

**华夏智胜价值成长股票型发起式
证券投资基金
2023 年中期报告
2023 年 6 月 30 日**

基金管理人：华夏基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二三年八月三十日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 8 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	1
§2 基金简介.....	3
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	4
3.1 主要会计数据和财务指标.....	4
3.2 基金净值表现.....	5
§4 管理人报告.....	7
§5 托管人报告.....	11
§6 中期报告财务会计报告（未经审计）.....	12
6.1 资产负债表.....	12
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.....	16
§7 投资组合报告.....	47
7.1 期末基金资产组合情况.....	47
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	47
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.....	48
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	68
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	71
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.....	71
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.....	71
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.....	71
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.....	71
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	71
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	71
7.12 投资组合报告附注.....	71
§8 基金份额持有人信息.....	72
§9 开放式基金份额变动.....	73
§10 重大事件揭示.....	73
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	76
§12 备查文件目录.....	76

§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	688,660,298.33 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	248,827,497.55 份	439,832,800.78 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。

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	张姗
	联系电话	400-818-6666	0755-83077987
	电子邮箱	service@ChinaAMC.com	zhangshan_1027@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

2.5 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/或基金托管人的住所/办公地址

2.6 其他相关资料

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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日）	
	华夏智胜价值成长股票 A	华夏智胜价值成长股票 C
本期已实现收益	13,869,792.39	40,498,497.29
本期利润	14,193,985.81	38,584,569.32
加权平均基金份额本期利润	0.1074	0.1008
本期加权平均净值利润率	6.92%	6.55%
本期基金份额净值增长率	11.08%	10.95%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 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	136,033,197.09	234,707,228.73
期末可供分配基金份额利润	0.5467	0.5336
期末基金资产净值	390,516,192.58	684,303,435.94
期末基金份额净值	1.5694	1.5558
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 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	62.55%	71.95%

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	1.23%	0.80%	-0.77%	0.89%	2.00%	-0.09%
过去三个月	0.14%	0.73%	-5.10%	0.78%	5.24%	-0.05%
过去六个月	11.08%	0.71%	2.20%	0.75%	8.88%	-0.04%
过去一年	8.76%	0.91%	-6.65%	0.91%	15.41%	0.00%
过去三年	49.52%	1.13%	9.74%	1.06%	39.78%	0.07%
自基金转型起至今	62.55%	1.22%	12.38%	1.14%	50.17%	0.08%

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	1.20%	0.80%	-0.77%	0.89%	1.97%	-0.09%
过去三个月	0.07%	0.73%	-5.10%	0.78%	5.17%	-0.05%
过去六个月	10.95%	0.71%	2.20%	0.75%	8.75%	-0.04%
过去一年	8.49%	0.91%	-6.65%	0.91%	15.14%	0.00%
过去三年	48.43%	1.13%	9.74%	1.06%	38.69%	0.07%
2019年12月24日起至今	71.95%	1.22%	14.95%	1.10%	57.00%	0.12%

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。

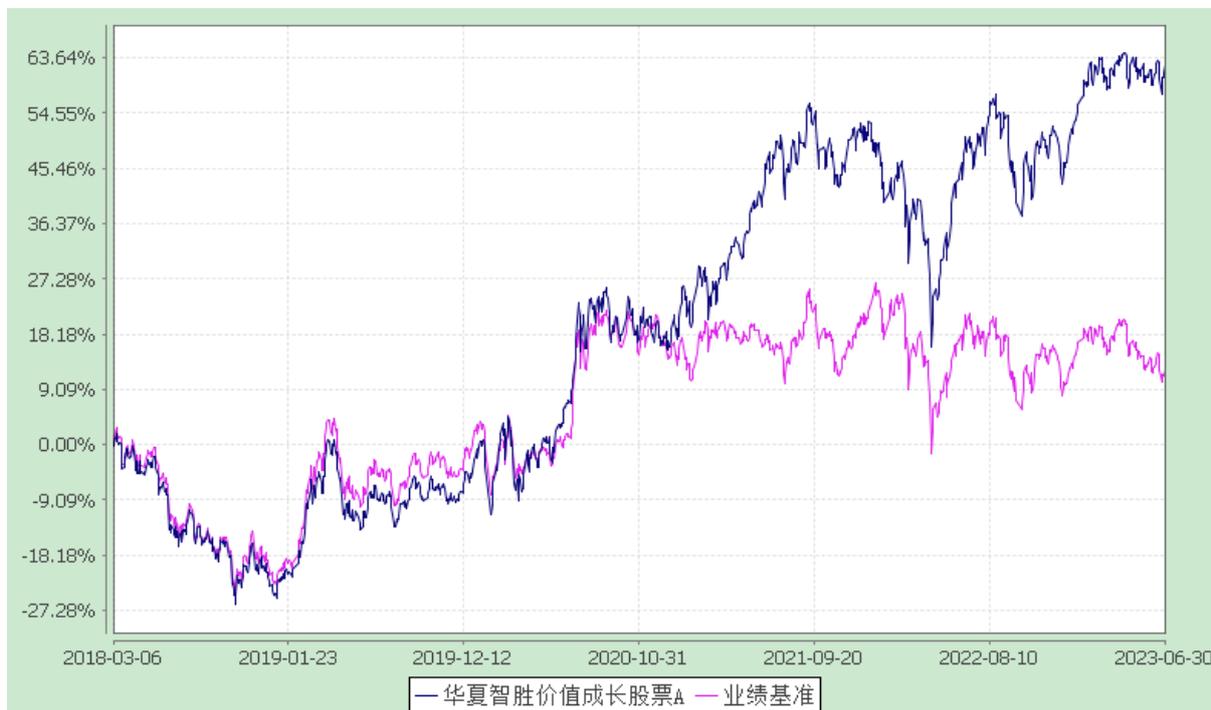
3.2.2 自基金转型以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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 2023 年 6 月 30 日)

华夏智胜价值成长股票 A



注：本基金自 2018 年 3 月 6 日起由“华夏新锦源灵活配置混合型证券投资基金”转型而来。

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、青岛、武汉、沈阳设有分公司,在香港、深圳、上海设有子公司。公司是首批全国社保基金管理人、首批企业年金基金管理人、境内首批 QDII 基金管理人、境内首只 ETF 基金管理人、境内首只沪港通 ETF 基金管理人、首批内地与香港基金互认基金管理人、首批基本养老保险基金投资管理人资格、首家加入联合国责任投资原则组织的公募基金公司、首批公募 FOF 基金管理人、首批公募养老目标基金管理人、首批个人养老金基金管理人、境内首批中日互通 ETF 基金管理人、首批商品期货 ETF 基金管理人、首批公募 MOM 基金管理人、首批纳入互联互通 ETF 基金管理人、首批北交所主题基金管理人以及特定客户资产管理人、保险资金投资管理人、公募 REITs 管理人,国内首家承诺“碳中和”具体目标和路径的公募基金公司,香港子公司是首批 RQFII 基金管理人。华夏基金是业务领域最广泛的基金管理公司之一。

华夏基金是境内 ETF 基金资产管理规模最大的基金管理公司之一,在 ETF 基金管理方面积累了丰富的经验,形成了覆盖大盘蓝筹、宽基指数、中小创指数、主题指数、行业指数、SmartBeta 策略、海外市场指数、信用债指数、商品指数等较为完整的产品线。

华夏基金以深入的投资研究为基础,尽力捕捉市场机会,为投资人谋求良好的回报。根据银河证券基金研究中心《中国基金业绩评价报告》,截至 2023 年 6 月 30 日,华夏基金旗下多只产品近 1 年同类排名领先(基金排名不作为产品未来表现的保证),其中:

主动权益产品:在养老目标风险 FOF(权益资产 0-30%)(A 类)中,华夏保守养老一年持有混合(FOF)(A 类)排名第 1/59;在对冲策略绝对收益目标基金(A 类)中,华夏安泰对冲策略 3 个月定开混合排名第 1/22;在汽车主题行业偏股型基金(A 类)中,华夏新能源车龙头混合发起式(A 类)排名第 1/11;在低碳环保行业股票型基金(A 类)中,华夏节能环保股票(A 类)排名第 2/10;在消费行业偏股型基金(A 类)中,华夏网购精选混合(A 类)排名第 2/66、华夏新兴消费混合(A 类)排名第 9/66;在 QDII 混合基金(A 类)中,华夏全球科技先锋混合(QDII)排名第 3/43;在偏债型基金(A 类)中,华夏磐泰混合(LOF)(A 类)排名前 2%(13/619)、华夏睿磐泰盛混合排名前 3%(19/619)、华夏永利一年持有混合(A 类)排名前 10%(61/619);在灵活配置型基金(基准股票比例 30%-60%)(A 类)中,华夏稳增混合排名前 3%(14/440)、华夏新锦绣混合(A 类)排名前 4%(18/440);在标准股票型基金(A 类)中,华夏智

胜先锋股票（LOF）（A 类）排名前 4%（13/317）、华夏智胜价值成长股票（A 类）排名前 6%（20/317）；在偏股型基金（股票上限 95%）（A 类）中，华夏磐利一年定开混合（A 类）排名前 5%（11/214）、华夏磐锐一年定开混合（A 类）排名前 10%（21/214）；在偏股型基金（股票上下限 60%-95%）（A 类）中，华夏核心制造混合（A 类）排名前 9%（126/1403）、华夏价值精选混合排名前 9%（133/1403）。

固收与固收+产品：在 QDII 债券型基金（A 类）中，华夏大中华信用债券（QDII）（A 类）排名第 1/24、华夏收益债券（QDII）（A 类）排名第 3/24；在短期纯债债券型基金（A 类）中，华夏 30 天滚动短债债券发起式（A 类）排名第 8/108；在长期纯债债券型基金（A 类）中，华夏鼎隆债券（A 类）排名前 6%（71/1228）、华夏鼎航债券（A 类）排名前 6%（76/1228）、华夏鼎英债券（A 类）排名前 7%（87/1228）；在普通债券型基金（可投转债）（A 类）中，华夏鼎禄三个月定开债券（A 类）排名前 9%（32/376）；在普通债券型基金（二级）（A 类）中，华夏恒融债券排名前 8%（30/368）。

指数与量化产品：在增强规模指数股票型基金（A 类）中，华夏中证 500 指数增强（A 类）排名第 1/132、华夏中证 500 指数智选增强（A 类）排名第 2/132；在主题指数股票 ETF 联接基金（A 类）中，华夏中证动漫游戏 ETF 发起式联接（A 类）排名第 1/110；在信用债指数债券型基金（A 类）中，华夏亚债中国指数（A 类）排名第 2/16；在 QDII 跨境股票 ETF 基金中，华夏纳斯达克 100ETF（QDII）排名第 2/33、华夏野村日经 225ETF 排名第 7/33；在 QDII 跨境股票 ETF 联接基金（A 类）中，华夏恒生 ETF 联接（A 类）排名第 3/10；在主题指数股票 ETF 基金中，华夏中证动漫游戏 ETF 排名第 1/313、华夏中证云计算与大数据主题 ETF 排名第 6/313、华夏中证大数据产业 ETF 排名前 5%（15/313）、华夏中证文化传媒 ETF 排名前 6%（18/313）、华夏中证金融科技主题 ETF 排名前 10%（30/313）；在规模指数股票 ETF 基金中，华夏沪港通恒生 ETF 排名第 4/136；在规模指数股票 ETF 联接基金（A 类）中，华夏沪港通恒生 ETF 联接（A 类）排名第 4/102；在行业指数股票 ETF 联接基金（A 类）中，华夏中证银行 ETF 联接（A 类）排名第 6/30。

在《中国证券报》第十九届中国基金业金牛奖评选中，华夏基金荣获“被动投资金牛基金公司”，成为业内连续 7 年获此殊荣的基金公司。在证券时报主办的第十八届中国基金业明星基金奖评选活动中，华夏基金凭借卓越的投资实力以及优秀的中长期业绩回报，将两大奖项收入囊中：公司层面，华夏基金荣获“三年期海外投资明星基金公司”；产品层面，华夏沪深 300ETF 荣获“三年持续回报指数型明星基金奖”。在《上海证券报》主办的第十九届“金基金”奖评选活动中，华夏基金将三大金基金奖项收入囊中：公司层面，华夏基金荣获“金基金 被动投资基金管理公司奖”；产品层面，华夏能源革新股票荣获“金基金 投资回报基金奖”，华夏沪深 300ETF 荣获“金基金 指数基金三年期奖”。

在客户服务方面，2023 年上半年，华夏基金继续以客户需求为导向，努力提高客户使用的便利性和服务体验：（1）华夏基金直销渠道优化页面显示，升级搜索及查询功能，给客户更方便直观的

