋势的当下，智能电动汽车重塑下游销量格局，零部件格局已然开始重塑，国内具备技术、服务响应速度、产能布局、成本等优势本土企业正崛起，我国有望涌现一批世界一流企业。短期来看，汽车零部件属于相对重资产的行业，设备投入较大，产能利用率对板块盈利影响较大，而原材料价格、年降等因素对板块盈利影响次之。因此，展望 2023 年，聚焦格局较好，具备优质下游客户，如特斯拉产业链、比亚迪产业链，同时新产品和新客户进入放量期的优质零部件公司，有望获得较好超额收益。

报告期内，我们综合比较新能源车产业链的各个细分子板块的短期景气度、长期空间和产业壁垒，努力在板块中自下而上选择产品、技术、成本等方面明显领先竞争对手的优势公司，争取获得超额收益，并取得了一定的效果。我们全年重仓布局了行业内的优质龙头公司，这些公司都有着强劲的利润增长和明确的远期潜力。上半年上游资源品供给紧张的时候，我们阶段性布局了锂电上游

资源品个股。下半年，疫情冲击对宏观经济产生了比较大的影响，我们布局了新能源车产业链中的部分逆周期板块，降低了整体基金净值的回撤。通过以上的选股和持仓调整，我们获得了比较明显的超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2022 年 12 月 31 日，华夏新能源车龙头混合发起式 A 基金份额净值为 0.9017 元，本报告期份额净值增长率为-12.99%；华夏新能源车龙头混合发起式 C 基金份额净值为 0.8948 元，本报告期份额净值增长率为-13.50%，同期业绩比较基准增长率为-18.81%。

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 2023 年，我们努力通过扎实的基本面研究，来寻找新能源行业中的超额收益。我们重点的布局方向包括：1.汽车电动化。中国的锂电池行业在全球范围内已经取得了非常明显的比较优势，龙头企业全球份额不断提升，同时带动整个产业链在全球范围内持续扩张。2.汽车智能化。类似过去十年功能手机向智能手机进步的过程，我们认为未来十年是“功能汽车”向“智能汽车”进步的过程，从而会诞生较多汽车零部件的智能化升级的投资机会，譬如域控制器、智能座舱、线控底盘等。3.新能源发电，作为新能源车整体产业链的上游，真正实现碳中和远景的重要抓手，譬如光伏、风电、氢能源、储能等。我们选股的标准为：1.符合产业发展方向（如锂电池领域的高镍化、大电芯、高能量密度、长循环、安全性提升，如汽车智能化方面的智能座舱、驾驶域等），渗透率持续提升，带来更好的消费者体验的细分环节；2.持续通过一体化、产线效率提升、优化管理等方式来降低成本，并取得相较于竞争对手的明显优势；3.业绩持续高增，估值合理。

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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人持续加强合规管理、风险控制和监察稽核工作。在合规管理方面，公司通过合规审核、合规检查、合规咨询、合规宣传与合规培训等对合规风险进行管理，确保公司合规体系高效运行，合规风险有效控制。公司不断强化合规制度建设，在投资者适当性管理和员工投资行为合规管理等方面修订多项管理制度。持续强化合规队伍专业能力建设，提升合规人员解读政策法律、预判防控合规风险的能力。公司通过法律法规答题、合规培训、合规谈话等形式，多措并举厚植合规经营文化。公司严格落实信息披露法规要求，依法合规开展信息披露工作。在风险控制方面，公司秉承数字化管理理念，持续完善内部风险管理系统建设，稳步夯实投资风险管理体系基础。在严格管控基金日常投资运作风险的同时，持续完善风险管理制度建设，提升基金流动性风险、市

场风险、合规风险、操作风险等关键风险的管控水平，努力保障各项风险管理措施落实到位。在监察稽核方面，公司定期和不定期开展内部稽核及离任审计工作，排查业务风险隐患，促进公司整体业务合规运作、稳健经营。

报告期内，本基金管理人所管理的基金整体运作合法合规。本基金管理人将继续以风险控制为核心，坚持基金份额持有人利益优先的原则，提高监察稽核工作的科学性和有效性，切实保障基金合规稳健运作。

4.7 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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

§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。

本年度报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本年度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 审计报告

普华永道中天审字(2023)第 25669 号

华夏新能源车龙头混合型发起式证券投资基金全体基金份额持有人：

6.1 审计意见

(一) 我们审计的内容

我们审计了华夏新能源车龙头混合型发起式证券投资基金(以下简称“华夏新能源车龙头混合发起式”)的财务报表，包括 2022 年 12 月 31 日的资产负债表，2022 年度的利润表和净资产(基金净值)变动表以及财务报表附注。

(二) 我们的意见

我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了华夏新能源车龙头混合发起式 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和净资产变动情况。

6.2 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于华夏新能源车龙头混合发起式，并履行了职业道德方面的其他责任。

6.3 管理层和治理层对财务报表的责任

华夏新能源车龙头混合发起式的基金管理人华夏基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估华夏新能源车龙头混合发起式的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算华夏新能源车龙头混合发起式、终止运营或别无其他现实的选择。

基金管理人治理层负责监督华夏新能源车龙头混合发起式的财务报告过程。

6.4 注册会计师对财务报表审计的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对华夏新能源车龙头混合发起式持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致华夏新能源车龙头混合发起式不能持续经营。

(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

中国注册会计师

朱宏宇 程红粤

上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼

2023 年 3 月 28 日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：华夏新能源车龙头混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	122,796,799.67	26,618,442.23
结算备付金		3,742,902.09	1,560,873.61
存出保证金		710,469.97	66,375.53
交易性金融资产	7.4.7.2	1,413,757,513.25	339,870,495.68
其中：股票投资		1,413,757,513.25	339,870,495.68
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收清算款		74,390.85	-
应收股利		-	-
应收申购款		400,339.43	1,414,025.18
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	3,680.78
资产总计		1,541,482,415.26	369,533,893.01
负债和净资产	附注号	本期末 2022 年 12 月 31 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		8,391,211.60	-
应付赎回款		2,001,945.95	1,660,667.22
应付管理人报酬		1,878,980.41	445,733.96
应付托管费		313,163.39	74,288.97
应付销售服务费		426,658.46	69,306.30
应付投资顾问费		-	-
应交税费		6.89	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	2,651,022.75	259,638.26
负债合计		15,662,989.45	2,509,634.71
净资产：			

实收基金	7.4.7.7	1,699,641,662.34	354,421,410.00
未分配利润	7.4.7.8	-173,822,236.53	12,602,848.30
净资产合计		1,525,819,425.81	367,024,258.30
负债和净资产总计		1,541,482,415.26	369,533,893.01

注：①报告截止日 2022 年 12 月 31 日，华夏新能源车龙头混合发起式 A 基金份额净值 0.9017 元，华夏新能源车龙头混合发起式 C 基金份额净值 0.8948 元；华夏新能源车龙头混合发起式基金份额总额 1,699,641,662.34 份（其中 A 类 720,812,298.23 份，C 类 978,829,364.11 份）。

②本基金合同于 2021 年 9 月 15 日生效，上年度可比期间自 2021 年 9 月 15 日至 2021 年 12 月 31 日。

③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 年年度报告资产负债表中“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 年年度报告资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额。

