

**华夏中证光伏产业指数发起式  
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.....	6
§5 托管人报告.....	13
§6 中期报告财务会计报告（未经审计）.....	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	15
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	17
§7 投资组合报告.....	85
7.1 期末基金资产组合情况.....	85
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	85
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.....	86
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	89
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	90
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.....	91
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.....	91
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.....	91
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.....	91
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	91
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	91
7.12 投资组合报告附注.....	91
§8 基金份额持有人信息.....	92
§9 开放式基金份额变动.....	93
§10 重大事件揭示.....	94
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	96
§12 备查文件目录.....	96

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华夏中证光伏产业指数发起式证券投资基金	
基金简称	华夏中证光伏产业指数发起式	
基金主代码	012885	
交易代码	012885	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 8 月 17 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	668,451,899.19 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华夏中证光伏产业指数发起式 A	华夏中证光伏产业指数发起式 C
下属分级基金的交易代码	012885	012886
报告期末下属分级基金的份额总额	322,595,641.39 份	345,856,257.80 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，实现与标的指数表现相一致的长期投资收益。在正常市场情况下，力争控制本基金的份额净值与业绩比较基准的收益率日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。
投资策略	主要投资策略包括股票投资策略，存托凭证投资策略，债券投资策略，资产支持证券投资策略，衍生品投资策略，融资、转融通证券出借业务投资策略等。
业绩比较基准	中证光伏产业指数收益率×95%+人民币活期存款税后利率×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

### 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	《中国证券报》
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）	
	华夏中证光伏产业指数发起式 A	华夏中证光伏产业指数发起式 C
本期已实现收益	-8,512,058.73	-9,475,461.47
本期利润	-21,017,426.53	-21,819,987.23
加权平均基金份额本期利润	-0.0714	-0.0752
本期加权平均净值利润率	-9.04%	-9.64%
本期基金份额净值增长率	-8.27%	-8.39%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)	
	华夏中证光伏产业指数发起式 A	华夏中证光伏产业指数发起式 C
期末可供分配利润	-81,117,194.34	-88,409,192.26
期末可供分配基金份额利润	-0.2515	-0.2556
期末基金资产净值	241,478,447.05	257,447,065.54
期末基金份额净值	0.7485	0.7444
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)	
	华夏中证光伏产业指数发起式 A	华夏中证光伏产业指数发起式 C

基金份额累计净值增长率	-25.15%	-25.56%
-------------	---------	---------

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

##### 华夏中证光伏产业指数发起式 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
过去一个月	5.07%	1.53%	4.90%	1.54%	0.17%	-0.01%
过去三个月	-6.25%	1.73%	-7.61%	1.75%	1.36%	-0.02%
过去六个月	-8.27%	1.59%	-9.79%	1.61%	1.52%	-0.02%
过去一年	-24.42%	1.87%	-25.91%	1.88%	1.49%	-0.01%
自基金合同生效起至今	-25.15%	2.00%	-22.68%	2.09%	-2.47%	-0.09%

##### 华夏中证光伏产业指数发起式 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
过去一个月	5.05%	1.53%	4.90%	1.54%	0.15%	-0.01%
过去三个月	-6.32%	1.73%	-7.61%	1.75%	1.29%	-0.02%
过去六个月	-8.39%	1.59%	-9.79%	1.61%	1.40%	-0.02%
过去一年	-24.64%	1.87%	-25.91%	1.88%	1.27%	-0.01%
自基金合同生效起至今	-25.56%	2.00%	-22.68%	2.09%	-2.88%	-0.09%