使用体验；（2）华夏基金管家客户端优化“忘记密码”功能及定投模块，从客户投资需求出发，进一步提升操作体验；（3）与华润银行等代销机构合作，拓展更加丰富的客户理财渠道；（4）开展“帮你问了 ChatGPT”、“华夏基金户口本”、“指数攻防值来啦！”、“亲子财商 36 计”等活动，为客户提供了多样化的投资者教育和关怀服务。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
孙蒙	本基金的基金经理	2020-03-17	-	9 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	2022-07-04	-	9 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。
叶津佐	本基金的基金经理助理	2023-03-28	-	6 年	博士。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。

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

②证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本基金管理人严格执行了《证

券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《华夏基金管理有限公司公平交易制度》的规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年，全球主要经济体增长放缓，美欧通胀见顶回落，但仍处高位，主要经济体货币政策紧缩外溢效应突出，硅谷银行倒闭、瑞士信贷被收购等事件引发国际金融市场大幅震荡；西方继续对俄实施大规模制裁，地缘政治冲突升级并进一步影响全球经济秩序的风险犹存。国内方面，先后经历需求释放以及去库存带来的需求回落，流动性充裕。权益市场赚钱难度较大，一方面，去库存阶段使然，另一方面，缺乏能够短期兑现利润的超预期产业趋势。值得一提的是 AI 方向，正在发生长期变革性的产业变化，产业链涉及硬件和软件，并可渗透至社会的各行各业。目前处于发展早期，个股波动较大。

市场方面，A 股市场上涨后震荡调整，结构性行情非常明显，同时主题板块轮动较快，中小市值板块相对占优。行业间表现差异比较大：通信、传媒、计算机等科技相关行业表现较好，而商业贸易、房地产、美容护理等行业表现较差。市场风格轮动较快，整体上估值、反转等量价类因子表现较好，而盈利、成长等基本面类因子持续走弱，期间量化策略整体表现正常。

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 2023 年 6 月 30 日，华夏智胜价值成长股票 A 基金份额净值为 1.5694 元，本报告期份额净值增长率为 11.08%；华夏智胜价值成长股票 C 基金份额净值为 1.5558 元，本报告期份额净值增长率为 10.95%，同期业绩比较基准增长率为 2.20%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年经济复苏弱于预期，下半年政府可能出台更多稳增长政策，货币政策将继续保持宽松，预计中国经济复苏有望加强。A 股上市公司盈利增速方向预计向上，同时投资者情绪逐渐修复。展望下半年，市场预计震荡上行，行业或者风格板块可能持续保持轮动特征，建议均衡配置。

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

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末进行利润分配，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、内部稽核控制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

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：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	65,627,322.29	23,104,069.86
结算备付金		5,668,868.69	1,936,281.56
存出保证金		1,477,006.99	878,318.31
交易性金融资产	6.4.7.2	1,004,848,275.34	334,769,166.48
其中：股票投资		1,004,848,275.34	334,582,219.20
基金投资		-	-
债券投资		-	186,947.28
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		-	72,284.66
应收股利		-	-
应收申购款		3,124,817.65	1,349,509.02
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		1,080,746,290.96	362,109,629.89
负债和净资产			
	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 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		2,446,761.10	-
应付赎回款		684,080.53	753,098.59
应付管理人报酬		852,844.77	311,867.41
应付托管费		170,568.94	62,373.49

应付销售服务费		139,512.07	58,229.62
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	0.97
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	1,632,895.03	1,041,952.23
负债合计		5,926,662.44	2,227,522.31
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	688,660,298.33	256,154,243.99
未分配利润	6.4.7.8	386,159,330.19	103,727,863.59
净资产合计		1,074,819,628.52	359,882,107.58
负债和净资产总计		1,080,746,290.96	362,109,629.89

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，华夏智胜价值成长股票 A 基金份额净值 1.5694 元，华夏智胜价值成长股票 C 基金份额净值 1.5558 元；华夏智胜价值成长股票基金份额总额 688,660,298.33 份（其中 A 类 248,827,497.55 份，C 类 439,832,800.78 份）。

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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		58,271,069.92	-8,789,518.22
1.利息收入		128,384.87	50,061.63
其中：存款利息收入	6.4.7.9	128,384.87	50,061.63
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）		59,369,054.35	-18,758,522.57
其中：股票投资收益	6.4.7.10	49,901,677.60	-20,943,486.98
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	281,955.85	252,624.69
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	31,509.87	-782,710.07
股利收益	6.4.7.14	9,153,911.03	2,715,049.79
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”	6.4.7.15	-1,589,734.55	9,913,376.94

号填列)			
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	363,365.25	5,565.78
减：二、营业总支出		5,492,514.79	1,871,188.35
1.管理人报酬		3,897,238.21	1,264,567.61
2.托管费		779,447.70	252,913.50
3.销售服务费		723,069.67	210,364.94
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		307.76	0.98
8.其他费用	6.4.7.18	92,451.45	143,341.32
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		52,778,555.13	-10,660,706.57
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		52,778,555.13	-10,660,706.57
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		52,778,555.13	-10,660,706.57

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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合 收益(若有)	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	256,154,243.99	-	103,727,863.59	359,882,107.58
二、本期期初净资产（基金净值）	256,154,243.99	-	103,727,863.59	359,882,107.58
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	432,506,054.34	-	282,431,466.60	714,937,520.94
（一）、综合收益总额	-	-	52,778,555.13	52,778,555.13
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	432,506,054.34	-	229,652,911.47	662,158,965.81

(净值减少以“-”号填列)				
其中: 1.基金申购款	709,439,214.63	-	381,759,901.45	1,091,199,116.08
2.基金赎回款	-276,933,160.29	-	-152,106,989.98	-429,040,150.27
(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)	688,660,298.33	-	386,159,330.19	1,074,819,628.52
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益(若有)	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	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

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、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会发布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》和中国证监会、中国基金业协会允许的如财务报表附注 6.4.4 所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

根据财税[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]103 号《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81 号《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]125 号《财政部、国家税务总局、证监会关于内地与香港基金互认有关税收政策的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《财政部、国家税务总局关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《财政部、国家税务总局关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 以发行基金方式募集资金不属于增值税征收范围，不征收增值税。

(2) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

- (3) 基金买卖股票、债券的差价收入免征增值税，暂不征收企业所得税。
- (4) 存款利息收入不征收增值税。
- (5) 国债、地方政府债利息收入，金融同业往来利息收入免征增值税。
- (6) 对基金取得的债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。
- (7) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。
- (8) 对基金在境内取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利收入时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不征收企业所得税。基金在境内从上市公司分配取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，全额计入应纳税所得额，持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，减按 50% 计入应纳税所得额，持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中国结算”）提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。对香港市场投资者取得的股息、红利收入按照 10% 的税率代扣所得税。
- (9) 基金在境内卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。
- (10) 基金在境外证券交易所进行交易或取得的源自境外证券市场的收益，其涉及的税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行。
- (11) 本基金分别按实际缴纳的增值税额的 7%、3%、2% 缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	65,627,322.29
等于：本金	65,620,741.08
加：应计利息	6,581.21
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	65,627,322.29

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	1,010,865,002.11	-	1,004,848,275.34	-6,016,726.77
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	1,010,865,002.11	-	1,004,848,275.34	-6,016,726.77

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	10,831,040.00	-	-	-
其中：股指期货	10,831,040.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	10,831,040.00	-	-	-

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
IC2309	中证 500 期货 IC2309 合约	5	5,970,000.00	-157,400.00
IC2312	中证 500 期货 IC2312 合约	4	4,739,360.00	35,720.00
合计	-	-	-	-121,680.00
减: 可抵销期货暂收款	-	-	-	-121,680.00
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 2023 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	174.02
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	1,543,460.86
其中: 交易所市场	1,543,460.86
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	89,260.15
合计	1,632,895.03

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 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	65,306,145.82	65,306,145.82
本期申购	203,157,454.14	203,157,454.14
本期赎回（以“-”号填列）	-19,636,102.41	-19,636,102.41
本期末	248,827,497.55	248,827,497.55

华夏智胜价值成长股票 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	190,848,098.17	190,848,098.17
本期申购	506,281,760.49	506,281,760.49
本期赎回（以“-”号填列）	-257,297,057.88	-257,297,057.88
本期末	439,832,800.78	439,832,800.78

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
上年度末	27,637,018.89	-681,685.48	26,955,333.41
本期利润	13,869,792.39	324,193.42	14,193,985.81
本期基金份额交易产生的变动数	94,526,385.81	6,012,990.00	100,539,375.81
其中：基金申购款	104,727,507.92	6,835,041.04	111,562,548.96
基金赎回款	-10,201,122.11	-822,051.04	-11,023,173.15
本期已分配利润	-	-	-
本期末	136,033,197.09	5,655,497.94	141,688,695.03

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
上年度末	78,823,092.69	-2,050,562.51	76,772,530.18
本期利润	40,498,497.29	-1,913,927.97	38,584,569.32
本期基金份额交易产生的变动数	115,385,638.75	13,727,896.91	129,113,535.66
其中：基金申购款	248,293,068.73	21,904,283.76	270,197,352.49
基金赎回款	-132,907,429.98	-8,176,386.85	-141,083,816.83
本期已分配利润	-	-	-

本期末	234,707,228.73	9,763,406.43	244,470,635.16
-----	----------------	--------------	----------------

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	92,776.38
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	34,535.47
其他	1,073.02
合计	128,384.87

6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	2,263,136,093.39
减：卖出股票成本总额	2,208,442,426.81
减：交易费用	4,791,988.98
买卖股票差价收入	49,901,677.60

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
债券投资收益——利息收入	202.36
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	281,753.49
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	281,955.85

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,389,542.56

减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,107,500.00
减：应计利息总额	233.16
减：交易费用	55.91
买卖债券差价收入	281,753.49

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.13 衍生工具收益

6.4.7.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.13.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
股指期货投资收益	31,509.87

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资产生的股利收益	9,153,911.03
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	9,153,911.03

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
1.交易性金融资产	-1,665,494.55
——股票投资	-1,665,271.85
——债券投资	-222.70
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	75,760.00
——权证投资	-
——期货投资	75,760.00
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	-1,589,734.55

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
基金赎回费收入	363,365.25
合计	363,365.25

6.4.7.17 信用减值损失

无。

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
审计费用	29,752.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	3,191.30
其他	-
合计	92,451.45

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

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

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华夏基金管理有限公司	基金管理人
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）”）	基金管理人第一大股东的子公司
中信期货有限公司（“中信期货”）	基金管理人第一大股东的子公司
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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
中信证券	1,219,834,049.96	23.79%	430,515,365.09	22.53%

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
中信证券	201,998.58	14.54%	1,150,334.08	72.32%

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
中信证券	437,438.34	20.60%	210,434.87	13.63%
关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
中信证券	185,692.11	22.53%	168,262.94	26.89%

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

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

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月 30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30 日
当期发生的基金应支付的管理费	3,897,238.21	1,264,567.61
其中：支付销售机构的客户维护费	579,146.66	28,927.07

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 2023年1月1日至2023年6月 30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30 日
当期发生的基金应支付的托管费	779,447.70	252,913.50

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	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华夏智胜价值成长股票 A	华夏智胜价值成长股票 C	合计

各关联方名称			
华夏基金管理有限公司	-	346,575.04	346,575.04
招商银行	-	8,826.34	8,826.34
中信证券	-	7,017.31	7,017.31
华夏财富	-	254.32	254.32
中信证券（山东）	-	125.78	125.78
中信期货	-	75.79	75.79
中信证券（华南）	-	44.04	44.04
合计	-	362,918.62	362,918.62
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日 当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华夏智胜价值成长股票 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

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 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	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	4.26%	-	16.78%	-

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2023年1月1日至2023年6月30日		2022年1月1日至2022年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行活期存款	65,627,322.29	92,776.38	16,101,296.57	30,201.31

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					
2023年1月1日至2023年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
中信证券	688343	云天励飞	新股发行	10,484	460,457.28
中信证券	001286	陕西能源	新股发行	37,667	361,603.20
中信证券	688146	中船特气	新股发行	7,317	264,509.55
中信证券	688581	安杰思	新股发行	1,629	204,928.20
中信证券	688539	高华科技	新股发行	5,334	203,865.48
中信证券	688522	纳睿雷达	新股发行	3,836	179,064.48
中信证券	301439	泓淋电力	新股发行	7,083	141,589.17
中信证券	688523	航天环宇	新股发行	4,717	103,113.62
中信证券	301293	三博脑科	新股发行	3,324	98,390.40
中信证券	301323	新莱福	新股发行	2,277	88,939.62
中信证券	688631	莱斯信息	新股发行	3,357	84,864.96
中信证券	301170	锡南科技	新股发行	2,496	84,864.00
中信证券	301157	华塑科技	新股发行	1,498	84,637.00
中信证券	601133	柏诚股份	新股发行	6,632	77,329.12
中信证券	301261	恒工精密	新股发行	1,973	72,803.70