7.2 利润表

会计主体：华夏新能源车龙头混合型发起式证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 9 月 15 日（基 金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
一、营业总收入		-149,020,959.61	-8,784,514.01
1.利息收入		385,438.74	48,561.15
其中：存款利息收入	7.4.7.9	385,438.74	48,561.15
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-85,080,253.64	-1,236,984.57
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-90,169,131.58	-1,236,984.57
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	1,655,618.44	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.12	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.13	-	-
股利收益	7.4.7.14	3,433,259.50	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.15	-66,961,573.24	-7,968,631.61

4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	2,635,428.53	372,541.02
减：二、营业总支出		20,955,982.70	2,276,463.69
1.管理人报酬		14,945,644.37	998,663.41
2.托管费		2,490,940.79	166,443.88
3.销售服务费		3,307,230.05	151,002.60
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	7.4.7.17	-	-
7.税金及附加		8.05	-
8.其他费用	7.4.7.18	212,159.44	960,353.80
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-169,976,942.31	-11,060,977.70
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-169,976,942.31	-11,060,977.70
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-169,976,942.31	-11,060,977.70

注：①本基金合同于 2021 年 9 月 15 日生效，上年度可比期间自 2021 年 9 月 15 日至 2021 年 12 月 31 日。

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>》中的利润表格式的要求进行列示：2021 年年度报告利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在 2022 年年度报告利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

7.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：华夏新能源车龙头混合型发起式证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	354,421,410.00	-	12,602,848.30	367,024,258.30
二、本期期初净资产（基金净值）	354,421,410.00	-	12,602,848.30	367,024,258.30
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	1,345,220,252.34	-	-186,425,084.83	1,158,795,167.51
（一）、综合收益总额	-	-	-169,976,942.31	-169,976,942.31
（二）、本期基	1,345,220,252.34	-	-16,448,142.52	1,328,772,109.82

金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）				
其中：1.基金申购款	2,779,174,976.60	-	-87,053,900.91	2,692,121,075.69
2.基金赎回款	-1,433,954,724.26	-	70,605,758.39	-1,363,348,965.87
（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）	1,699,641,662.34	-	-173,822,236.53	1,525,819,425.81
项目	上年度可比期间 2021 年 9 月 15 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	115,626,456.43	-	-	115,626,456.43
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	238,794,953.57	-	12,602,848.30	251,397,801.87
（一）、综合收益总额	-	-	-11,060,977.70	-11,060,977.70
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	238,794,953.57	-	23,663,826.00	262,458,779.57
其中：1.基金申购款	323,425,788.89	-	30,546,715.66	353,972,504.55
2.基金赎回款	-84,630,835.32	-	-6,882,889.66	-91,513,724.98
（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）	354,421,410.00	-	12,602,848.30	367,024,258.30

注：本基金合同于 2021 年 9 月 15 日生效，上年度可比期间自 2021 年 9 月 15 日至 2021 年 12

月 31 日。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4，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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

华夏新能源车龙头混合型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）已获中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2021]2523 号文《关于准予华夏新能源车龙头混合型发起式证券投资基金注册的批复》，由华夏基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《华夏新能源车龙头混合型发起式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 2021 年 8 月 23 日至 2021 年 9 月 10 日共募集 115,581,854.05 元（不含认购资金利息），业经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）安永华明（2021）验字第 60739337_A132 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华夏新能源车龙头混合型发起式证券投资基金基金合同》于 2021 年 9 月 15 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 115,626,456.43 份基金份额，其中认购资金利息折合 44,602.38 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，包括国内依法发行或上市的股票(包括创业板、存托凭证及其他中国证监会注册或核准上市的股票)、港股通标的股票、债券(包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、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、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、衍生品（包括股指期货、国债期货、股票期权等）、资产支持证券、货币市场工具（含同业存单）、债券回购、银行存款以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

本基金可根据相关法律法规和《基金合同》的约定，参与融资业务。

本基金的投资组合比例为：股票投资占基金资产的比例为 60%-95%，港股通标的股票投资占股票资产的比例为 0-50%；本基金投资于新能源车龙头主题相关证券资产占非现金基金资产的比例不低于 80%；每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。其中，现金不包括结算备付

金、存出保证金、应收申购款等。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布和修订的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会发布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》和中国证监会、中国基金业协会允许的如财务报表附注 7.4.4 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。

7.4.3 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。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

1. 新金融工具准则(自 2022 年 1 月 1 日起适用)

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

1、金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分类为：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。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

(1) 债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成

本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益。基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资、资产支持证券投资 and 基金投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

（2）权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

2、金融负债的分类

本基金的金融负债于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

3、衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

II. 原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用)

1、金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金目前暂无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

2、金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债包括交易性金融负债及衍生金融负债等。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

1. 新金融工具准则(自 2022 年 1 月 1 日起适用)

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，其公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益。

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益。

本基金对以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础，进行减值处理并确认损失准备。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。

对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违

约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况。当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产。当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

II. 原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用)

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利、债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及金融负债按照公允价值进行后续计量，应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

1、存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

2、当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

3、如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。对于曾经实施份额拆分或折算的基金，由于基金份额拆分或折算引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日或基金份额折算日根据拆分前或折算前的基金份额数及确定的拆分或折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。对于已开放转换业务的基金，上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/（累计亏损）。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

1. 新金融工具准则(自 2022 年 1 月 1 日起适用)

境内基金投资在持有期间应取得的现金红利于除息日确认为投资收益；境外基金投资在持有期间应取得的基金分红收益扣除基金交易所在地适用的预缴所得税后的净额确认为投资收益。境内股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益；境外股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除股票交易所在地适用的预缴所得税后的净额确认为投资收益。境内债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。境外债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在交易所在地适用的预缴所得税及由基金管理人缴纳的增值税

后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；处置时其公允价值与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的按直线法近似计算。

II. 原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用)

境内基金投资在持有期间应取得的现金红利于除息日确认为投资收益；境外基金投资在持有期间应取得的基金分红收益扣除基金交易所在地适用的预缴所得税后的净额确认投资收益。境内股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益；境外股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除股票交易所在地适用的预缴所得税后的净额确认为投资收益。境内债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。境外债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在交易所在地适用的预缴所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率或票面利率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；处置时其公允价值与初始确认金额之间的差额扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的按直线法近似计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

针对基金合同约定费率和计算方法的费用，本基金在费用涵盖期间按合同约定进行确认。

其他以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的按直线法近似计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

同一类别内的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人

可选择现金红利或将现金红利按分红权益再投资日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。

期末可供分配利润指期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

由于本基金各基金份额类别在费用收取上不同，其对应的可分配收益可能有所不同。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，与所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

7.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：（1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；（2）本基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；（3）本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个经营分部运作。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

1、对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况参考《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》对重大影响基金资产净值的特殊事项停牌股票进行估值。

2、对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6 号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》进行估值。

3、对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指

导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外),按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场交易的固定收益品种,按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

4、本基金作为境外投资者在各个国家和地区证券市场的投资所得的相关税负是基于其现行的税法法规。各个国家和地区的税收规定可能发生变化,或者实施具有追溯力的修订,从而导致本基金在正常的经营活动中,部分交易和事项的最终税务处理存在不确定性。在计提和处理税收费用时,本基金需要作出相关会计估计。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 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》、《关于印发《资产管理产品相关会计处理规定》的通知》(财会[2022]14 号)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、应收利息和应收申购款，金额分别为 26,618,442.23 元、1,560,873.61 元、66,375.53 元、3,680.78 元和 1,414,025.18 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-应收利息和应收申购款，金额分别为 26,621,317.59 元、1,561,646.25 元、66,408.31 元、0.00 元和 1,414,025.18 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 339,870,495.68 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 339,870,495.68 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付赎回款、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 1,660,667.22 元、445,733.96 元、74,288.97 元、69,306.30 元、168,767.52 元和 90,870.74 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付赎回款、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 1,660,667.22 元、445,733.96 元、74,288.97 元、69,306.30 元、168,767.52 元和 90,870.74 元。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 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。