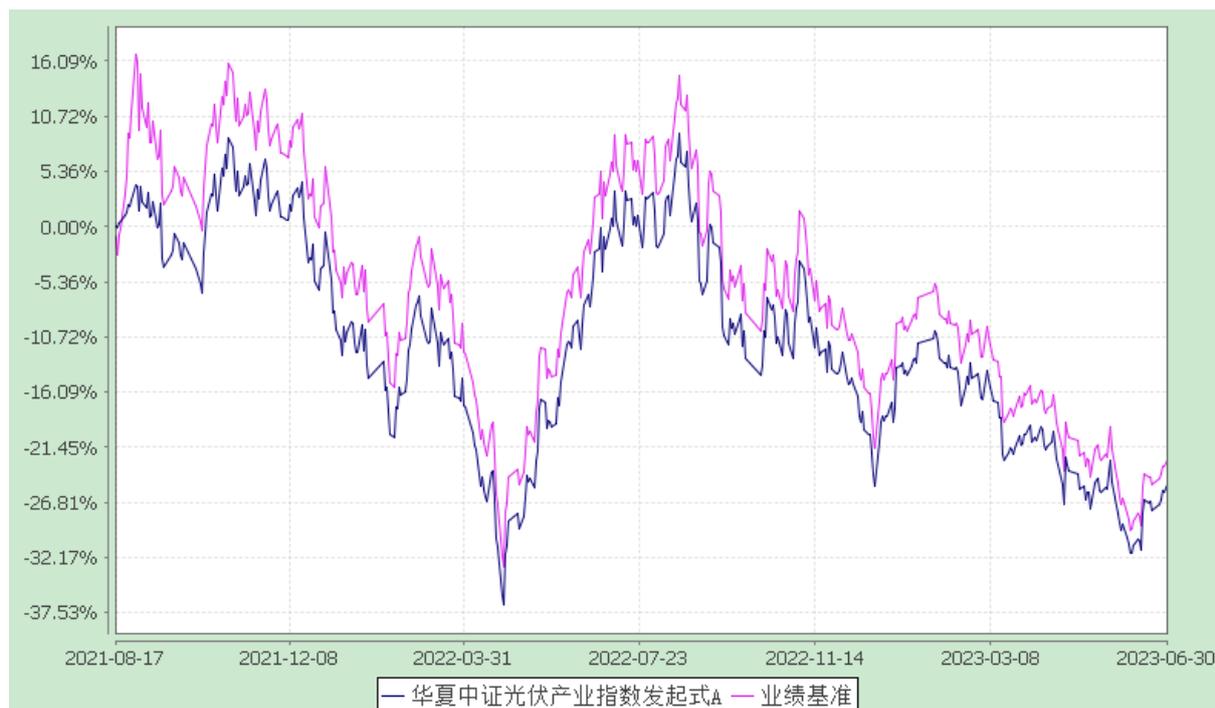
#### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

##### 华夏中证光伏产业指数发起式证券投资基金

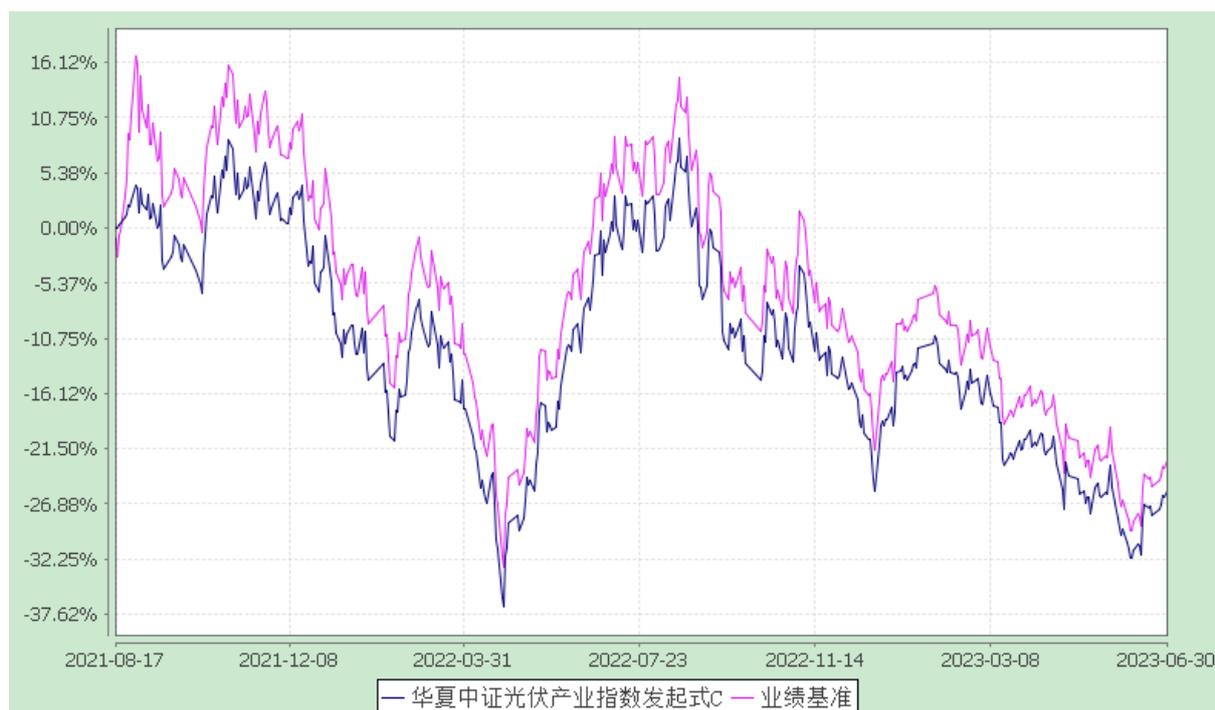
##### 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2021 年 8 月 17 日至 2023 年 6 月 30 日)