中信证券	603281	江瀚新材	新股发行	863	30,714.17
中信证券	001367	海森药业	新股发行	549	24,419.52
中信证券	001324	长青科技	新股发行	1,131	21,353.28
中信证券	603162	海通发展	新股发行	523	19,481.75
上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位： 股/张）	总金额
中信证券	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

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配事项。

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

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

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

301486	致尚科技	2023-06-30	1 个月内(含)	新发流通受限	57.66	57.66	4,338	250,129.08	250,129.08	-
301395	仁信新材	2023-06-21	1 个月内(含)	新发流通受限	26.68	26.68	4,676	124,755.68	124,755.68	-
301292	海科新源	2023-06-29	1 个月内(含)	新发流通受限	19.99	19.99	5,241	104,767.59	104,767.59	-
688249	晶合集成	2023-04-24	6 个月	新发流通受限	19.86	18.06	5,800	115,188.00	104,748.00	-
301488	豪恩汽电	2023-06-26	1 个月内(含)	新发流通受限	39.78	39.78	2,356	93,721.68	93,721.68	-
301202	朗威股份	2023-06-28	1 个月内(含)	新发流通受限	25.82	25.82	2,754	71,108.28	71,108.28	-
688603	天承科技	2023-06-30	1 个月内(含)	新发流通受限	55.00	55.00	1,251	68,805.00	68,805.00	-
301261	恒工精密	2023-06-29	1 个月内(含)	新发	36.90	36.90	1,775	65,497.50	65,497.50	-

				流通受限						
688472	阿特斯	2023-06-02	6 个月	新发流通受限	11.10	17.04	3,840	42,624.00	65,433.60	-
688361	中科飞测	2023-05-12	6 个月	新发流通受限	23.60	64.67	831	19,611.60	53,740.77	-
688469	中芯集成	2023-04-28	6 个月	新发流通受限	5.69	5.41	9,439	53,707.91	51,064.99	-
301325	曼恩斯特	2023-05-04	6 个月	新发流通受限	76.80	107.95	364	27,955.20	39,293.80	-
301291	明阳电气	2023-06-21	6 个月	新发流通受限	38.13	31.03	1,206	45,984.78	37,422.18	-
001286	陕西能源	2023-03-31	6 个月	新发流通受限	9.60	9.41	3,767	36,163.20	35,447.47	-
688531	日联科技	2023-03-24	6 个月	新发流通	152.38	135.97	225	34,285.50	30,593.25	-

				受限						
688576	西山科技	2023-05-30	6 个月	新发流通受限	135.80	120.41	240	32,592.00	28,898.40	-
688146	中船特气	2023-04-13	6 个月	新发流通受限	36.15	38.13	732	26,461.80	27,911.16	-
301486	致尚科技	2023-06-30	6 个月	新发流通受限	57.66	57.66	482	27,792.12	27,792.12	-
301310	鑫宏业	2023-05-26	6 个月	新发流通受限	67.28	65.43	409	27,517.52	26,760.87	-
688582	芯动联科	2023-06-21	6 个月	新发流通受限	26.74	40.68	648	17,327.52	26,360.64	-
688352	颀中科技	2023-04-11	6 个月	新发流通受限	12.10	12.07	2,157	26,099.70	26,034.99	-
688484	南芯科技	2023-03-28	6 个月	新发流通受限	39.99	36.71	692	27,673.08	25,403.32	-

301293	三博 脑科	2023-04-25	6 个月	新发 流通 受限	29.60	71.42	333	9,856.80	23,782.86	-
301358	湖南 裕能	2023-02-01	6 个月	新发 流通 受限	23.77	42.89	550	13,073.50	23,589.50	-
001287	中电 港	2023-03-30	6 个月	新发 流通 受限	11.88	21.02	1,086	12,901.68	22,827.72	-
688552	航天 南湖	2023-05-08	6 个月	新发 流通 受限	21.17	23.50	956	20,238.52	22,466.00	-
688570	天玛 智控	2023-05-29	6 个月	新发 流通 受限	30.26	25.33	884	26,749.84	22,391.72	-
301307	美利 信	2023-04-14	6 个月	新发 流通 受限	32.34	31.86	687	22,217.58	21,887.82	-
688543	国科 军工	2023-06-14	6 个月	新发 流通 受限	43.67	53.05	410	17,904.70	21,750.50	-
688507	索辰 科技	2023-04-10	6 个月	新发	245.56	122.11	172	28,484.96	21,002.92	含 证

				流通受限						券送配
301303	真兰仪表	2023-02-13	6 个月	新发流通受限	26.80	22.32	910	24,388.00	20,311.20	-
688458	美芯晟	2023-05-15	6 个月	新发流通受限	75.00	90.76	221	16,575.00	20,057.96	-
688581	安杰思	2023-05-12	6 个月	新发流通受限	125.80	118.03	163	20,505.40	19,238.89	-
301317	鑫磊股份	2023-01-12	6 个月	新发流通受限	20.67	26.17	694	14,344.98	18,161.98	-
301262	海看股份	2023-06-13	6 个月	新发流通受限	30.22	25.50	692	20,912.24	17,646.00	-
301383	天键股份	2023-05-31	6 个月	新发流通受限	46.16	35.72	493	22,756.88	17,609.96	-
688562	航天软件	2023-05-15	6 个月	新发流通	12.68	22.31	726	9,205.68	16,197.06	-

				受限						
688623	双元科技	2023-05-31	6 个月	新发流通受限	125.88	86.79	178	22,406.64	15,448.62	-
301246	宏源药业	2023-03-10	6 个月	新发流通受限	50.00	30.71	503	25,150.00	15,447.13	-
301332	德尔玛	2023-05-09	6 个月	新发流通受限	14.81	13.73	1,122	16,616.82	15,405.06	-
301399	英特科技	2023-05-16	6 个月	新发流通受限	43.99	51.57	293	12,889.07	15,110.01	-
301305	朗坤环境	2023-05-15	6 个月	新发流通受限	25.25	19.69	753	19,013.25	14,826.57	-
301397	溯联股份	2023-06-15	6 个月	新发流通受限	53.27	40.20	362	19,283.74	14,552.40	-
301387	光大同创	2023-04-10	6 个月	新发流通受限	58.32	45.36	307	17,904.24	13,925.52	-

301395	仁信新材	2023-06-21	6 个月	新发流通受限	26.68	26.68	520	13,873.60	13,873.60	-
301210	金杨股份	2023-06-21	6 个月	新发流通受限	57.88	49.17	281	16,264.28	13,816.77	-
688512	慧智微	2023-05-08	6 个月	新发流通受限	20.92	19.16	721	15,083.32	13,814.36	-
301382	蜂助手	2023-05-09	6 个月	新发流通受限	23.80	32.84	408	9,710.40	13,398.72	-
688433	华曙高科	2023-04-07	6 个月	新发流通受限	26.66	31.50	418	11,143.88	13,167.00	-
301360	荣旗科技	2023-04-17	6 个月	新发流通受限	71.88	92.60	134	9,631.92	12,408.40	-
301439	泓淋电力	2023-03-10	6 个月	新发流通受限	19.99	16.90	709	14,172.91	11,982.10	-
301292	海科新源	2023-06-29	6 个月	新发	19.99	19.99	583	11,654.17	11,654.17	-

				流通受限						
688523	航天环宇	2023-05-26	6 个月	新发流通受限	21.86	23.85	472	10,317.92	11,257.20	-
603135	中重科技	2023-03-29	6 个月	新发流通受限	17.80	17.89	628	11,178.40	11,234.92	-
301141	中科磁业	2023-03-27	6 个月	新发流通受限	41.20	42.69	262	10,794.40	11,184.78	-
301225	恒勃股份	2023-06-08	6 个月	新发流通受限	35.66	33.26	333	11,874.78	11,075.58	-
301429	森泰股份	2023-04-10	6 个月	新发流通受限	28.75	21.02	499	14,346.25	10,488.98	-
301488	豪恩汽电	2023-06-26	6 个月	新发流通受限	39.78	39.78	262	10,422.36	10,422.36	-
601065	江盐集团	2023-03-31	6 个月	新发流通	10.36	11.84	859	8,899.24	10,170.56	-

				受限						
688631	莱斯信息	2023-06-19	6 个月	新发流通受限	25.28	29.87	336	8,494.08	10,036.32	-
688479	友车科技	2023-05-04	6 个月	新发流通受限	33.99	29.49	332	11,284.68	9,790.68	-
301232	飞沃科技	2023-06-08	6 个月	新发流通受限	72.50	58.42	165	11,962.50	9,639.30	-
301376	致欧科技	2023-06-14	6 个月	新发流通受限	24.66	22.51	420	10,357.20	9,454.20	-
301355	南王科技	2023-06-02	6 个月	新发流通受限	17.55	16.75	563	9,880.65	9,430.25	-
301357	北方长龙	2023-04-11	6 个月	新发流通受限	50.00	48.39	190	9,500.00	9,194.10	-
301386	未来电器	2023-03-21	6 个月	新发流通受限	29.99	23.79	378	11,336.22	8,992.62	-

301323	新莱福	2023-05-29	6 个月	新发流通受限	39.06	39.36	228	8,905.68	8,974.08	-
688429	时创能源	2023-06-20	6 个月	新发流通受限	19.20	25.53	346	6,643.20	8,833.38	-
301170	锡南科技	2023-06-16	6 个月	新发流通受限	34.00	34.93	250	8,500.00	8,732.50	-
301281	科源制药	2023-03-28	6 个月	新发流通受限	44.18	25.10	338	10,647.38	8,483.80	含 证 券 送 配
688535	华海诚科	2023-03-28	6 个月	新发流通受限	35.00	51.23	161	5,635.00	8,248.03	-
601133	柏诚股份	2023-03-31	6 个月	新发流通受限	11.66	12.26	664	7,742.24	8,140.64	-
301157	华塑科技	2023-03-01	6 个月	新发流通受限	56.50	52.93	150	8,475.00	7,939.50	-
301202	朗威股份	2023-06-28	6 个月	新发	25.82	25.82	306	7,900.92	7,900.92	-

				流通受限						
301295	美硕科技	2023-06-19	6 个月	新发流通受限	37.40	36.07	215	8,041.00	7,755.05	-
301203	国泰环保	2023-03-28	6 个月	新发流通受限	46.13	34.40	225	10,379.25	7,740.00	-
688603	天承科技	2023-06-30	6 个月	新发流通受限	55.00	55.00	140	7,700.00	7,700.00	-
300804	广康生化	2023-06-15	6 个月	新发流通受限	42.45	32.97	226	9,593.70	7,451.22	-
301261	恒工精密	2023-06-29	6 个月	新发流通受限	36.90	36.90	198	7,306.20	7,306.20	-
301345	涛涛车业	2023-03-10	6 个月	新发流通受限	73.45	46.64	156	11,458.20	7,275.84	-
301337	亚华电子	2023-05-16	6 个月	新发流通	32.60	30.37	232	7,563.20	7,045.84	-

				受限						
301428	世纪恒通	2023-05-10	6 个月	新发流通受限	26.35	30.60	229	6,034.15	7,007.40	-
001380	华纬科技	2023-05-09	6 个月	新发流通受限	28.84	30.78	170	4,902.80	5,232.60	-
603125	常青科技	2023-03-30	6 个月	新发流通受限	25.98	24.53	160	4,156.80	3,924.80	-
001328	登康口腔	2023-03-29	6 个月	新发流通受限	20.68	25.49	145	2,998.60	3,696.05	-
001282	三联锻造	2023-05-15	6 个月	新发流通受限	27.93	33.03	105	2,932.65	3,468.15	-
001360	南矿集团	2023-03-31	6 个月	新发流通受限	15.38	14.87	177	2,722.26	2,631.99	-
001324	长青科技	2023-05-12	6 个月	新发流通受限	18.88	19.60	114	2,152.32	2,234.40	-

001367	海森药业	2023-03-30	6 个月	新发流通受限	44.48	39.48	55	2,446.40	2,171.40	-
603172	万丰股份	2023-04-28	6 个月	新发流通受限	14.58	16.13	122	1,778.76	1,967.86	-

注：①根据中国证监会《上市公司证券发行注册管理办法》，基金参与上市公司向特定对象发行股票所获得的股票，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。

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

③根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

④基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的设定限售期的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的风险管理政策是使基金投资风险可测、可控、可承担。本基金管理人建立了由风险管

理委员会、督察长、法律部、合规部、稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的多层次风险管理架构体系。风险管理团队在识别、衡量投资风险后，通过正式报告的方式，将分析结果及时传达给基金经理、投资总监、投资决策委员会和风险管理委员会，协助制定风险控制决策，实现风险管理目标。