7.4.6 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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
活期存款	122,796,799.67	26,618,442.23
等于：本金	122,781,589.56	26,618,442.23
加：应计利息	15,210.11	-
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	122,796,799.67	26,618,442.23

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2022 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		1,488,687,718.10	-	1,413,757,513.25	-74,930,204.85
贵金属投资- 金交所黄金 合约		-	-	-	-
债券	交易所市 场	-	-	-	-
	银行间市 场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证 券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		1,488,687,718.10	-	1,413,757,513.25	-74,930,204.85

项目	上年度末 2021 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	347,839,127.29	-	339,870,495.68	-7,968,631.61
贵金属投资- 金交所黄金 合约	-	-	-	-
债券	交易所市 场	-	-	-
	银行间市 场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证 券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	347,839,127.29	-	339,870,495.68	-7,968,631.61

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

7.4.7.5 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
应收利息	-	3,680.78
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
合计	-	3,680.78

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	393.40	870.74
应付证券出借违约金	-	-

应付交易费用	2,470,629.35	168,767.52
其中：交易所市场	2,470,629.35	168,767.52
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	180,000.00	90,000.00
合计	2,651,022.75	259,638.26

7.4.7.7 实收基金

华夏新能源车龙头混合发起式 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	214,812,550.10	214,812,550.10
本期申购	820,830,975.73	820,830,975.73
本期赎回（以“-”号填列）	-314,831,227.60	-314,831,227.60
本期末	720,812,298.23	720,812,298.23

华夏新能源车龙头混合发起式 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	139,608,859.90	139,608,859.90
本期申购	1,958,344,000.87	1,958,344,000.87
本期赎回（以“-”号填列）	-1,119,123,496.66	-1,119,123,496.66
本期末	978,829,364.11	978,829,364.11

7.4.7.8 未分配利润

华夏新能源车龙头混合发起式 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-1,225,010.08	9,015,071.52	7,790,061.44
本期利润	-53,373,196.25	-16,803,286.60	-70,176,482.85
本期基金份额交易产生的变动数	-32,273,363.34	23,803,501.39	-8,469,861.95
其中：基金申购款	-50,159,631.07	32,543,772.60	-17,615,858.47
基金赎回款	17,886,267.73	-8,740,271.21	9,145,996.52
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-86,871,569.67	16,015,286.31	-70,856,283.36

华夏新能源车龙头混合发起式 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-1,050,491.90	5,863,278.76	4,812,786.86
本期利润	-49,642,172.82	-50,158,286.64	-99,800,459.46
本期基金份额交易产生	-74,111,140.12	66,132,859.55	-7,978,280.57

的变动数			
其中：基金申购款	-150,279,030.68	80,840,988.24	-69,438,042.44
基金赎回款	76,167,890.56	-14,708,128.69	61,459,761.87
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-124,803,804.84	21,837,851.67	-102,965,953.17

7.4.7.9 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 9 月 15 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	311,749.15	43,702.90
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	66,236.30	4,703.51
其他	7,453.29	154.74
合计	385,438.74	48,561.15

7.4.7.10 股票投资收益

7.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 9 月 15 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-90,169,131.58	-1,236,984.57
股票投资收益——赎回差价收入	-	-
股票投资收益——申购差价收入	-	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-	-
合计	-90,169,131.58	-1,236,984.57

7.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 9 月 15 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	5,131,075,014.99	167,022,570.65
减：卖出股票成本总额	5,206,295,332.35	168,259,555.22
减：交易费用	14,948,814.22	-
买卖股票差价收入	-90,169,131.58	-1,236,984.57

7.4.7.11 债券投资收益

7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2022年1月1日至2022年12月31日	2021年9月15日（基金合同生效日）至2021年12月31日
债券投资收益——利息收入	2,267.81	-
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	1,653,350.63	-
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	1,655,618.44	-

7.4.7.11.2 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12月31日	上年度可比期间 2021年9月15日（基金合同生效日）至2021年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	6,551,825.09	-
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	4,896,000.00	-
减：应计利息总额	2,334.84	-
减：交易费用	139.62	-
买卖债券差价收入	1,653,350.63	-

7.4.7.12 资产支持证券投资收益

无。

7.4.7.13 衍生工具收益

7.4.7.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

7.4.7.13.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

7.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年9月15日（基金合同生效日）至2021年12月31日
股票投资产生的股利收益	3,433,259.50	-
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	3,433,259.50	-

7.4.7.15 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12月31日	上年度可比期间 2021年9月15日（基金合同生效日）至2021年12月31日
1.交易性金融资产	-66,961,573.24	-7,968,631.61
——股票投资	-66,961,573.24	-7,968,631.61
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	-	-
——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	-66,961,573.24	-7,968,631.61

7.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年9月15日（基金合同生效日）至2021年12月31日
基金赎回费收入	2,635,428.53	372,541.02
合计	2,635,428.53	372,541.02

7.4.7.17 信用减值损失

无。

7.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年9月15日（基金合同生效日）至2021年12月31日
审计费用	60,000.00	50,000.00
信息披露费	120,000.00	40,000.00
证券出借违约金	-	-
银行费用	31,083.34	4,363.20
证券组合费	676.10	-
其他	400.00	865,990.60
合计	212,159.44	960,353.80

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无或有事项。

7.4.8.2 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。

7.4.9 关联方关系

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
POWER CORPORATION OF CANADA	基金管理人的股东
MACKENZIE FINANCIAL CORPORATION	基金管理人的股东
天津海鹏科技咨询有限公司	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(山东)有限责任公司（“中信证券（山东）”）	基金管理人第一大股东的子公司
中信证券华南股份有限公司（“中信证券（华南）”）	基金管理人第一大股东的子公司

注：①根据华夏基金管理有限公司于 2023 年 1 月 6 日发布的公告，华夏基金管理有限公司股权结构变更为中信证券（出资比例 62.2%）、MACKENZIE FINANCIAL CORPORATION（出资比例 27.8%）、天津海鹏科技咨询有限公司（出资比例 10%）。

②下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 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12月31日		上年度可比期间 2021年9月15日（基金合同生效日）至2021年12月31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	7,959,661,410.70	69.74%	681,373,720.57	100.00%

7.4.10.1.2 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12月31日		上年度可比期间 2021年9月15日（基金合同生效日）至2021年12月31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	4,567,721.55	69.72%	-	-

7.4.10.1.3 债券回购交易

无。

7.4.10.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 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	6,394,448.59	73.58%	887,561.40	35.92%
关联方名称	上年度可比期间 2021 年 9 月 15 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 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	634,563.36	100.00%	168,767.52	100.00%

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 9 月 15 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	14,945,644.37	998,663.41
其中：支付销售机构的客户维护费	2,904,949.33	212,407.90

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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 9 月 15 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	2,490,940.79	166,443.88

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。

7.4.10.2.3 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12月31日 当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华夏新能源车龙头混合 发起式 A	华夏新能源车龙头混合 发起式 C	合计
华夏 基金 管理 有限 公司	-	1,705,432.69	1,705,432.69
华夏 财富	-	214,490.87	214,490.87
招商 银行	-	118,079.84	118,079.84
中信 证券	-	8,556.87	8,556.87
中信 证券 (山 东)	-	4,123.18	4,123.18
中信 证券 (华 南)	-	59.65	59.65
合计	-	2,050,743.10	2,050,743.10
获得 销售 服务 费的 各关 联方 名称	上年度可比期间 2021年9月15日（基金合同生效日）至2021年12月31日 当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华夏新能源车龙头混合 发起式 A	华夏新能源车龙头混合 发起式 C	合计
华夏 基金 管理 有限 公司	-	32,866.22	32,866.22
招商 银行	-	13,050.93	13,050.93