##### 华夏中证光伏产业指数发起式 A



华夏中证光伏产业指数发起式 C



## §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		
李俊	本基金的 基金经理	2021-08-17	-	15 年	硕士。曾任职于北京市金杜律师事务所证券部。2008 年 12 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、华夏新趋势灵活配置混合型证券投资基金基金经理（2018 年 1 月 17 日至 2021 年 5 月 26 日期间）、华夏新锦绣灵活配置混合型证券投资基金基金经理（2019 年 1 月 31 日至 2021 年 5 月 26 日期间）、华夏中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2019 年 9 月 17 日至 2021 年 12 月 13 日期间）、华夏中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理（2020 年 4 月 3 日至 2021 年 12 月 13 日期间）、上证金融地产交易型开放式指数发起式证券投资基金基金经理（2017 年 12 月 11 日至 2022 年 3 月 14 日期间）、华夏中证智能汽车主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2021 年 5 月 13 日至 2022 年 8 月 22 日期间）、上证医药卫生交易型开放式指数发起式证券投资基金基金经理（2021 年 5 月 27 日至 2022 年 8 月 22 日期间）等。

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

②证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基

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

#### 4.3 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

本基金跟踪的标的指数为中证光伏产业指数，基金业绩比较基准为：中证光伏产业指数收益率  $\times 95\%$  + 人民币活期存款税后利率  $\times 5\%$ 。中证光伏产业指数从沪深市场主营业务涉及光伏产业链上、中、下游的上市公司证券中，选取不超过 50 只最具代表性上市公司证券作为指数样本，以反映沪深市场光伏产业上市公司证券的整体表现。本基金主要采取复制法，即按照标的指数成份股及其权重构建基金的股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动对股票投资组合进行相应地调整。

上半年，国际环境的现状，再次让我们真切地认识到，和平与发展的时代主题下，国际环境日趋复杂，不稳定性不确定性明显增加。我国发展仍处于重要战略机遇期，但机遇和挑战都有新的发展变化。当今世界，逆全球化已经成为一个无法回避的话题，其影响也逐渐在经济领域各个方面体现出来。

国内方面，年初市场对疫情政策放开后经济的自然修复有较强的预期，但几个月下来，经济并没有出现预料中的强劲修复，动能较差，投资受制于信心，消费受制于收入，尤其是之前表现较好的出口也面临较大的压力。当下中国经济修复动能较差，主要来自三重压力，内部的房地产政策、外部的美国蓄意与中国脱钩，以及三年疫情的冲击。这三个因素，几乎不留死角地，在不同层面、不同程度上冲击着中国的经济，尤其当这种冲击在很大程度上实现了时间上重叠、事件上共振时，