本基金管理人主要通过定性分析和定量分析的方法，估测各种金融工具风险可能产生的损失。本基金管理人从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重性；从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用的金融工具特征，通过特定的风险量化指标、模型和日常的量化报告，参考压力测试结果，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时对各种风险进行监督、检查和评估，并制定相应决策，将风险控制在预期可承受的范围内。

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 2023年6月30日		上年度末 2022年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	1,004,848,275.34	93.49	334,582,219.20	92.97
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	186,947.28	0.05
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	1,004,848,275.34	93.49	334,769,166.48	93.02
----	------------------	-------	----------------	-------

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

②由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	-5%	-39,186,584.18	-12,144,742.18
	+5%	39,186,584.18	12,144,742.18

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 6 月 30 日
第一层次	1,002,650,598.95
第二层次	865,434.18
第三层次	1,332,242.21
合计	1,004,848,275.34

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

截至 2023 年 6 月 30 日止，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，其账面价值与公允价值差异很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	1,004,848,275.34	92.98
	其中：股票	1,004,848,275.34	92.98
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	71,296,190.98	6.60
8	其他各项资产	4,601,824.64	0.43
9	合计	1,080,746,290.96	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	7,584,079.00	0.71
B	采矿业	37,433,861.34	3.48
C	制造业	639,824,529.69	59.53
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	37,499,260.21	3.49
E	建筑业	16,228,399.04	1.51
F	批发和零售业	13,591,440.10	1.26
G	交通运输、仓储和邮政业	29,933,609.79	2.78
H	住宿和餐饮业	180,540.00	0.02

I	信息传输、软件和信息技术服务业	54,894,768.60	5.11
J	金融业	87,090,935.73	8.10
K	房地产业	18,014,433.24	1.68
L	租赁和商务服务业	16,310,822.34	1.52
M	科学研究和技术服务业	13,219,449.00	1.23
N	水利、环境和公共设施管理业	3,980,100.57	0.37
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	2,442,086.00	0.23
Q	卫生和社会工作	7,863,333.86	0.73
R	文化、体育和娱乐业	18,484,509.60	1.72
S	综合	272,117.23	0.03
	合计	1,004,848,275.34	93.49

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	603605	珀莱雅	79,020	8,881,848.00	0.83
2	000567	海德股份	623,112	7,988,295.84	0.74
3	002739	万达电影	619,500	7,768,530.00	0.72
4	600315	上海家化	258,100	7,487,481.00	0.70
5	300143	盈康生命	650,900	7,381,206.00	0.69
6	688390	固德威	43,200	7,208,352.00	0.67
7	600038	中直股份	178,977	7,126,864.14	0.66
8	002299	圣农发展	368,700	7,060,605.00	0.66
9	601600	中国铝业	1,279,600	7,025,004.00	0.65
10	001979	招商蛇口	533,300	6,948,899.00	0.65
11	002918	蒙娜丽莎	448,600	6,926,384.00	0.64
12	002249	大洋电机	1,209,300	6,893,010.00	0.64
13	003012	东鹏控股	849,500	6,872,455.00	0.64
14	688050	爱博医疗	33,465	6,871,368.45	0.64
15	600019	宝钢股份	1,206,756	6,781,968.72	0.63
16	600535	天士力	465,100	6,748,601.00	0.63
17	601966	玲珑轮胎	300,400	6,674,888.00	0.62
18	603113	金能科技	813,300	6,579,597.00	0.61
19	600699	均胜电子	367,400	6,480,936.00	0.60
20	603208	江山欧派	176,007	6,410,174.94	0.60
21	600502	安徽建工	1,185,700	6,260,496.00	0.58
22	600098	广州发展	1,006,600	6,220,788.00	0.58
23	601222	林洋能源	759,100	6,217,029.00	0.58
24	603105	芯能科技	362,200	6,117,558.00	0.57
25	002928	华夏航空	720,750	6,090,337.50	0.57
26	600968	海油发展	1,915,300	5,879,971.00	0.55

27	600643	爱建集团	1,174,630	5,873,150.00	0.55
28	600908	无锡银行	1,076,600	5,770,576.00	0.54
29	601336	新华保险	154,000	5,662,580.00	0.53
30	002984	森麒麟	178,900	5,628,194.00	0.52
31	300723	一品红	183,550	5,378,015.00	0.50
32	300487	蓝晓科技	85,425	5,332,228.50	0.50
33	002373	千方科技	378,600	5,164,104.00	0.48
34	002038	双鹭药业	511,600	5,162,044.00	0.48
35	002032	苏泊尔	101,000	5,050,000.00	0.47
36	601958	金铂股份	440,400	4,910,460.00	0.46
37	600845	宝信软件	95,776	4,866,378.56	0.45
38	002179	中航光电	106,650	4,836,577.50	0.45
39	600583	海油工程	790,200	4,622,670.00	0.43
40	002651	利君股份	578,400	4,494,168.00	0.42
41	600572	康恩贝	639,700	4,381,945.00	0.41
42	601688	华泰证券	314,100	4,325,157.00	0.40
43	002600	领益智造	615,400	4,252,414.00	0.40
44	000725	京东方 A	1,025,700	4,195,113.00	0.39
45	601928	凤凰传媒	360,800	4,113,120.00	0.38
46	601021	春秋航空	70,907	4,075,025.29	0.38
47	002152	广电运通	343,600	4,026,992.00	0.37
48	603317	天味食品	266,860	3,898,824.60	0.36
49	600161	天坛生物	141,400	3,839,010.00	0.36
50	002741	光华科技	225,300	3,803,064.00	0.35
51	002203	海亮股份	314,600	3,778,346.00	0.35
52	300719	安达维尔	267,300	3,774,276.00	0.35
53	000623	吉林敖东	235,200	3,772,608.00	0.35
54	600363	联创光电	100,900	3,743,390.00	0.35
55	603466	风语筑	267,714	3,721,224.60	0.35
56	688012	中微公司	23,300	3,645,285.00	0.34
57	600582	天地科技	624,800	3,642,584.00	0.34
58	002422	科伦药业	122,700	3,641,736.00	0.34
59	603551	奥普家居	280,400	3,625,572.00	0.34
60	603556	海兴电力	142,600	3,599,224.00	0.33
61	688208	道通科技	118,400	3,588,704.00	0.33
62	600886	国投电力	283,100	3,581,215.00	0.33
63	601328	交通银行	615,800	3,571,640.00	0.33
64	003006	百亚股份	206,100	3,561,408.00	0.33
65	301028	东亚机械	317,300	3,537,895.00	0.33
66	601398	工商银行	731,900	3,527,758.00	0.33
67	688819	天能股份	94,436	3,479,022.24	0.32
68	603355	莱克电气	136,000	3,455,760.00	0.32
69	601288	农业银行	974,500	3,439,985.00	0.32

70	688013	天臣医疗	143,100	3,392,901.00	0.32
71	300767	震安科技	133,480	3,385,052.80	0.31
72	003816	中国广核	1,086,700	3,379,637.00	0.31
73	002065	东华软件	472,400	3,335,144.00	0.31
74	002449	国星光电	374,700	3,331,083.00	0.31
75	601108	财通证券	455,900	3,300,716.00	0.31
76	601857	中国石油	431,100	3,220,317.00	0.30
77	002027	分众传媒	471,700	3,212,277.00	0.30
78	605117	德业股份	21,368	3,195,584.40	0.30
79	688718	唯赛勃	181,988	3,150,212.28	0.29
80	600028	中国石化	492,800	3,134,208.00	0.29
81	002384	东山精密	121,000	3,133,900.00	0.29
82	600827	百联股份	231,914	3,100,690.18	0.29
83	300318	博晖创新	564,600	3,054,486.00	0.28
84	600305	恒顺醋业	280,700	3,048,402.00	0.28
85	600519	贵州茅台	1,800	3,043,800.00	0.28
86	000596	古井贡酒	12,300	3,042,774.00	0.28
87	688981	中芯国际	59,200	2,990,784.00	0.28
88	000987	越秀资本	464,700	2,950,845.00	0.27
89	002818	富森美	222,700	2,946,321.00	0.27
90	002028	思源电气	61,100	2,854,592.00	0.27
91	000333	美的集团	47,900	2,822,268.00	0.26
92	601939	建设银行	450,800	2,822,008.00	0.26
93	601006	大秦铁路	376,500	2,797,395.00	0.26
94	000811	冰轮环境	177,000	2,789,520.00	0.26
95	000063	中兴通讯	61,000	2,777,940.00	0.26
96	301031	中熔电气	20,300	2,754,913.00	0.26
97	002749	国光股份	241,700	2,738,461.00	0.25
98	600456	宝钛股份	80,390	2,720,397.60	0.25
99	688777	中控技术	43,210	2,712,723.80	0.25
100	688088	虹软科技	63,200	2,701,800.00	0.25
101	002017	东信和平	204,615	2,682,502.65	0.25
102	601728	中国电信	466,200	2,624,706.00	0.24
103	300003	乐普医疗	116,000	2,622,760.00	0.24
104	600167	联美控股	375,198	2,615,130.06	0.24
105	002990	盛视科技	70,900	2,609,120.00	0.24
106	601888	中国中免	23,500	2,597,455.00	0.24
107	688100	威胜信息	86,594	2,581,367.14	0.24
108	002774	快意电梯	324,300	2,578,185.00	0.24
109	603508	思维列控	149,040	2,541,132.00	0.24
110	300749	顶固集创	276,300	2,539,197.00	0.24
111	002563	森马服饰	407,500	2,534,650.00	0.24
112	002732	燕塘乳业	116,131	2,510,752.22	0.23

113	002938	鹏鼎控股	103,000	2,501,870.00	0.23
114	603758	秦安股份	233,800	2,487,632.00	0.23
115	600826	兰生股份	241,602	2,481,252.54	0.23
116	601899	紫金矿业	217,100	2,468,427.00	0.23
117	601333	广深铁路	619,400	2,452,824.00	0.23
118	688711	宏微科技	41,940	2,446,779.60	0.23
119	600435	北方导航	210,800	2,422,092.00	0.23
120	603313	梦百合	240,903	2,416,257.09	0.22
121	002055	得润电子	246,700	2,358,452.00	0.22
122	601686	友发集团	341,900	2,338,596.00	0.22
123	002595	豪迈科技	65,500	2,301,015.00	0.21
124	000513	丽珠集团	58,900	2,291,799.00	0.21
125	601601	中国太保	87,900	2,283,642.00	0.21
126	000923	河钢资源	168,900	2,280,150.00	0.21
127	605167	利柏特	233,800	2,263,184.00	0.21
128	601577	长沙银行	290,000	2,250,400.00	0.21
129	601319	中国人保	376,900	2,201,096.00	0.20
130	600830	香溢融通	358,000	2,187,380.00	0.20
131	688670	金迪克	46,188	2,174,531.04	0.20
132	600517	国网英大	381,200	2,172,840.00	0.20
133	603197	保隆科技	40,000	2,170,000.00	0.20
134	603421	鼎信通讯	203,800	2,129,710.00	0.20
135	300515	三德科技	131,500	2,119,780.00	0.20
136	000426	兴业银锡	237,400	2,108,112.00	0.20
137	002815	崇达技术	169,000	2,104,050.00	0.20
138	002879	长缆科技	127,400	2,098,278.00	0.20
139	002275	桂林三金	116,500	2,098,165.00	0.20
140	002273	水晶光电	175,300	2,093,082.00	0.19
141	002763	汇洁股份	235,700	2,088,302.00	0.19
142	601628	中国人寿	59,200	2,069,632.00	0.19
143	000060	中金岭南	435,700	2,069,575.00	0.19
144	002421	达实智能	586,600	2,064,832.00	0.19
145	002991	甘源食品	26,600	2,040,220.00	0.19
146	688336	三生国健	119,279	2,038,478.11	0.19
147	600223	福瑞达	192,500	1,975,050.00	0.18
148	603515	欧普照明	97,200	1,973,160.00	0.18
149	002139	拓邦股份	151,100	1,971,855.00	0.18
150	603323	苏农银行	466,940	1,965,817.40	0.18
151	688560	明冠新材	70,100	1,948,079.00	0.18
152	688366	昊海生科	23,100	1,945,482.00	0.18
153	601137	博威合金	124,300	1,934,108.00	0.18
154	000069	华侨城 A	435,800	1,917,520.00	0.18
155	002322	理工能科	184,200	1,915,680.00	0.18