华夏财富	-	339.31	339.31
中信证券 (山东)	-	134.41	134.41
中信证券	-	70.72	70.72
中信证券 (华南)	-	10.90	10.90
合计	-	46,472.49	46,472.49

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 0.60% 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 × 0.60% / 当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.10.4 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

7.4.10.4.1 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。

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 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12月31日		上年度可比期间 2021年9月15日（基金合同生效日） 至2021年12月31日	
	华夏新能源车龙头 混合发起式A	华夏新能源车龙头 混合发起式C	华夏新能源车龙头 混合发起式A	华夏新能源车龙头 混合发起式C
基金合同生效日 (2021年9月15日)持有的基金份额	-	-	10,001,800.18	-
期初持有的基金份额	10,001,800.18	-	-	-

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	10,001,800.18	-	10,001,800.18	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.39%	-	4.66%	-

7.4.10.5.2 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。

7.4.10.6 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12月31日		上年度可比期间 2021年9月15日（基金合同生效日） 至2021年12月31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	122,796,799.67	311,749.15	26,618,442.23	43,702.90

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。

7.4.10.7 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 12 月 31 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	688041	海光信息	新股发行	23,623	850,428.00
中信证券	688382	益方生物	新股发行	36,208	656,088.96
中信证券	688271	联影医疗	新股发行	5,966	655,544.08
中信证券	688302	海创药业	新股发行	13,082	561,479.44
中信证券	688326	经纬恒润	新股发行	3,871	468,391.00
中信证券	688114	华大智造	新股发行	5,336	465,192.48
中信证券	688061	灿瑞科技	新股发行	3,839	432,616.91
中信证券	301109	军信股份	新股发行	12,250	426,422.50
中信证券	688380	中微半导	新股发行	12,677	391,212.22
中信证券	301269	华大九天	新股发行	11,677	381,721.13
中信证券	688141	杰华特	新股发行	9,946	380,533.96
中信证券	301165	锐捷网络	新股发行	10,769	348,700.22
中信证券	301349	信德新材	新股发行	1,798	249,706.24
中信证券	301302	华如科技	新股发行	4,651	241,991.53
中信证券	301200	大族数控	新股发行	3,083	236,034.48
中信证券	688223	晶科能源	新股发行	44,091	220,455.00
中信证券	301335	天元宠物	新股发行	4,192	209,516.16
中信证券	688432	有研硅	新股发行	20,044	198,636.04
中信证券	688370	从麟科技	新股发行	3,254	194,459.04
中信证券	688426	康为世纪	新股发行	3,776	184,948.48

中信证券	301171	易点天下	新股发行	9,845	178,982.10
中信证券	301377	鼎泰高科	新股发行	7,695	176,061.60
中信证券	688150	莱特光电	新股发行	5,626	124,053.30
中信证券	688252	天德钰	新股发行	5,201	112,757.68
中信证券	301230	泓博医药	新股发行	2,687	107,480.00
中信证券	688290	景业智能	新股发行	3,040	103,025.60
中信证券	688525	佰维存储	新股发行	4,614	64,549.86
中信证券	600938	中国海油	新股发行	3,000	32,400.00
中信证券	603235	天新药业	新股发行	572	21,095.36
中信证券	001322	箭牌家居	新股发行	1,595	20,224.60
中信证券	001330	博纳影业	新股发行	3,564	17,926.92
中信证券	603132	金徽股份	新股发行	1,342	14,493.60
中信证券	001339	智微智能	新股发行	812	13,690.32
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	603151	邦基科技	新股发行	535	9,603.25
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 9 月 15 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 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	688176	亚虹医药	新股发行	10,944	251,493.12
中信证券	688192	迪哲医药	新股发行	2,231	117,305.98
中信证券	600941	中国移动	新股发行	1,000	57,580.00
中信证券	603071	物产环能	新股发行	1,627	25,088.34
中信证券	600935	华塑股份	新股发行	4,811	18,955.34

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

7.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配事项。

7.4.12 期末（2022 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
605111	新洁	2022-	6 个月	非	110.00	75.64	218,182	24,000,020.00	16,503,286.48	-

	能	08-12		公开发 行流通 受限						
688506	百利 天恒	2022- 12-28	1 个月 内 (含)	新发流 通受限	24.70	24.70	15,622	385,863.40	385,863.40	-
688293	奥浦 迈	2022- 08-26	6 个月	新发流 通受限	80.20	99.12	2,452	196,650.40	243,042.24	-
688496	清越 科技	2022- 12-21	6 个月	新发流 通受限	9.16	8.65	12,000	109,920.00	103,800.00	-
301269	华大 九天	2022- 07-21	6 个月	新发流 通受限	32.69	87.94	1,168	38,181.92	102,713.92	-
688252	天德 钰	2022- 09-20	6 个月	新发流 通受限	21.68	15.78	5,201	112,757.68	82,071.78	-
301095	广立 微	2022- 07-28	6 个月	新发流 通受限	58.00	86.49	740	42,920.00	64,002.60	-
301267	华夏 眼科	2022- 10-26	6 个月	新发流 通受限	50.88	66.20	843	42,891.84	55,806.60	-
301308	江波	2022-	6 个月	新	55.67	56.72	819	45,593.73	46,453.68	-

	龙	07-27		发 流 通 受 限						
301327	华宝 新能	2022- 09-08	6 个月	新 发 流 通 受 限	237.50	176.97	242	57,475.00	42,826.74	-
301165	锐捷 网络	2022- 11-14	6 个月	新 发 流 通 受 限	32.38	31.61	1,077	34,873.26	34,043.97	-
301356	天振 股份	2022- 11-03	6 个月	新 发 流 通 受 限	63.00	43.33	614	38,682.00	26,604.62	-
301195	北路 智控	2022- 07-25	6 个月	新 发 流 通 受 限	71.17	73.04	330	23,486.10	24,103.20	-
301389	隆扬 电子	2022- 10-18	6 个月	新 发 流 通 受 限	22.50	17.16	1,269	28,552.50	21,776.04	-
301330	熵基 科技	2022- 08-10	6 个月	新 发 流 通 受 限	43.32	31.31	694	30,064.08	21,729.14	-
301152	天力 锂能	2022- 08-19	6 个月	新 发 流 通 受 限	57.00	46.64	433	24,681.00	20,195.12	-
301391	卡莱 特	2022- 11-24	6 个月	新 发 流 通	96.00	80.97	247	23,712.00	19,999.59	-

				受 限						
301349	信德 新材	2022- 08-30	6 个月	新发 流通 受限	138.88	103.52	180	24,998.40	18,633.60	-
301171	易点 天下	2022- 08-10	6 个月	新发 流通 受限	18.18	17.72	985	17,907.30	17,454.20	-
301363	美好 医疗	2022- 09-28	6 个月	新发 流通 受限	30.66	37.85	445	13,643.70	16,843.25	-
301115	建科 股份	2022- 08-23	6 个月	新发 流通 受限	42.05	24.04	685	28,804.25	16,467.40	-
301223	中荣 股份	2022- 10-13	6 个月	新发 流通 受限	26.28	18.13	815	21,418.20	14,775.95	-
301328	维峰 电子	2022- 08-30	6 个月	新发 流通 受限	78.80	76.96	191	15,050.80	14,699.36	-
301121	紫建 电子	2022- 08-01	6 个月	新发 流通 受限	61.07	49.77	290	17,710.30	14,433.30	-
301139	元道 通信	2022- 06-30	6 个月	新发 流通 受限	38.46	25.31	566	21,768.36	14,325.46	-
301335	天元	2022-	6 个月	新	49.98	33.82	420	20,991.60	14,204.40	-