影响之大不言而喻。

从政策基调看，我们前期主要还是着眼长远，强调供给侧，积极而科学地破解科技难题，所以在需求政策方面保持了较强的定力；但我们面临的问题，除了科技领域的卡脖子，还有经济领域潜在的通缩风险，所以努力扩大内需，仍然是必要的。

面对当前的大环境与小周期，如何避免当年日本在资产价格暴跌和刚性负债诱发的资产负债表衰退，是我们需要认真思考的。经济其实是一个生态，如何让资产负债表较为健康的主体加杠杆，是非常重要的，除了中央政府加杠杆之外，其实还有资产负债表依然健康的部分居民与企业，这也意味着，当前国内经济的问题，症结还是信心的问题，信心的恢复有赖决策者强有力的信号指引与信用重塑。政策方面，中央经济工作会议要求积极的财政政策要加力提效，稳健的货币政策要精准有力，政策基调维持宽松。

市场方面，经济修复动能不足、政策基调保持定力、美国经济韧性背景下美联储降息预期的一再延后，共同导向之前的强预期与当下的弱现实的错配，并主导了市场基调，去年底以来的增量市场切换为存量乃至缩量市场。报告期内市场整体维持震荡，结构上，由于政策基调倾向于供给侧，也即对于科技的支持，这一政策基调映射在资本市场，人工智能、数字经济为代表的科技板块表现较好。

基金投资运作方面，作为被动指数基金，本基金主要采取复制指数的投资策略，报告期内，本基金在做好跟踪标的指数的基础上，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，华夏中证光伏产业指数发起式 A 基金份额净值为 0.7485 元，本报告期份额净值增长率为-8.27%；华夏中证光伏产业指数发起式 C 基金份额净值为 0.7444 元，本报告期份额净值增长率为-8.39%，同期业绩比较基准增长率为-9.79%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，我们需要重点关注的主要是三个因素，美联储的政策、中国的经济恢复情况、中国的政策基调。

为了应对通胀，美联储采取了激进的加息政策，当前联邦基金利率已达 5.00-5.25%，未来如何走？目前看美联储主要需要关注两个方面的因素：一是金融领域，类似硅谷银行这样的风险，是个例吗？恐怕不是，骤松骤紧的货币政策会给很多经济实体造成冲击，尤其疫情后美国的天量宽松，之后又非常激进地加息，很多资产负债表不是特别健康的实体都很难承受这样的变化，尤其是之前加杠杆，期限配置不合理的实体，这是我们未来关注美联储政策的一个重要的方向，如果出现这样的金融风险的扩散，美联储的货币政策的转向也就不远了。另一个是经济领域，这么高的利率对经

济的冲击显然是非常大的，尽管一些数据看上去仍然有韧性，但继续维持这么高的利率，这种韧性的持续性能有多久是值得怀疑的。但是相比较于金融风险，经济领域的指标，虽然重要，但紧迫性并没那么强，仅就经济而言，美联储早一点降息或晚一点降息造成的影响相对可控，那么仅从经济领域来看，美联储其实可以选择将利率维持在当前位置观察一段时间。甚至如美联储说的，信用紧缩甚至有利于控制通胀。这是我们观察美联储未来走向的两个重要事项。那么结论就是，如果仅仅是经济增长的指标较差，美联储的转向可能会晚于预期，但如果中间出现其他的风险事件，那么美联储的转向或者给出的转向预期就会提前。此外，除了经济金融方面的因素，美联储的货币政策事实上也受到其他因素的影响，比如欧洲的货币政策怎么走？以及受政治因素的影响，尤其是在美国大选临近，这也是美联储需要关注的因素。