156	600729	重庆百货	60,800	1,911,552.00	0.18
157	603511	爱慕股份	111,100	1,910,920.00	0.18
158	688210	统联精密	97,800	1,909,056.00	0.18
159	002064	华峰化学	277,100	1,900,906.00	0.18
160	688002	睿创微纳	42,300	1,895,040.00	0.18
161	002381	双箭股份	245,400	1,894,488.00	0.18
162	603488	展鹏科技	235,400	1,890,262.00	0.18
163	002611	东方精工	328,500	1,885,590.00	0.18
164	688080	映翰通	38,560	1,885,584.00	0.18
165	688132	邦彦技术	69,253	1,882,296.54	0.18
166	603993	洛阳钼业	353,000	1,881,490.00	0.18
167	688288	鸿泉物联	73,987	1,880,749.54	0.17
168	603628	清源股份	118,500	1,875,855.00	0.17
169	002855	捷荣技术	178,400	1,871,416.00	0.17
170	688093	世华科技	93,100	1,867,586.00	0.17
171	000608	阳光股份	689,100	1,867,461.00	0.17
172	603766	隆鑫通用	352,300	1,860,144.00	0.17
173	600039	四川路桥	189,340	1,857,425.40	0.17
174	002801	微光股份	68,575	1,855,639.50	0.17
175	600761	安徽合力	92,600	1,845,518.00	0.17
176	301155	海力风电	23,900	1,842,212.00	0.17
177	600897	厦门空港	89,000	1,841,410.00	0.17
178	600959	江苏有线	540,900	1,828,242.00	0.17
179	000528	柳工	231,400	1,828,060.00	0.17
180	600007	中国国贸	98,587	1,825,831.24	0.17
181	300074	华平股份	423,400	1,824,854.00	0.17
182	603839	安正时尚	242,440	1,823,148.80	0.17
183	688073	毕得医药	25,600	1,811,968.00	0.17
184	603808	歌力思	138,000	1,811,940.00	0.17
185	603855	华荣股份	67,900	1,806,140.00	0.17
186	600276	恒瑞医药	37,550	1,798,645.00	0.17
187	000030	富奥股份	356,200	1,795,248.00	0.17
188	002500	山西证券	321,200	1,792,296.00	0.17
189	000737	北方铜业	331,600	1,787,324.00	0.17
190	600362	江西铜业	94,100	1,786,018.00	0.17
191	688696	极米科技	12,800	1,784,192.00	0.17
192	000783	长江证券	307,300	1,782,340.00	0.17
193	600628	新世界	245,900	1,777,857.00	0.17
194	605066	天正电气	188,600	1,774,726.00	0.17
195	000869	张裕 A	57,700	1,769,082.00	0.16
196	002516	旷达科技	364,900	1,766,116.00	0.16
197	002131	利欧股份	766,500	1,762,950.00	0.16
198	601139	深圳燃气	241,600	1,761,264.00	0.16

199	603053	成都燃气	174,700	1,759,229.00	0.16
200	600900	长江电力	79,700	1,758,182.00	0.16
201	601318	中国平安	37,700	1,749,280.00	0.16
202	601989	中国重工	362,700	1,748,214.00	0.16
203	300462	华铭智能	148,300	1,741,042.00	0.16
204	002479	富春环保	373,500	1,740,510.00	0.16
205	688078	龙软科技	33,746	1,739,606.30	0.16
206	000980	众泰汽车	706,800	1,738,728.00	0.16
207	688625	呈和科技	44,300	1,736,117.00	0.16
208	600261	阳光照明	474,100	1,730,465.00	0.16
209	600941	中国移动	18,500	1,726,050.00	0.16
210	300667	必创科技	87,200	1,716,968.00	0.16
211	603877	太平鸟	67,400	1,703,872.00	0.16
212	688639	华恒生物	18,800	1,701,024.00	0.16
213	000818	航锦科技	50,700	1,691,859.00	0.16
214	000997	新大陆	89,400	1,689,660.00	0.16
215	300633	开立医疗	30,500	1,662,250.00	0.15
216	688700	东威科技	16,628	1,658,310.44	0.15
217	000878	云南铜业	149,900	1,656,395.00	0.15
218	002833	弘亚数控	84,240	1,656,158.40	0.15
219	688510	航亚科技	83,200	1,654,848.00	0.15
220	601567	三星医疗	131,000	1,654,530.00	0.15
221	600548	深高速	182,700	1,640,646.00	0.15
222	300371	汇中股份	124,640	1,632,784.00	0.15
223	300887	谱尼测试	41,200	1,630,696.00	0.15
224	300587	天铁股份	211,100	1,625,470.00	0.15
225	600120	浙江东方	422,900	1,619,707.00	0.15
226	301076	新瀚新材	82,369	1,616,079.78	0.15
227	002698	博实股份	92,400	1,616,076.00	0.15
228	300697	电工合金	134,200	1,607,716.00	0.15
229	600662	外服控股	280,600	1,605,032.00	0.15
230	300314	戴维医疗	75,902	1,604,568.28	0.15
231	688360	德马科技	72,300	1,604,337.00	0.15
232	603040	新坐标	59,900	1,592,741.00	0.15
233	002978	安宁股份	49,600	1,592,656.00	0.15
234	301061	匠心家居	43,080	1,591,806.00	0.15
235	000531	穗恒运 A	219,600	1,587,708.00	0.15
236	600864	哈投股份	310,700	1,587,677.00	0.15
237	000858	五粮液	9,700	1,586,629.00	0.15
238	688395	正弦电气	59,300	1,576,787.00	0.15
239	002793	罗欣药业	291,800	1,572,802.00	0.15
240	601169	北京银行	333,900	1,545,957.00	0.14
241	003031	中瓷电子	11,600	1,544,192.00	0.14

242	603345	安井食品	10,500	1,541,400.00	0.14
243	002376	新北洋	190,700	1,538,949.00	0.14
244	301011	华立科技	65,000	1,522,950.00	0.14
245	000690	宝新能源	212,184	1,489,531.68	0.14
246	002540	亚太科技	257,600	1,488,928.00	0.14
247	600201	生物股份	156,500	1,488,315.00	0.14
248	002745	木林森	161,000	1,481,200.00	0.14
249	603701	德宏股份	103,700	1,471,503.00	0.14
250	600879	航天电子	173,200	1,470,468.00	0.14
251	605177	东亚药业	59,516	1,466,474.24	0.14
252	000514	渝开发	382,500	1,461,150.00	0.14
253	000717	中南股份	525,400	1,460,612.00	0.14
254	002014	永新股份	167,680	1,455,462.40	0.14
255	603587	地素时尚	99,200	1,452,288.00	0.14
256	603283	赛腾股份	32,500	1,446,250.00	0.13
257	688616	西力科技	109,300	1,446,039.00	0.13
258	000045	深纺织 A	130,000	1,430,000.00	0.13
259	300433	蓝思科技	121,300	1,426,488.00	0.13
260	000598	兴蓉环境	260,800	1,416,144.00	0.13
261	002372	伟星新材	68,700	1,411,098.00	0.13
262	688516	奥特维	7,400	1,394,160.00	0.13
263	002149	西部材料	83,000	1,393,570.00	0.13
264	605009	豪悦护理	29,000	1,392,000.00	0.13
265	002410	广联达	42,620	1,384,723.80	0.13
266	601988	中国银行	352,400	1,377,884.00	0.13
267	002594	比亚迪	5,300	1,368,831.00	0.13
268	688125	安达智能	24,905	1,353,586.75	0.13
269	301182	凯旺科技	58,500	1,343,745.00	0.13
270	601827	三峰环境	181,100	1,340,140.00	0.12
271	300976	达瑞电子	26,400	1,338,480.00	0.12
272	002236	大华股份	67,100	1,325,225.00	0.12
273	603861	白云电器	137,500	1,320,000.00	0.12
274	600828	茂业商业	356,500	1,319,050.00	0.12
275	688267	中触媒	62,500	1,316,875.00	0.12
276	603367	辰欣药业	86,600	1,314,588.00	0.12
277	300396	迪瑞医疗	39,800	1,293,102.00	0.12
278	000425	徐工机械	190,700	1,291,039.00	0.12
279	300384	三联虹普	75,900	1,289,541.00	0.12
280	688559	海目星	27,200	1,278,672.00	0.12
281	603878	武进不锈	151,220	1,277,809.00	0.12
282	603896	寿仙谷	28,766	1,274,333.80	0.12
283	688586	江航装备	90,478	1,258,548.98	0.12
284	300454	深信服	11,100	1,257,075.00	0.12

285	600488	津药药业	223,000	1,253,260.00	0.12
286	300347	泰格医药	19,400	1,252,076.00	0.12
287	300717	华信新材	72,300	1,232,715.00	0.11
288	601618	中国中冶	309,200	1,227,524.00	0.11
289	300951	博硕科技	22,412	1,224,367.56	0.11
290	002448	中原内配	174,800	1,223,600.00	0.11
291	601158	重庆水务	216,400	1,203,184.00	0.11
292	603217	元利科技	46,700	1,202,525.00	0.11
293	603737	三棵树	18,380	1,202,419.60	0.11
294	688019	安集科技	7,280	1,199,962.40	0.11
295	601012	隆基绿能	41,800	1,198,406.00	0.11
296	002966	苏州银行	182,500	1,195,375.00	0.11
297	601816	京沪高铁	225,300	1,185,078.00	0.11
298	300470	中密控股	25,500	1,178,610.00	0.11
299	002830	名雕股份	91,100	1,166,991.00	0.11
300	300768	迪普科技	70,300	1,164,871.00	0.11
301	000534	万泽股份	68,500	1,148,745.00	0.11
302	301004	嘉益股份	29,600	1,148,480.00	0.11
303	600717	天津港	258,800	1,146,484.00	0.11
304	603377	东方时尚	142,500	1,145,700.00	0.11
305	688268	华特气体	14,000	1,130,220.00	0.11
306	000429	粤高速 A	142,700	1,118,768.00	0.10
307	688188	柏楚电子	5,899	1,112,315.44	0.10
308	601985	中国核电	156,300	1,101,915.00	0.10
309	605589	圣泉集团	49,600	1,078,304.00	0.10
310	002111	威海广泰	112,400	1,072,296.00	0.10
311	002285	世联行	416,800	1,067,008.00	0.10
312	600967	内蒙一机	105,300	1,063,530.00	0.10
313	002465	海格通信	102,600	1,060,884.00	0.10
314	600348	华阳股份	132,550	1,048,470.50	0.10
315	002956	西麦食品	66,940	1,046,272.20	0.10
316	000708	中信特钢	65,800	1,042,272.00	0.10
317	688138	清溢光电	49,300	1,040,723.00	0.10
318	688556	高测股份	19,400	1,030,916.00	0.10
319	002930	宏川智慧	45,000	1,024,650.00	0.10
320	000767	晋控电力	317,100	1,005,207.00	0.09
321	603657	春光科技	56,700	995,085.00	0.09
322	600820	隧道股份	164,000	985,640.00	0.09
323	600566	济川药业	33,700	978,648.00	0.09
324	603228	景旺电子	37,700	967,005.00	0.09
325	688131	皓元医药	16,900	962,962.00	0.09
326	000728	国元证券	147,600	962,352.00	0.09
327	300702	天宇股份	39,500	958,665.00	0.09

328	002345	潮宏基	121,900	958,134.00	0.09
329	600131	国网信通	47,400	957,006.00	0.09
330	601886	江河集团	107,600	956,564.00	0.09
331	000338	潍柴动力	76,200	949,452.00	0.09
332	003008	开普检测	33,000	948,090.00	0.09
333	601921	浙版传媒	107,400	933,306.00	0.09
334	603444	吉比特	1,900	933,109.00	0.09
335	688211	中科微至	20,600	930,502.00	0.09
336	600936	广西广电	240,600	921,498.00	0.09
337	002128	电投能源	69,700	921,434.00	0.09
338	600600	青岛啤酒	8,800	911,944.00	0.08
339	603328	依顿电子	109,500	906,660.00	0.08
340	603129	春风动力	5,600	906,640.00	0.08
341	688425	铁建重工	186,000	894,660.00	0.08
342	600050	中国联通	186,300	894,240.00	0.08
343	601778	晶科科技	180,900	893,646.00	0.08
344	002690	美亚光电	34,700	893,525.00	0.08
345	300896	爱美客	2,000	889,900.00	0.08
346	600674	川投能源	58,800	884,940.00	0.08
347	601198	东兴证券	110,300	884,606.00	0.08
348	688630	芯碁微装	10,500	882,210.00	0.08
349	002779	中坚科技	33,300	876,123.00	0.08
350	300797	钢研纳克	47,000	866,680.00	0.08
351	688676	金盘科技	28,400	860,236.00	0.08
352	600377	宁沪高速	87,400	859,142.00	0.08
353	002429	兆驰股份	155,800	856,900.00	0.08
354	000729	燕京啤酒	68,551	854,830.97	0.08
355	000020	深华发 A	73,500	850,395.00	0.08
355	000028	国药一致	19,500	850,395.00	0.08
357	603615	茶花股份	89,900	848,656.00	0.08
358	002942	新农股份	46,500	843,975.00	0.08
359	300059	东方财富	59,400	843,480.00	0.08
360	002130	沃尔核材	103,400	839,608.00	0.08
361	603416	信捷电气	20,300	838,593.00	0.08
362	300151	昌红科技	46,100	834,410.00	0.08
363	300855	图南股份	23,500	830,020.00	0.08
364	002847	盐津铺子	9,750	829,237.50	0.08
365	001267	汇绿生态	148,100	826,398.00	0.08
366	000050	深天马 A	88,800	815,184.00	0.08
367	601619	嘉泽新能	178,500	812,175.00	0.08
368	002461	珠江啤酒	91,500	806,115.00	0.08
369	002925	盈趣科技	41,300	801,220.00	0.07
370	600681	百川能源	169,600	792,032.00	0.07