	宠物	11-11		发 流 通 受 限						
301377	鼎泰 高科	2022- 11-11	6 个月	新发 流 通 受 限	22.88	17.63	770	17,617.60	13,575.10	-
301230	泓博 医药	2022- 10-21	6 个月	新发 流 通 受 限	40.00	48.32	269	10,760.00	12,998.08	-
301396	宏景 科技	2022- 11-04	6 个月	新发 流 通 受 限	40.13	31.90	396	15,891.48	12,632.40	-
301338	凯格 精机	2022- 08-08	6 个月	新发 流 通 受 限	46.33	48.99	257	11,906.81	12,590.43	-
301280	珠城 科技	2022- 12-19	6 个月	新发 流 通 受 限	67.40	44.80	279	18,804.60	12,499.20	-
301365	矩阵 股份	2022- 11-14	6 个月	新发 流 通 受 限	34.72	23.87	516	17,915.52	12,316.92	-
301366	一博 科技	2022- 09-19	6 个月	新发 流 通 受 限	65.35	45.09	268	17,513.80	12,084.12	-
301283	聚胶 股份	2022- 08-26	6 个月	新发 流 通	52.69	51.41	235	12,382.15	12,081.35	-

				受限						
301132	满坤科技	2022-08-03	6 个月	新发流通受限	26.80	24.48	468	12,542.40	11,456.64	-
301277	新天地	2022-11-09	6 个月	新发流通受限	27.00	25.78	439	11,853.00	11,317.42	-
301379	天山电子	2022-10-19	6 个月	新发流通受限	31.51	24.63	449	14,147.99	11,058.87	-
301306	西测测试	2022-07-19	6 个月	新发流通受限	43.23	42.29	255	11,023.65	10,783.95	-
301273	瑞晨环保	2022-10-11	6 个月	新发流通受限	37.89	37.79	277	10,495.53	10,467.83	-
301265	华新环保	2022-12-08	6 个月	新发流通受限	13.28	11.40	819	10,876.32	9,336.60	-
301176	逸豪新材	2022-09-21	6 个月	新发流通受限	23.88	16.89	544	12,990.72	9,188.16	-
301318	维海德	2022-08-03	6 个月	新发流通受限	64.68	41.74	206	13,324.08	8,598.44	-
301326	捷邦	2022-	6 个月	新	51.72	36.62	227	11,740.44	8,312.74	-

	科技	09-09		发 流 通 受 限						
301398	星源卓镁	2022-12-08	6 个月	新发 流 通 受 限	34.40	28.94	255	8,772.00	7,379.70	-
301313	凡拓数创	2022-09-22	6 个月	新发 流 通 受 限	25.25	29.14	247	6,236.75	7,197.58	-
301276	嘉曼服饰	2022-09-01	6 个月	新发 流 通 受 限	40.66	22.61	303	12,319.98	6,850.83	-
301388	欣灵电气	2022-10-26	6 个月	新发 流 通 受 限	25.88	21.60	292	7,556.96	6,307.20	-
301368	丰立智能	2022-12-07	6 个月	新发 流 通 受 限	22.33	18.52	337	7,525.21	6,241.24	-
301319	唯特偶	2022-09-22	6 个月	新发 流 通 受 限	47.75	53.27	115	5,491.25	6,126.05	-
301270	汉仪股份	2022-08-19	6 个月	新发 流 通 受 限	25.68	28.37	210	5,392.80	5,957.70	-
301309	万得凯	2022-09-08	6 个月	新发 流 通	39.00	24.46	228	8,892.00	5,576.88	-

				受限						
301316	慧博云通	2022-09-29	6 个月	新发流通受限	7.60	14.32	359	2,728.40	5,140.88	-

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。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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。

7.4.13.2 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。

7.4.13.3 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“7.4.12 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。

7.4.13.3.1 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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 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	1,413,757,513.25	92.66	339,870,495.68	92.60
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
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	1,413,757,513.25	92.66	339,870,495.68	92.60

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。

7.4.13.4.3.2 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 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
	-5%	-62,440,115.41	-24,804,030.65
	+5%	62,440,115.41	24,804,030.65

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 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 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	1,395,569,280.90	339,768,247.76
第二层次	385,863.40	102,247.92
第三层次	17,802,368.95	-
合计	1,413,757,513.25	339,870,495.68

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券等投资，若出现交易不活跃（包括重大事项停牌、境内证券涨跌停等导致的交易不活跃）和非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。本基金政策以导致各层次之间转换的事项发生日作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	24,000,020.00	24,000,020.00
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	1,329,435.86	1,329,435.86
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	-7,527,086.91	-7,527,086.91
其中：计入损益的利得或损失	-	-7,527,086.91	-7,527,086.91
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	17,802,368.95	17,802,368.95
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-7,527,086.91	-7,527,086.91

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	17,802,368.95	平均价格亚式期权模型	预期年化波动率	0.1891-2.4756	负相关

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

截至 2022 年 12 月 31 日止，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

7.4.14.4 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。

7.4.15 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。

§8 投资组合报告

8.1 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	1,413,757,513.25	91.71
	其中：股票	1,413,757,513.25	91.71
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	126,539,701.76	8.21
8	其他各项资产	1,185,200.25	0.08
9	合计	1,541,482,415.26	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,322,098,930.34	86.65
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	21,366,620.00	1.40
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	467,953.08	0.03
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	69,622,421.79	4.56
N	水利、环境和公共设施管理业	145,781.44	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	55,806.60	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,413,757,513.25	92.66

8.3 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	300750	宁德时代	319,000	125,500,980.00	8.23
2	603659	璞泰来	2,148,922	111,507,562.58	7.31