371	601138	工业富联	31,400	791,280.00	0.07
372	601607	上海医药	35,300	791,073.00	0.07
373	688137	近岸蛋白	15,300	787,644.00	0.07
374	002198	嘉应制药	87,500	784,875.00	0.07
375	002727	一心堂	29,700	784,080.00	0.07
376	601128	常熟银行	114,600	781,572.00	0.07
377	001965	招商公路	81,200	779,520.00	0.07
378	600489	中金黄金	75,400	778,882.00	0.07
379	601163	三角轮胎	48,800	774,456.00	0.07
380	301005	超捷股份	26,900	769,340.00	0.07
381	600061	国投资本	106,800	760,416.00	0.07
382	600724	宁波富达	206,800	758,956.00	0.07
383	300277	海联讯	96,800	758,912.00	0.07
384	300998	宁波方正	25,300	758,747.00	0.07
385	000967	盈峰环境	149,800	756,490.00	0.07
386	000568	泸州老窖	3,600	754,452.00	0.07
387	002979	雷赛智能	31,700	753,192.00	0.07
388	300388	节能国祯	112,000	751,520.00	0.07
389	688617	惠泰医疗	2,000	747,500.00	0.07
390	688519	南亚新材	31,000	744,930.00	0.07
391	002287	奇正藏药	31,000	740,900.00	0.07
392	002389	航天彩虹	33,300	739,593.00	0.07
393	600025	华能水电	103,000	734,390.00	0.07
394	002659	凯文教育	153,600	734,208.00	0.07
395	688096	京源环保	74,560	733,670.40	0.07
396	002238	天威视讯	105,200	729,036.00	0.07
397	601010	文峰股份	297,100	727,895.00	0.07
398	600909	华安证券	155,100	724,317.00	0.07
399	601326	秦港股份	213,900	722,982.00	0.07
400	688037	芯源微	4,148	709,100.60	0.07
401	301099	雅创电子	13,600	708,016.00	0.07
402	300136	信维通信	34,900	700,792.00	0.07
403	688338	赛科希德	12,600	698,670.00	0.07
404	603027	千禾味业	32,920	695,270.40	0.06
405	603677	奇精机械	51,000	690,030.00	0.06
406	000915	华特达因	19,400	684,626.00	0.06
407	300428	立中集团	29,400	677,964.00	0.06
408	603226	菲林格尔	131,600	671,160.00	0.06
409	603535	嘉诚国际	40,700	660,968.00	0.06
410	600876	凯盛新能	41,100	655,956.00	0.06
411	603499	翔港科技	68,600	654,444.00	0.06
412	002811	郑中设计	82,200	651,846.00	0.06
413	603706	东方环宇	43,100	648,655.00	0.06

414	605300	佳禾食品	29,453	640,308.22	0.06
415	688215	瑞晟智能	16,100	634,984.00	0.06
416	688618	三旺通信	9,308	630,337.76	0.06
417	300009	安科生物	62,800	628,000.00	0.06
418	600380	健康元	49,400	627,874.00	0.06
419	002712	思美传媒	95,700	627,792.00	0.06
420	601211	国泰君安	44,751	626,066.49	0.06
421	002142	宁波银行	24,700	624,910.00	0.06
422	000685	中山公用	82,500	624,525.00	0.06
423	002324	普利特	43,500	620,745.00	0.06
424	600977	中国电影	43,800	615,390.00	0.06
425	002056	横店东磁	33,600	611,856.00	0.06
426	003028	振邦智能	14,500	606,245.00	0.06
427	688667	菱电电控	8,100	604,503.00	0.06
428	300101	振芯科技	30,700	595,273.00	0.06
429	300232	洲明科技	63,600	581,304.00	0.05
430	002937	兴瑞科技	23,400	575,640.00	0.05
431	605288	凯迪股份	13,300	572,432.00	0.05
432	000627	天茂集团	190,700	572,100.00	0.05
433	002371	北方华创	1,800	571,770.00	0.05
434	000589	贵州轮胎	101,700	569,520.00	0.05
435	600835	上海机电	33,100	568,658.00	0.05
436	002797	第一创业	99,400	568,568.00	0.05
437	300286	安科瑞	15,000	567,900.00	0.05
438	600635	大众公用	169,400	562,408.00	0.05
439	605098	行动教育	14,200	562,178.00	0.05
440	300866	安克创新	6,400	560,000.00	0.05
441	600989	宝丰能源	44,400	559,884.00	0.05
442	002851	麦格米特	15,300	557,991.00	0.05
443	300653	正海生物	16,200	557,118.00	0.05
444	603969	银龙股份	119,700	553,014.00	0.05
445	603950	长源东谷	36,900	552,024.00	0.05
446	600026	中远海能	43,600	551,104.00	0.05
447	002106	莱宝高科	64,300	546,550.00	0.05
448	688350	富淼科技	32,104	545,446.96	0.05
449	301106	骏成科技	15,300	544,986.00	0.05
450	001209	洪兴股份	30,460	542,492.60	0.05
451	688006	杭可科技	17,680	538,709.60	0.05
452	603729	龙韵股份	36,000	537,480.00	0.05
453	300993	玉马遮阳	46,900	537,005.00	0.05
454	002454	松芝股份	62,900	532,763.00	0.05
455	601186	中国铁建	53,600	527,960.00	0.05
456	601668	中国建筑	91,700	526,358.00	0.05

457	002959	小熊电器	6,300	526,050.00	0.05
458	688007	光峰科技	25,200	525,420.00	0.05
459	603871	嘉友国际	33,200	521,572.00	0.05
460	603289	泰瑞机器	46,300	519,486.00	0.05
461	603725	天安新材	63,800	518,694.00	0.05
462	600901	江苏金租	125,500	518,315.00	0.05
463	603517	绝味食品	13,900	516,385.00	0.05
464	688588	凌志软件	33,200	516,260.00	0.05
465	600369	西南证券	141,400	516,110.00	0.05
466	603326	我乐家居	65,900	514,679.00	0.05
467	601555	东吴证券	73,900	512,866.00	0.05
468	002724	海洋王	59,000	512,120.00	0.05
469	000785	居然之家	132,700	505,587.00	0.05
470	688389	普门科技	21,500	505,035.00	0.05
471	688428	诺诚健华	43,700	504,735.00	0.05
472	603236	移远通信	8,741	504,443.11	0.05
473	300130	新国都	17,800	504,274.00	0.05
474	002250	联化科技	47,800	499,988.00	0.05
475	688301	奕瑞科技	1,767	499,053.81	0.05
476	601818	光大银行	162,400	498,568.00	0.05
477	600158	中体产业	48,800	495,808.00	0.05
478	300832	新产业	8,300	489,700.00	0.05
479	002415	海康威视	14,600	483,406.00	0.04
480	688356	键凯科技	4,523	481,925.65	0.04
481	002996	顺博合金	39,800	481,580.00	0.04
482	002988	豪美新材	28,000	478,520.00	0.04
483	002967	广电计量	23,800	478,142.00	0.04
484	300445	康斯特	29,800	472,330.00	0.04
485	300661	圣邦股份	5,720	469,783.60	0.04
486	601500	通用股份	113,900	465,851.00	0.04
487	600562	国睿科技	28,500	461,700.00	0.04
488	603177	德创环保	36,800	459,264.00	0.04
489	000516	国际医学	54,500	458,345.00	0.04
490	000998	隆平高科	29,500	452,825.00	0.04
491	600985	淮北矿业	39,200	451,584.00	0.04
492	605168	三人行	5,220	448,606.80	0.04
493	603012	创力集团	72,300	446,091.00	0.04
494	002635	安洁科技	32,300	445,740.00	0.04
495	600919	江苏银行	60,400	443,940.00	0.04
496	600271	航天信息	32,400	443,556.00	0.04
497	688026	洁特生物	24,000	438,480.00	0.04
498	600487	亨通光电	29,800	436,868.00	0.04
499	600626	申达股份	126,500	436,425.00	0.04

500	000928	中钢国际	45,200	436,180.00	0.04
501	600927	永安期货	26,700	434,142.00	0.04
502	688619	罗普特	28,800	432,864.00	0.04
503	600837	海通证券	46,700	430,574.00	0.04
504	603801	志邦家居	12,800	422,656.00	0.04
505	600248	陕建股份	88,600	422,622.00	0.04
506	600182	S 佳通	26,400	418,176.00	0.04
507	601369	陕鼓动力	45,400	413,594.00	0.04
508	601699	潞安环能	25,200	411,264.00	0.04
509	600602	云赛智联	27,300	411,138.00	0.04
510	002920	德赛西威	2,600	405,106.00	0.04
511	002158	汉钟精机	16,200	404,352.00	0.04
512	688626	翔宇医疗	8,800	400,488.00	0.04
513	600511	国药股份	10,300	400,155.00	0.04
514	000686	东北证券	57,600	399,744.00	0.04
515	688396	华润微	7,500	393,075.00	0.04
516	002612	朗姿股份	16,500	392,370.00	0.04
517	002494	华斯股份	84,600	391,698.00	0.04
518	301291	明阳电气	12,054	391,066.98	0.04
519	600329	达仁堂	8,700	390,543.00	0.04
520	600990	四创电子	12,300	389,172.00	0.04
521	600266	城建发展	75,400	383,032.00	0.04
522	300865	大宏立	17,600	380,512.00	0.04
523	300889	爱克股份	25,200	377,244.00	0.04
524	000603	盛达资源	31,200	377,208.00	0.04
525	605339	南侨食品	18,800	374,308.00	0.03
526	002867	周大生	21,000	373,380.00	0.03
527	603682	锦和商管	70,800	371,700.00	0.03
528	301047	义翘神州	4,300	368,510.00	0.03
529	688083	中望软件	2,540	368,020.60	0.03
530	601003	柳钢股份	90,800	366,832.00	0.03
531	002736	国信证券	41,900	365,787.00	0.03
532	601390	中国中铁	47,900	363,082.00	0.03
533	603308	应流股份	19,800	362,340.00	0.03
534	600054	黄山旅游	28,100	359,680.00	0.03
535	603303	得邦照明	26,000	359,060.00	0.03
536	603669	灵康药业	76,900	357,585.00	0.03
537	000883	湖北能源	77,300	352,488.00	0.03
538	603186	华正新材	10,200	350,880.00	0.03
539	688023	安恒信息	2,000	349,420.00	0.03
540	688379	华光新材	17,000	345,270.00	0.03
541	300638	广和通	15,200	344,736.00	0.03
542	688318	财富趋势	3,400	339,898.00	0.03

543	300856	科思股份	4,300	338,711.00	0.03
544	688018	乐鑫科技	2,600	337,532.00	0.03
545	300034	钢研高纳	8,400	330,876.00	0.03
546	605499	东鹏饮料	1,900	328,510.00	0.03
547	002397	梦洁股份	94,500	327,915.00	0.03
548	000906	浙商中拓	36,700	327,364.00	0.03
549	002244	滨江集团	36,900	325,458.00	0.03
550	300910	瑞丰新材	6,450	324,435.00	0.03
551	603920	世运电路	16,500	322,245.00	0.03
552	600338	西藏珠峰	17,400	317,724.00	0.03
553	603848	好太太	19,800	316,800.00	0.03
554	688202	美迪西	3,700	315,425.00	0.03
555	688681	科汇股份	19,500	315,120.00	0.03
556	002270	华明装备	28,700	314,265.00	0.03
557	603496	恒为科技	16,640	312,499.20	0.03
558	301043	绿岛风	9,600	306,912.00	0.03
559	000698	沈阳化工	73,900	303,729.00	0.03
560	688683	莱尔科技	13,600	302,600.00	0.03
561	605056	咸亨国际	21,200	300,404.00	0.03
562	603309	维力医疗	19,300	298,571.00	0.03
563	688072	拓荆科技	700	298,179.00	0.03
564	688109	品茗科技	11,428	295,985.20	0.03
565	300777	中简科技	6,200	293,012.00	0.03
566	603979	金诚信	9,400	292,340.00	0.03
567	002327	富安娜	34,400	289,648.00	0.03
568	688186	广大特材	8,900	289,517.00	0.03
569	688408	中信博	3,400	286,722.00	0.03
570	002976	瑞玛精密	10,200	285,294.00	0.03
571	002344	海宁皮城	60,300	285,219.00	0.03
572	002484	江海股份	13,300	283,157.00	0.03
573	301486	致尚科技	4,820	277,921.20	0.03
574	603833	欧派家居	2,900	277,820.00	0.03
575	688611	杭州柯林	6,400	274,240.00	0.03
576	601968	宝钢包装	38,000	273,600.00	0.03
577	000551	创元科技	24,493	272,117.23	0.03
578	002533	金杯电工	33,000	269,280.00	0.03
579	002242	九阳股份	18,000	269,100.00	0.03
580	603989	艾华集团	12,700	267,462.00	0.02
581	600183	生益科技	18,800	266,960.00	0.02
582	601808	中海油服	19,100	265,108.00	0.02
583	688219	会通股份	27,617	263,742.35	0.02
584	603056	德邦股份	17,100	263,682.00	0.02
585	002899	英派斯	17,500	261,975.00	0.02

586	600570	恒生电子	5,900	261,311.00	0.02
587	300115	长盈精密	21,800	259,638.00	0.02
588	688689	银河微电	10,000	258,000.00	0.02
589	002697	红旗连锁	42,600	248,784.00	0.02
590	601991	大唐发电	74,700	247,257.00	0.02
591	603589	口子窖	5,000	246,750.00	0.02
592	002435	长江健康	50,200	244,474.00	0.02
593	600020	中原高速	66,100	242,587.00	0.02
594	300747	锐科激光	7,800	237,744.00	0.02
595	688398	赛特新材	6,955	237,513.25	0.02
596	688310	迈得医疗	7,200	235,944.00	0.02
597	603609	禾丰股份	24,800	225,680.00	0.02
598	688120	华海清科	894	225,332.70	0.02
599	000629	钒钛股份	57,100	223,261.00	0.02
600	300144	宋城演艺	18,000	223,200.00	0.02
601	601456	国联证券	24,000	218,400.00	0.02
602	301326	捷邦科技	5,727	217,797.81	0.02
603	603886	元祖股份	11,800	216,412.00	0.02
604	603600	永艺股份	22,400	213,024.00	0.02
605	600552	凯盛科技	17,800	210,752.00	0.02
606	300718	长盛轴承	9,400	209,150.00	0.02
607	688016	心脉医疗	1,158	208,301.04	0.02
608	603320	迪贝电气	14,000	203,560.00	0.02
609	603876	鼎胜新材	10,480	201,111.20	0.02
610	603103	横店影视	11,900	200,396.00	0.02
611	300512	中亚股份	21,600	195,696.00	0.02
612	002683	广东宏大	6,600	194,304.00	0.02
613	002176	江特电机	16,000	190,720.00	0.02
614	688106	金宏气体	7,000	190,400.00	0.02
615	300930	屹通新材	7,600	189,620.00	0.02
616	688122	西部超导	3,360	187,252.80	0.02
617	688386	泛亚微透	4,415	185,430.00	0.02
618	300679	电连技术	5,600	185,080.00	0.02
619	002154	报喜鸟	33,500	184,920.00	0.02
620	688685	迈信林	8,727	184,663.32	0.02
621	603390	通达电气	21,700	182,280.00	0.02
622	002050	三花智控	6,000	181,560.00	0.02
623	603689	皖天然气	20,700	181,539.00	0.02
624	300762	上海瀚讯	15,300	180,081.00	0.02
625	002126	银轮股份	10,100	178,770.00	0.02
626	688293	奥浦迈	3,700	176,379.00	0.02
627	002852	道道全	13,600	175,848.00	0.02
628	601088	中国神华	5,700	175,275.00	0.02

629	603369	今世缘	3,300	174,240.00	0.02
630	002738	中矿资源	3,380	172,177.20	0.02
631	600612	老凤祥	2,400	167,712.00	0.02
632	603529	爱玛科技	5,200	167,544.00	0.02
633	688660	电气风电	29,800	165,986.00	0.02
634	600066	宇通客车	11,100	163,614.00	0.02
635	601825	沪农商行	29,200	159,140.00	0.01
636	300873	海晨股份	8,000	159,120.00	0.01
637	300304	云意电气	28,400	157,336.00	0.01
638	603279	景津装备	5,000	156,800.00	0.01
639	300133	华策影视	21,900	155,271.00	0.01
640	300691	联合光电	8,800	155,056.00	0.01
641	301397	溯联股份	3,618	152,606.80	0.01
642	600754	锦江酒店	3,600	152,424.00	0.01
643	002900	哈三联	11,300	151,081.00	0.01
644	002182	云海金属	6,800	149,532.00	0.01
645	603180	金牌厨柜	4,400	147,488.00	0.01
646	002887	绿茵生态	16,000	145,440.00	0.01
647	002973	侨银股份	12,500	145,000.00	0.01
648	301210	金杨股份	2,801	143,168.37	0.01
649	603059	倍加洁	6,200	140,988.00	0.01
650	600792	云煤能源	41,600	140,192.00	0.01
651	603915	国茂股份	6,600	139,788.00	0.01
652	688230	芯导科技	3,080	139,554.80	0.01
653	300622	博士眼镜	5,900	139,240.00	0.01
654	600958	东方证券	14,300	138,710.00	0.01
655	301395	仁信新材	5,196	138,629.28	0.01
656	603383	顶点软件	2,500	138,550.00	0.01
657	301268	铭利达	3,300	138,171.00	0.01
658	600702	舍得酒业	1,100	136,345.00	0.01
659	000096	广聚能源	16,900	135,538.00	0.01
660	002861	瀛通通讯	11,700	133,848.00	0.01
661	000538	云南白药	2,500	131,200.00	0.01
662	600229	城市传媒	15,200	129,504.00	0.01
663	605155	西大门	8,900	129,139.00	0.01
664	601098	中南传媒	11,100	128,760.00	0.01
665	601766	中国中车	19,200	124,800.00	0.01
666	600926	杭州银行	10,600	124,550.00	0.01
667	603885	吉祥航空	7,700	118,811.00	0.01
668	301292	海科新源	5,824	116,421.76	0.01
669	002508	老板电器	4,600	116,334.00	0.01
670	688270	臻镭科技	1,766	114,666.38	0.01
671	002020	京新药业	8,600	110,252.00	0.01

672	300123	亚光科技	14,700	107,016.00	0.01
673	002664	信质集团	7,600	107,008.00	0.01
674	002695	煌上煌	9,800	104,762.00	0.01
675	688249	晶合集成	5,800	104,748.00	0.01
676	002048	宁波华翔	7,800	104,520.00	0.01
677	301488	豪恩汽电	2,618	104,144.04	0.01
678	300245	天玑科技	10,900	104,095.00	0.01
679	603386	骏亚科技	9,100	103,285.00	0.01
680	300207	欣旺达	6,300	102,816.00	0.01
681	301029	怡合达	2,300	102,764.00	0.01
682	300127	银河磁体	5,600	101,528.00	0.01
683	000550	江铃汽车	7,200	99,648.00	0.01
684	300474	景嘉微	1,100	98,989.00	0.01
685	300699	光威复材	3,200	98,720.00	0.01
686	300405	科隆股份	17,800	97,366.00	0.01
687	300418	昆仑万维	2,400	96,672.00	0.01
688	003021	兆威机电	1,100	96,503.00	0.01
689	002160	常铝股份	23,800	96,152.00	0.01
690	688079	美迪凯	8,500	95,115.00	0.01
691	002837	英维克	3,100	92,814.00	0.01
692	000651	格力电器	2,500	91,275.00	0.01
693	002335	科华数据	2,500	89,875.00	0.01
694	300738	奥飞数据	8,800	89,760.00	0.01
695	600997	开滦股份	15,000	89,550.00	0.01
696	002518	科士达	2,200	88,022.00	0.01
697	300827	上能电气	2,430	87,601.50	0.01
698	600638	新黄浦	16,500	87,285.00	0.01
699	603958	哈森股份	11,200	85,904.00	0.01
700	002233	塔牌集团	11,000	84,920.00	0.01
701	002133	广宇集团	25,000	84,750.00	0.01
702	603598	引力传媒	8,100	84,726.00	0.01
703	688143	长盈通	2,210	83,317.00	0.01
704	600015	华夏银行	15,300	82,773.00	0.01
705	002283	天润工业	12,700	81,534.00	0.01
706	000933	神火股份	6,200	80,600.00	0.01
707	000990	诚志股份	10,500	80,010.00	0.01
708	300644	南京聚隆	4,300	79,894.00	0.01
709	301202	朗威股份	3,060	79,009.20	0.01
710	300395	菲利华	1,600	78,720.00	0.01
711	600689	上海三毛	8,300	77,605.00	0.01
712	300804	广康生化	2,257	77,134.83	0.01
713	688603	天承科技	1,391	76,505.00	0.01
714	000548	湖南投资	15,800	76,472.00	0.01

715	601869	长飞光纤	2,000	74,020.00	0.01
716	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	0.01
717	000630	铜陵有色	24,800	71,672.00	0.01
718	603456	九洲药业	2,600	71,188.00	0.01
719	600598	北大荒	5,300	70,649.00	0.01
720	603639	海利尔	3,900	69,888.00	0.01
721	000778	新兴铸管	17,100	69,768.00	0.01
722	603688	石英股份	600	68,304.00	0.01
723	688133	泰坦科技	800	68,152.00	0.01
724	603566	普莱柯	2,900	67,425.00	0.01
725	688788	科思科技	1,600	66,320.00	0.01
726	600184	光电股份	5,000	65,650.00	0.01
727	688472	阿特斯	3,840	65,433.60	0.01
728	688029	南微医学	800	65,248.00	0.01
729	603290	斯达半导	300	64,560.00	0.01
729	601689	拓普集团	800	64,560.00	0.01
731	000027	深圳能源	9,700	63,923.00	0.01
732	002566	益盛药业	7,500	62,400.00	0.01
733	301006	迈拓股份	2,300	60,145.00	0.01
734	300770	新媒股份	1,300	59,618.00	0.01
735	603238	诺邦股份	4,700	59,267.00	0.01
736	603868	飞科电器	900	56,781.00	0.01
737	688601	力芯微	1,200	56,520.00	0.01
738	002351	漫步者	2,700	55,836.00	0.01
739	688383	新益昌	400	55,688.00	0.01
740	301087	可孚医疗	1,100	54,230.00	0.01
741	688361	中科飞测	831	53,740.77	0.00
742	600166	福田汽车	15,800	53,720.00	0.00
743	000560	我爱我家	19,500	51,675.00	0.00
744	688469	中芯集成	9,439	51,064.99	0.00
745	688536	思瑞浦	234	51,012.00	0.00
746	688278	特宝生物	1,116	49,003.56	0.00
747	000762	西藏矿业	1,600	47,408.00	0.00
748	601658	邮储银行	9,600	46,944.00	0.00
749	688200	华峰测控	298	45,594.00	0.00
750	300308	中际旭创	300	44,235.00	0.00
751	000807	云铝股份	3,400	43,282.00	0.00
752	688063	派能科技	200	39,650.00	0.00
753	301325	曼恩斯特	364	39,293.80	0.00
754	300547	川环科技	2,300	38,341.00	0.00
755	603368	柳药集团	1,500	37,065.00	0.00
756	000605	渤海股份	5,700	36,024.00	0.00
757	688227	品高股份	1,439	35,730.37	0.00