3	600522	中天科技	5,094,700	82,279,405.00	5.39
4	002709	天赐材料	1,752,400	76,860,264.00	5.04
5	300014	亿纬锂能	816,877	71,803,488.30	4.71
6	300274	阳光电源	614,986	68,755,434.80	4.51
7	002531	天顺风能	4,466,300	67,575,119.00	4.43
8	688226	威腾电气	2,371,416	62,273,384.16	4.08
9	300037	新宙邦	1,353,000	58,814,910.00	3.85
10	002837	英维克	1,733,788	57,752,478.28	3.79
11	600875	东方电气	2,612,325	54,911,071.50	3.60
12	002965	祥鑫科技	885,700	51,556,597.00	3.38
13	688248	南网科技	850,942	48,588,788.20	3.18
14	002812	恩捷股份	343,600	45,111,244.00	2.96
15	601636	旗滨集团	3,896,800	44,384,552.00	2.91
16	002594	比亚迪	142,600	36,643,922.00	2.40
17	601689	拓普集团	534,389	31,304,507.62	2.05
18	301031	中熔电气	186,100	30,332,439.00	1.99
19	603055	台华新材	2,672,894	26,996,229.40	1.77
20	603596	伯特利	296,400	23,652,720.00	1.55
21	601222	林洋能源	2,745,900	23,587,281.00	1.55
22	603997	继峰股份	1,485,568	22,699,479.04	1.49
23	300982	苏文电能	433,400	21,366,620.00	1.40
24	301046	能辉科技	598,500	20,738,025.00	1.36
25	605111	新洁能	245,848	18,649,614.76	1.22
26	688663	新风光	385,766	16,973,704.00	1.11
27	605068	明新旭腾	569,098	16,885,137.66	1.11
28	300693	盛弘股份	303,000	16,446,840.00	1.08
29	002850	科达利	129,800	15,421,538.00	1.01
30	603032	德新科技	131,200	11,514,112.00	0.75
31	301327	华宝新能	56,098	10,557,718.74	0.69
32	688390	固德威	29,171	9,424,858.39	0.62
33	603876	鼎胜新材	201,600	8,273,664.00	0.54
34	300680	隆盛科技	314,100	7,777,116.00	0.51
35	000792	盐湖股份	206,800	4,692,292.00	0.31
36	002270	华明装备	558,650	4,301,605.00	0.28
37	603606	东方电缆	31,975	2,168,864.25	0.14
38	688778	厦钨新能	27,355	2,124,936.40	0.14
39	603063	禾望电气	23,300	649,604.00	0.04
40	688120	华海清科	2,712	608,979.60	0.04
41	688506	百利天恒	15,622	385,863.40	0.03
42	688293	奥浦迈	2,452	243,042.24	0.02
43	301330	熵基科技	6,937	222,941.03	0.01
44	688130	晶华微	3,112	132,353.36	0.01
45	301127	天源环保	12,222	116,720.10	0.01
46	688496	清越科技	12,000	103,800.00	0.01
47	301269	华大九天	1,168	102,713.92	0.01
48	688252	天德钰	5,201	82,071.78	0.01
49	688416	恒烁股份	2,147	81,607.47	0.01
50	001301	尚太科技	1,164	68,722.56	0.00
51	301095	广立微	740	64,002.60	0.00
52	301267	华夏眼科	843	55,806.60	0.00

53	301308	江波龙	819	46,453.68	0.00
54	301165	锐捷网络	1,077	34,043.97	0.00
55	301109	军信股份	1,837	29,061.34	0.00
56	301356	天振股份	614	26,604.62	0.00
57	301195	北路智控	330	24,103.20	0.00
58	301389	隆扬电子	1,269	21,776.04	0.00
59	301152	天力锂能	433	20,195.12	0.00
60	301391	卡莱特	247	19,999.59	0.00
61	301349	信德新材	180	18,633.60	0.00
62	301171	易点天下	985	17,454.20	0.00
63	301363	美好医疗	445	16,843.25	0.00
64	301115	建科股份	685	16,467.40	0.00
65	301223	中荣股份	815	14,775.95	0.00
66	301328	维峰电子	191	14,699.36	0.00
67	301121	紫建电子	290	14,433.30	0.00
68	301139	元道通信	566	14,325.46	0.00
69	301335	天元宠物	420	14,204.40	0.00
70	301377	鼎泰高科	770	13,575.10	0.00
71	301230	泓博医药	269	12,998.08	0.00
72	301396	宏景科技	396	12,632.40	0.00
73	301338	凯格精机	257	12,590.43	0.00
74	301280	珠城科技	279	12,499.20	0.00
75	301365	矩阵股份	516	12,316.92	0.00
76	301200	大族数控	309	12,112.80	0.00
77	301366	一博科技	268	12,084.12	0.00
78	301283	聚胶股份	235	12,081.35	0.00
79	301132	满坤科技	468	11,456.64	0.00
80	301277	新天地	439	11,317.42	0.00
81	301379	天山电子	449	11,058.87	0.00
82	301306	西测测试	255	10,783.95	0.00
83	301273	瑞晨环保	277	10,467.83	0.00
84	301265	华新环保	819	9,336.60	0.00
85	301176	逸豪新材	544	9,188.16	0.00
86	301318	维海德	206	8,598.44	0.00
87	301326	捷邦科技	227	8,312.74	0.00
88	301398	星源卓镁	255	7,379.70	0.00
89	301313	凡拓数创	247	7,197.58	0.00
90	301276	嘉曼服饰	303	6,850.83	0.00
91	301279	金道科技	296	6,517.92	0.00
92	301388	欣灵电气	292	6,307.20	0.00
93	301368	丰立智能	337	6,241.24	0.00
94	301319	唯特偶	115	6,126.05	0.00
95	301270	汉仪股份	210	5,957.70	0.00
96	301309	万得凯	228	5,576.88	0.00
97	301316	慧博云通	359	5,140.88	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	002709	天赐材料	222,147,537.07	60.53
2	300274	阳光电源	173,306,987.32	47.22
3	300014	亿纬锂能	165,667,826.95	45.14
4	002594	比亚迪	158,096,418.88	43.08
5	603659	璞泰来	151,432,016.57	41.26
6	300750	宁德时代	146,856,414.58	40.01
7	002812	恩捷股份	134,391,338.89	36.62
8	002466	天齐锂业	123,221,721.06	33.57
9	603596	伯特利	118,002,664.40	32.15
10	002129	TCL 中环	115,467,778.40	31.46
11	002756	永兴材料	113,637,982.12	30.96
12	600522	中天科技	107,812,479.38	29.37
13	605111	新洁能	98,950,253.65	26.96
14	600438	通威股份	96,567,359.22	26.31
15	000792	盐湖股份	93,474,758.59	25.47
16	300037	新宙邦	93,325,284.10	25.43
17	002920	德赛西威	89,824,372.72	24.47
18	603806	福斯特	89,227,460.29	24.31
19	600875	东方电气	87,531,827.70	23.85
20	002837	英维克	87,371,756.81	23.81
21	002984	森麒麟	84,972,554.30	23.15
22	002460	赣锋锂业	83,825,624.62	22.84
23	603799	华友钴业	83,430,593.84	22.73
24	603179	新泉股份	82,239,549.21	22.41
25	601799	星宇股份	81,151,905.83	22.11
26	603997	继峰股份	79,032,198.08	21.53
27	688226	威腾电气	76,153,172.36	20.75
28	688390	固德威	75,558,632.25	20.59
29	601126	四方股份	68,609,768.13	18.69
30	688116	天奈科技	68,477,000.87	18.66
31	688248	南网科技	67,195,598.28	18.31
32	000625	长安汽车	64,460,278.86	17.56
33	300679	电连技术	63,379,670.01	17.27
34	000988	华工科技	63,194,496.00	17.22
35	002531	天顺风能	61,781,229.86	16.83
36	300073	当升科技	60,979,250.90	16.61
37	688778	厦钨新能	57,246,816.24	15.60
38	688599	天合光能	57,237,452.21	15.60
39	300693	盛弘股份	57,052,583.00	15.54
40	300432	富临精工	54,456,808.62	14.84
41	601669	中国电建	54,320,927.00	14.80
42	601633	长城汽车	53,250,643.67	14.51
43	002965	祥鑫科技	53,219,875.01	14.50
44	300627	华测导航	53,111,901.06	14.47
45	002245	蔚蓝锂芯	52,709,845.68	14.36
46	002850	科达利	51,824,074.21	14.12
47	601012	隆基绿能	51,556,007.90	14.05

48	603568	伟明环保	51,302,823.95	13.98
49	600549	厦门钨业	50,511,440.60	13.76
50	601689	拓普集团	49,659,023.75	13.53
51	00175	吉利汽车	48,528,719.11	13.22
52	603985	恒润股份	47,962,737.58	13.07
53	603606	东方电缆	45,385,757.81	12.37
54	002459	晶澳科技	45,087,448.02	12.28
55	600884	杉杉股份	44,361,520.08	12.09
56	600660	福耀玻璃	42,987,308.66	11.71
57	300712	永福股份	42,595,178.51	11.61
58	603876	鼎胜新材	41,570,208.42	11.33
59	601636	旗滨集团	40,833,657.31	11.13
60	601369	陕鼓动力	40,346,323.80	10.99
61	002101	广东鸿图	40,323,603.66	10.99
62	002753	永东股份	39,023,419.70	10.63
63	688598	金博股份	38,958,436.37	10.61
64	002518	科士达	38,868,897.01	10.59
65	301289	国缆检测	38,762,143.20	10.56
66	300443	金雷股份	37,983,099.00	10.35
67	301155	海力风电	37,953,226.00	10.34
68	688663	新风光	36,513,552.96	9.95
69	600933	爱柯迪	34,040,035.00	9.27
70	605068	明新旭腾	33,799,283.64	9.21
71	600499	科达制造	33,302,375.87	9.07
72	688408	中信博	32,834,034.84	8.95
73	300035	中科电气	32,272,284.00	8.79
74	002824	和胜股份	32,175,122.00	8.77
75	301031	中熔电气	31,860,191.00	8.68
76	603055	台华新材	31,145,064.18	8.49
77	601058	赛轮轮胎	30,311,820.88	8.26
78	002335	科华数据	30,199,600.04	8.23
79	300568	星源材质	29,285,878.65	7.98
80	688005	容百科技	27,725,669.64	7.55
81	603239	浙江仙通	27,368,498.12	7.46
82	688326	经纬恒润	27,238,064.25	7.42
83	300207	欣旺达	27,031,569.00	7.37
84	605117	德业股份	26,893,635.06	7.33
85	603197	保隆科技	26,842,750.42	7.31
86	603348	文灿股份	26,840,730.96	7.31
87	600973	宝胜股份	26,566,516.00	7.24
88	601222	林洋能源	26,092,534.00	7.11
89	300337	银邦股份	26,081,909.80	7.11
90	300827	上能电气	26,063,670.40	7.10
91	603501	韦尔股份	26,040,942.83	7.10
92	000657	中钨高新	25,200,455.57	6.87
93	603063	禾望电气	25,072,388.00	6.83
94	688033	天宜上佳	23,061,226.90	6.28
95	000059	华锦股份	22,403,641.96	6.10
96	300982	苏文电能	21,827,432.69	5.95
97	002270	华明装备	21,688,778.79	5.91

98	002121	科陆电子	21,570,111.00	5.88
99	300450	先导智能	21,209,774.00	5.78
100	301046	能辉科技	20,747,665.02	5.65
101	600741	华域汽车	18,872,720.00	5.14
102	301327	华宝新能	18,611,174.11	5.07
103	688039	当虹科技	18,438,965.87	5.02
104	300394	天孚通信	17,537,577.40	4.78
105	605305	中际联合	16,707,221.00	4.55
106	002080	中材科技	14,984,321.42	4.08
107	601865	福莱特	14,773,211.46	4.03
108	688303	大全能源	14,720,353.02	4.01
109	300769	德方纳米	13,789,630.24	3.76
110	300680	隆盛科技	13,416,344.00	3.66
111	605128	上海沿浦	13,384,842.00	3.65
112	002130	沃尔核材	13,098,181.00	3.57
113	605286	同力日升	12,767,149.18	3.48
114	600487	亨通光电	12,409,223.17	3.38
115	002074	国轩高科	11,351,615.00	3.09
116	603032	德新科技	11,021,926.00	3.00
117	300360	炬华科技	10,120,528.55	2.76
118	000751	锌业股份	9,861,494.41	2.69
119	003022	联泓新科	9,653,993.00	2.63
120	688388	嘉元科技	8,977,593.77	2.45
121	601238	广汽集团	8,272,413.00	2.25
122	688680	海优新材	7,387,047.22	2.01

注：“买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 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	300274	阳光电源	130,654,469.94	35.60
2	002709	天赐材料	126,790,910.71	34.55
3	002594	比亚迪	123,010,626.88	33.52
4	002466	天齐锂业	118,415,766.94	32.26
5	002129	TCL 中环	116,755,639.47	31.81
6	000792	盐湖股份	109,437,209.94	29.82
7	002756	永兴材料	108,967,602.65	29.69
8	600438	通威股份	107,263,877.02	29.23
9	603799	华友钴业	101,773,577.27	27.73
10	603596	伯特利	98,200,623.91	26.76
11	603179	新泉股份	96,137,818.11	26.19
12	603806	福斯特	92,770,057.55	25.28
13	300014	亿纬锂能	91,751,462.08	25.00
14	002812	恩捷股份	91,295,189.66	24.87
15	002984	森麒麟	90,023,651.15	24.53
16	002920	德赛西威	89,229,190.21	24.31
17	688116	天奈科技	85,315,037.55	23.25

18	002460	赣锋锂业	82,918,620.04	22.59
19	601799	星宇股份	77,047,190.70	20.99
20	601126	四方股份	71,962,232.88	19.61
21	605111	新洁能	70,882,100.20	19.31
22	688390	固德威	68,599,990.43	18.69
23	300679	电连技术	68,518,285.47	18.67
24	300432	富临精工	61,236,503.02	16.68
25	000625	长安汽车	59,041,144.56	16.09
26	603997	继峰股份	58,787,821.50	16.02
27	300073	当升科技	58,088,106.00	15.83
28	601012	隆基绿能	57,777,547.40	15.74
29	300693	盛弘股份	57,655,342.55	15.71
30	605117	德业股份	56,540,548.12	15.41
31	000988	华工科技	56,004,862.52	15.26
32	002518	科士达	55,686,852.35	15.17
33	601669	中国电建	52,860,951.00	14.40
34	002850	科达利	52,593,264.19	14.33
35	600884	杉杉股份	52,063,713.89	14.19
36	603568	伟明环保	50,852,787.84	13.86
37	688598	金博股份	50,091,611.88	13.65
38	603876	鼎胜新材	50,010,146.00	13.63
39	300035	中科电气	49,083,783.36	13.37
40	002459	晶澳科技	48,229,729.39	13.14
41	601633	长城汽车	47,741,966.93	13.01
42	600549	厦门钨业	46,027,000.01	12.54
43	600660	福耀玻璃	45,942,780.72	12.52
44	002245	蔚蓝锂芯	45,908,513.92	12.51
45	688599	天合光能	45,371,358.29	12.36
46	688005	容百科技	45,150,862.06	12.30
47	301155	海力风电	43,829,089.05	11.94
48	688408	中信博	43,716,552.53	11.91
49	300627	华测导航	43,280,425.63	11.79
50	002824	和胜股份	40,685,580.92	11.09
51	601369	陕鼓动力	40,208,273.00	10.96
52	603985	恒润股份	39,847,465.16	10.86
53	00175	吉利汽车	38,753,520.42	10.56
54	600875	东方电气	38,682,282.00	10.54
55	603606	东方电缆	38,219,546.97	10.41
56	300450	先导智能	38,191,716.04	10.41
57	002101	广东鸿图	37,336,311.82	10.17
58	688778	厦钨新能	36,739,779.14	10.01
59	300712	永福股份	36,016,515.00	9.81
60	300443	金雷股份	35,082,376.00	9.56
61	301289	国缆检测	34,661,330.16	9.44
62	601058	赛轮轮胎	33,402,824.46	9.10
63	300037	新宙邦	33,262,619.86	9.06
64	603659	璞泰来	32,886,776.42	8.96
65	300568	星源材质	32,383,572.01	8.82
66	002837	英维克	32,374,159.20	8.82
67	688226	威腾电气	31,743,999.91	8.65