758	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.00
759	002829	星网宇达	800	35,144.00	0.00
760	002148	北纬科技	5,700	34,770.00	0.00
761	601898	中煤能源	4,100	34,604.00	0.00
762	002841	视源股份	500	33,420.00	0.00
763	688531	日联科技	225	30,593.25	0.00
764	688576	西山科技	240	28,898.40	0.00
765	601007	金陵饭店	3,300	28,116.00	0.00
766	688146	中船特气	732	27,911.16	0.00
767	300751	迈为股份	160	27,100.80	0.00
768	600420	国药现代	2,400	27,096.00	0.00
769	301310	鑫宏业	409	26,760.87	0.00
770	688582	芯动联科	648	26,360.64	0.00
771	688352	颀中科技	2,157	26,034.99	0.00
772	688484	南芯科技	692	25,403.32	0.00
773	300795	米奥会展	600	25,026.00	0.00
774	301293	三博脑科	333	23,782.86	0.00
775	301358	湖南裕能	550	23,589.50	0.00
776	001287	中电港	1,086	22,827.72	0.00
777	688552	航天南湖	956	22,466.00	0.00
778	688570	天玛智控	884	22,391.72	0.00
779	603156	养元饮品	900	22,230.00	0.00
780	301307	美利信	687	21,887.82	0.00
781	688543	国科军工	410	21,750.50	0.00
782	300769	德方纳米	192	21,164.16	0.00
783	688507	索辰科技	172	21,002.92	0.00
784	300763	锦浪科技	200	20,820.00	0.00
785	601077	渝农商行	5,700	20,463.00	0.00
786	301303	真兰仪表	910	20,311.20	0.00
787	688458	美芯晟	221	20,057.96	0.00
788	002016	世荣兆业	2,900	19,314.00	0.00
789	688581	安杰思	163	19,238.89	0.00
790	000937	冀中能源	3,000	19,140.00	0.00
791	301317	鑫磊股份	694	18,161.98	0.00
792	301262	海看股份	692	17,646.00	0.00
793	301383	天键股份	493	17,609.96	0.00
794	688095	福昕软件	134	16,934.92	0.00
795	688562	航天软件	726	16,197.06	0.00
796	688623	双元科技	178	15,448.62	0.00
797	301246	宏源药业	503	15,447.13	0.00
798	301332	德尔玛	1,122	15,405.06	0.00
799	301399	英特科技	293	15,110.01	0.00
800	301305	朗坤环境	753	14,826.57	0.00

801	301387	光大同创	307	13,925.52	0.00
802	688512	慧智微	721	13,814.36	0.00
803	301382	蜂助手	408	13,398.72	0.00
804	688005	容百科技	248	13,396.96	0.00
805	688433	华曙高科	418	13,167.00	0.00
806	688330	宏力达	368	12,909.44	0.00
807	300329	海伦钢琴	1,800	12,726.00	0.00
808	301360	荣旗科技	134	12,408.40	0.00
809	301439	泓淋电力	709	11,982.10	0.00
810	688066	航天宏图	185	11,266.50	0.00
811	688523	航天环宇	472	11,257.20	0.00
812	603135	中重科技	628	11,234.92	0.00
813	301141	中科磁业	262	11,184.78	0.00
814	000010	美丽生态	4,900	11,172.00	0.00
815	301225	恒勃股份	333	11,075.58	0.00
816	301429	森泰股份	499	10,488.98	0.00
817	601065	江盐集团	859	10,170.56	0.00
818	600578	京能电力	2,600	10,166.00	0.00
819	688631	莱斯信息	336	10,036.32	0.00
820	688479	友车科技	332	9,790.68	0.00
821	301232	飞沃科技	165	9,639.30	0.00
822	301376	致欧科技	420	9,454.20	0.00
823	301355	南王科技	563	9,430.25	0.00
824	301357	北方长龙	190	9,194.10	0.00
825	301386	未来电器	378	8,992.62	0.00
826	301323	新莱福	228	8,974.08	0.00
827	688429	时创能源	346	8,833.38	0.00
828	688099	晶晨股份	104	8,769.28	0.00
829	301170	锡南科技	250	8,732.50	0.00
830	301281	科源制药	338	8,483.80	0.00
831	688258	卓易信息	124	8,274.52	0.00
832	688535	华海诚科	161	8,248.03	0.00
833	601133	柏诚股份	664	8,140.64	0.00
834	301157	华塑科技	150	7,939.50	0.00
835	301295	美硕科技	215	7,755.05	0.00
836	688198	佰仁医疗	73	7,746.03	0.00
837	301203	国泰环保	225	7,740.00	0.00
838	688196	卓越新能	160	7,400.00	0.00
839	301345	涛涛车业	156	7,275.84	0.00
840	301337	亚华电子	232	7,045.84	0.00
841	301428	世纪恒通	229	7,007.40	0.00
842	688089	嘉必优	200	5,960.00	0.00
843	688139	海尔生物	102	5,249.94	0.00

844	001380	华纬科技	170	5,232.60	0.00
845	301339	通行宝	200	5,026.00	0.00
846	002673	西部证券	700	4,445.00	0.00
847	603125	常青科技	160	3,924.80	0.00
848	001328	登康口腔	145	3,696.05	0.00
849	603613	国联股份	99	3,656.07	0.00
850	001282	三联锻造	105	3,468.15	0.00
851	688191	智洋创新	185	3,416.95	0.00
852	688329	艾隆科技	102	3,304.80	0.00
853	600531	豫光金铅	500	3,150.00	0.00
854	688233	神工股份	89	2,810.62	0.00
855	688030	山石网科	125	2,678.75	0.00
856	001360	南矿集团	177	2,631.99	0.00
857	688607	康众医疗	129	2,466.48	0.00
858	002459	晶澳科技	56	2,335.20	0.00
859	001324	长青科技	114	2,234.40	0.00
860	001367	海森药业	55	2,171.40	0.00
861	300037	新宙邦	40	2,075.60	0.00
862	603172	万丰股份	122	1,967.86	0.00
863	688168	安博通	46	1,637.60	0.00
864	688008	澜起科技	28	1,607.76	0.00
865	601225	陕西煤业	36	654.84	0.00
866	603610	麒盛科技	52	602.16	0.00
867	002839	张家港行	100	423.00	0.00
868	688020	方邦股份	6	299.82	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	601336	新华保险	12,883,882.98	3.58
2	600535	天士力	11,883,817.00	3.30
3	002918	蒙娜丽莎	11,512,226.00	3.20
4	003012	东鹏控股	11,366,967.00	3.16
5	000623	吉林敖东	11,324,653.00	3.15
6	688390	固德威	11,201,436.85	3.11
7	603605	珀莱雅	11,046,036.40	3.07
8	002739	万达电影	10,756,631.00	2.99
9	603613	国联股份	10,613,522.00	2.95
10	600201	生物股份	10,569,610.00	2.94
11	603993	洛阳钼业	10,414,590.00	2.89
12	000725	京东方 A	10,166,191.00	2.82

13	601958	金钼股份	10,157,868.00	2.82
14	688777	中控技术	9,756,263.35	2.71
15	600038	中直股份	9,592,232.30	2.67
16	600109	国金证券	9,485,941.00	2.64
17	600019	宝钢股份	9,385,430.32	2.61
18	002422	科伦药业	9,292,014.00	2.58
19	000426	兴业银锡	9,252,070.00	2.57
20	000567	海德股份	8,863,368.25	2.46
21	600908	无锡银行	8,733,038.00	2.43
22	001979	招商蛇口	8,631,650.00	2.40
23	000069	华侨城 A	8,524,980.00	2.37
24	002299	圣农发展	8,371,656.00	2.33
25	600845	宝信软件	8,325,649.00	2.31
26	300602	飞荣达	8,322,261.58	2.31
27	688819	天能股份	8,321,243.82	2.31
28	603113	金能科技	8,281,667.00	2.30
29	605009	豪悦护理	8,177,347.89	2.27
30	600985	淮北矿业	8,163,138.00	2.27
31	603208	江山欧派	8,144,071.70	2.26
32	600643	爱建集团	8,051,204.20	2.24
33	601857	中国石油	8,040,774.00	2.23
34	002594	比亚迪	8,039,346.00	2.23
35	600315	上海家化	7,993,658.84	2.22
36	000987	越秀资本	7,973,314.40	2.22
37	600827	百联股份	7,956,188.48	2.21
38	002294	信立泰	7,940,497.00	2.21
39	002064	华峰化学	7,850,830.00	2.18
40	601966	玲珑轮胎	7,773,603.00	2.16
41	002032	苏泊尔	7,723,946.00	2.15
42	600583	海油工程	7,679,550.00	2.13
43	002410	广联达	7,675,328.00	2.13
44	601333	广深铁路	7,655,048.00	2.13
45	002020	京新药业	7,627,811.00	2.12
46	300143	盈康生命	7,608,622.91	2.11
47	002027	分众传媒	7,552,382.00	2.10
48	601137	博威合金	7,548,786.00	2.10
49	600968	海油发展	7,452,331.00	2.07
50	300115	长盈精密	7,361,951.00	2.05
51	002698	博实股份	7,293,499.25	2.03
52	688012	中微公司	7,277,613.80	2.02
53	002938	鹏鼎控股	7,207,250.00	2.00
54	688050	爱博医疗	7,201,898.93	2.00
55	601600	中国铝业	7,201,736.00	2.00

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	002294	信立泰	10,845,759.00	3.01
2	600201	生物股份	10,353,911.00	2.88
3	600109	国金证券	10,164,769.00	2.82
4	002594	比亚迪	10,153,143.35	2.82
5	300115	长盈精密	9,872,788.00	2.74
6	000729	燕京啤酒	9,619,259.24	2.67
7	601336	新华保险	9,537,507.00	2.65
8	300017	网宿科技	9,522,535.00	2.65
9	300602	飞荣达	9,364,277.00	2.60
10	601333	广深铁路	9,328,700.00	2.59
11	002020	京新药业	9,221,887.40	2.56
12	002422	科伦药业	9,003,464.98	2.50
13	000048	京基智农	8,866,498.00	2.46
14	000426	兴业银锡	8,561,284.00	2.38
15	603993	洛阳钼业	8,138,016.00	2.26
16	600535	天士力	8,047,826.00	2.24
17	601319	中国人保	8,039,182.00	2.23
18	600066	宇通客车	8,033,795.69	2.23
19	603613	国联股份	7,945,231.50	2.21
20	601998	中信银行	7,913,621.40	2.20
21	600985	淮北矿业	7,755,823.00	2.16
22	605009	豪悦护理	7,524,589.42	2.09
23	000878	云南铜业	7,446,204.00	2.07
24	601857	中国石油	7,439,373.00	2.07
25	000543	皖能电力	7,409,025.00	2.06
26	000623	吉林敖东	7,216,748.00	2.01

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	2,880,373,754.80
卖出股票收入（成交）总额	2,263,136,093.39

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末无国债期货投资。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货投资。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，盈康生命科技股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责、处罚的情况。本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

7.12.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,477,006.99
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	3,124,817.65

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,601,824.64

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
华夏智胜价值成长股票 A	32,665	7,617.56	198,631,708.09	79.83%	50,195,789.46	20.17%
华夏智胜价值成长股票 C	17,989	24,450.10	380,493,168.92	86.51%	59,339,631.86	13.49%
合计	50,654	13,595.38	579,124,877.01	84.09%	109,535,421.32	15.91%

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	597,176.47	0.24%
	华夏智胜价值成长股票 C	39,689.46	0.01%
	合计	636,865.93	0.09%

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	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

门负责人持有 本开放式基金		
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
	华夏智胜价值成长股票 C	0
	合计	0

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	65,306,145.82	190,848,098.17
本报告期基金总申购份额	203,157,454.14	506,281,760.49
减:本报告期基金总赎回份额	19,636,102.41	257,297,057.88
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	248,827,497.55	439,832,800.78

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内,本基金无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内,本基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内,本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期未发生影响基金管理人经营或基金运营业务的诉讼。

本报告期无涉及基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金所聘用的会计师事务所未发生改变。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人及其高级管理人员在本报告期内无受稽查或处罚等情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
招商证券	6	1,436,298,831.01	28.01%	619,450.56	29.18%	-
中信证券	11	1,219,834,049.96	23.79%	437,438.34	20.60%	-
中信建投证券	4	856,054,328.29	16.69%	369,208.31	17.39%	-
兴业证券	1	772,077,638.60	15.06%	333,008.64	15.68%	-
西部证券	1	471,855,093.93	9.20%	203,514.32	9.59%	-
中金公司	4	372,250,347.47	7.26%	160,558.15	7.56%	-

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、华泰证券、华西证券、江海证券、金元证券、联储证券、平安证券、上海证券、申万宏源证券、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，国泰君安证券的部分交易单元为本基金本期新增的交易单元。本期没有剔除的券商交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
招商证券	380,028.84	27.35%	-	-	-	-	-	-
中信证券	201,998.58	14.54%	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	187,795.31	13.51%	-	-	-	-	-	-
兴业证券	236,652.64	17.03%	-	-	-	-	-	-
西部证券	240,287.79	17.29%	-	-	-	-	-	-
中金公司	142,779.40	10.28%	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华夏基金管理有限公司公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-01-06
2	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-01-19
3	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-02-24
4	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-03-03
5	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-03-11
6	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-03-23

7	华夏基金管理有限公司关于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	2023-03-28
8	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-03-30
9	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-04-01
10	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-04-13
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	2023-04-15
12	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-04-27
13	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-05-13
14	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-05-27
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	2023-05-31

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20% 的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2023-01-01 至 2023-02-01	69,557,649.66	76,962,792.11	69,557,649.66	76,962,792.11	11.18%

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

二〇二三年八月三十日