68	002335	科华数据	31,629,423.28	8.62
69	600933	爱柯迪	31,519,715.70	8.59
70	002753	永东股份	31,332,395.36	8.54
71	688663	新风光	29,604,348.48	8.07
72	603239	浙江仙通	28,919,221.88	7.88
73	300827	上能电气	28,709,170.22	7.82
74	600499	科达制造	28,524,595.12	7.77
75	300337	银邦股份	27,604,193.00	7.52
76	603197	保隆科技	27,138,081.51	7.39
77	300207	欣旺达	26,732,782.52	7.28
78	000657	中钨高新	24,918,181.00	6.79
79	603501	韦尔股份	24,914,621.00	6.79
80	603063	禾望电气	24,835,106.73	6.77
81	002121	科陆电子	24,711,630.00	6.73
82	603348	文灿股份	24,213,599.00	6.60
83	300750	宁德时代	23,364,234.92	6.37
84	688326	经纬恒润	22,728,551.85	6.19
85	600973	宝胜股份	21,108,292.65	5.75
86	688248	南网科技	20,802,229.06	5.67
87	300394	天孚通信	20,339,136.03	5.54
88	600741	华域汽车	20,215,739.00	5.51
89	688033	天宜上佳	19,465,363.35	5.30
90	000059	华锦股份	19,416,490.00	5.29
91	688303	大全能源	19,221,893.72	5.24
92	002270	华明装备	15,936,849.00	4.34
93	601865	福莱特	15,755,075.00	4.29
94	300769	德方纳米	15,598,935.28	4.25
95	605305	中际联合	15,263,907.00	4.16
96	688039	当虹科技	15,090,109.67	4.11
97	605286	同力日升	14,966,701.80	4.08
98	605068	明新旭腾	13,958,591.00	3.80
99	002080	中材科技	13,696,295.00	3.73
100	600522	中天科技	13,358,346.00	3.64
101	300360	炬华科技	13,078,727.48	3.56
102	605128	上海沿浦	12,750,285.57	3.47
103	002130	沃尔核材	12,066,779.40	3.29
104	601689	拓普集团	11,857,686.35	3.23
105	600487	亨通光电	10,221,857.80	2.79
106	000751	锌业股份	9,800,015.34	2.67
107	601238	广汽集团	9,693,150.00	2.64
108	688388	嘉元科技	9,021,219.96	2.46
109	002074	国轩高科	8,864,250.94	2.42
110	003022	联泓新科	8,428,799.00	2.30
111	688680	海优新材	8,397,419.62	2.29
112	603051	鹿山新材	8,370,866.00	2.28

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。

8.4.3 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	6,347,143,923.16
卖出股票收入（成交）总额	5,131,075,014.99

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。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

8.6 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

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 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。

8.11.2 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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。

8.12.2 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。

8.12.3 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	710,469.97
2	应收清算款	74,390.85
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	400,339.43

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,185,200.25

8.12.4 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。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8.12.6 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。

9 基金份额持有人信息

9.1 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
华夏新能源车龙头混合发起式 A	16,813	42,872.32	421,460,580.49	58.47%	299,351,717.74	41.53%
华夏新能源车龙头混合发起式 C	19,310	50,690.28	790,788,695.52	80.79%	188,040,668.59	19.21%
合计	36,123	47,051.51	1,212,249,276.01	71.32%	487,392,386.33	28.68%

9.2 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	华夏新能源车龙头混合发起式 A	7,148,335.94	0.99%
	华夏新能源车龙头混合发起式 C	1,634,773.35	0.17%
	合计	8,783,109.29	0.52%

9.3 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	华夏新能源车龙头混合发起式 A	>100
	华夏新能源车龙头混合发起式 C	0
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式	华夏新能源车龙头混合发起式	>100

基金	A	
	华夏新能源车龙头混合发起式 C	0
	合计	>100

9.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,001,800.18	0.59%	10,000,000.00	0.59%	不少于三年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,001,800.18	0.59%	10,000,000.00	0.59%	不少于三年

§10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华夏新能源车龙头混合发起式 A	华夏新能源车龙头混合发起式 C
基金合同生效日（2021 年 9 月 15 日）基金份额总额	76,198,553.17	39,427,903.26
本报告期期初基金份额总额	214,812,550.10	139,608,859.90
本报告期基金总申购份额	820,830,975.73	1,958,344,000.87
减：本报告期基金总赎回份额	314,831,227.60	1,119,123,496.66
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	720,812,298.23	978,829,364.11

§11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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。

自 2022 年 07 月 15 日起，孙乐女士担任招商银行股份有限公司资产托管部总经理职务。

11.3 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。

11.4 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。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期应支付给普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为 60,000 元人民币。截至本报告期末，该事务所已向本基金提供 2 年的审计服务。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人及其高级管理人员在本报告期内无受稽查或处罚等情况。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	11	7,959,661,410.70	69.74%	6,394,448.59	73.58%	-
中金公司	4	1,224,019,814.24	10.72%	790,683.99	9.10%	-
招商证券	6	834,555,731.89	7.31%	359,945.54	4.14%	-
江海证券	2	630,646,417.02	5.53%	461,193.65	5.31%	-
申万宏源证券	1	582,922,701.37	5.11%	545,527.55	6.28%	-
联储证券	2	119,462,700.25	1.05%	89,445.62	1.03%	-
华泰证券	2	44,194,220.05	0.39%	32,319.36	0.37%	-
中信建投证券	4	18,143,626.86	0.16%	16,897.63	0.19%	-

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，本基金还选择了财通证券、长江证券、东方证券、东吴证券、方正证券、光大证券、广发证券、国联证券、国泰君安证券、海通证券、华西证券、金元证券、平安证券、上海证券、西部证券、兴业证券、中泰证券、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、中信证券的部分交易单元、兴业证券的交易单元为本基金本期新增的交易单元。本期没有剔除的券商交易单元。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
中信证券	4,567,721.55	69.72%	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	1,984,103.54	30.28%	-	-	-	-	-	-
联储证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-	-	-

11.8 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
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	2022-03-19

	方承销证券的公告	网站	
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	2022-04-02
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	2022-04-08
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	2022-04-13
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	2022-04-19
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	2022-06-18
13	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
14	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
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	2022-07-07
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	2022-07-20
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	2022-07-23
18	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	2022-07-30
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	2022-08-06
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	2022-08-10
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	2022-08-12
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	2022-08-13
23	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资非公开发行股票的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-08-16
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	2022-08-19
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	2022-09-01
26	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	2022-09-03
27	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	2022-09-22
28	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	2022-10-14
29	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	2022-10-20
30	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	2022-10-22
31	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	2022-11-05
32	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	2022-11-12

33	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	2022-11-16
34	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	2022-11-26
35	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	2022-11-30
36	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	2022-12-16
37	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资非公开发行的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-12-17
38	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	2022-12-20
39	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	2022-12-23
40	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	2022-12-24

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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。

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予基金注册的文件；
- 2、《华夏新能源车龙头混合型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《华夏新能源车龙头混合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。

13.2 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。

13.3 查阅方式

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

华夏基金管理有限公司

二〇二三年三月三十日