国内方面，毫无疑问，国内经济的修复面临的困难是比较大的，但与此同时，我们也要看到积极的一面，下半年可关注库存变化，观察来自周期的力量；政策方面，前文提及，内部的房地产政策、美国蓄意与中国脱钩、疫情是经济压力的三大来源，疫情业已过去，后续主要是逐渐修复，与美国政府的举措相比，房地产政策及背后的政策脉络毕竟是内政，对于政策的节奏与强度，我们可以掌握主动，也是眼下需要调整，也是能够调整的主要方向。而如何对冲中美脱钩带来的冲击，增强产业链层面的向心力，是信用重塑的范畴。

至于政策调整的时机，当经济增长动能出现进一步衰减，尤其是出口数据回落，三驾马车都呈现疲态时，至少需要输入新的信用，通过财政主动作为接入新的动力，以确保经济机器的正常运转并维持在一个合理的均衡中，尽力避免加速负向螺旋的形成。通过 6 月降息的落地其实可以看到，政策的天平从更为强调供给侧的高质量发展，开始逐渐向兼顾需求侧改变，可继续期待扩大内需的政策。

市场方面，当市场到了一个底部区间时，美联储的降息预期、国内经济的修复、政策的基调，任何一个方面出现利好都会带来市场向上的力量。

我们将继续有效控制基金的跟踪偏离度和跟踪误差，以实现投资者获取指数投资收益及其他模式盈利的投资目标。同时，我们也将积极争取推动产品的进一步创新，充分发挥 ETF 的功能，为各类投资者提供更多、更好的投资机会。

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，本基金管理人将准确、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：华夏中证光伏产业指数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
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	29,957,757.18	26,318,420.56
结算备付金		287,837.20	359,221.89
存出保证金		55,714.15	61,328.45
交易性金融资产	6.4.7.2	471,614,405.98	372,307,740.50
其中：股票投资		471,614,405.98	372,307,740.50
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	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		6,192,973.59	3,879,197.59
应收股利		3,840.00	-
应收申购款		4,279,019.89	1,509,105.63
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	9,127.85	1,484.56
资产总计		512,400,675.84	404,436,499.18
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2022 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
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		-	-
应付赎回款		12,980,386.30	11,016,387.93
应付管理人报酬		200,035.35	170,416.98
应付托管费		40,007.07	34,083.38
应付销售服务费		62,811.87	48,468.54
应付投资顾问费		-	-
应交税费		2,204.16	1,536.45
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	189,718.50	264,218.28
负债合计		13,475,163.25	11,535,111.56
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	668,451,899.19	482,423,924.01
未分配利润	6.4.7.8	-169,526,386.60	-89,522,536.39
净资产合计		498,925,512.59	392,901,387.62

负债和净资产总计		512,400,675.84	404,436,499.18
----------	--	----------------	----------------

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，华夏中证光伏产业指数发起式 A 基金份额净值 0.7485 元，华夏中证光伏产业指数发起式 C 基金份额净值 0.7444 元；华夏中证光伏产业指数发起式基金份额总额 668,451,899.19 份（其中 A 类 322,595,641.39 份，C 类 345,856,257.80 份）。

## 6.2 利润表

会计主体：华夏中证光伏产业指数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
<b>一、营业总收入</b>		-41,047,643.91	8,741,903.80
1.利息收入		410,216.42	39,267.01
其中：存款利息收入	6.4.7.9	51,678.16	39,267.01
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		358,538.26	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-16,739,817.61	-3,929,232.40
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-22,601,079.01	-6,249,607.29
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	238,919.04	173,528.58
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	-	-
股利收益	6.4.7.14	5,622,342.36	2,146,846.31
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	-24,849,893.56	12,519,114.68
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	131,850.84	112,754.51
<b>减：二、营业总支出</b>		1,789,769.85	1,293,892.75
1.管理人报酬		1,134,811.91	830,851.12
2.托管费		226,962.42	166,170.21
3.销售服务费		335,473.00	207,177.62
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		1,292.50	0.68
8.其他费用	6.4.7.18	91,230.02	89,693.12
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-42,837,413.76	7,448,011.05
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-42,837,413.76	7,448,011.05
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-42,837,413.76	7,448,011.05

## 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：华夏中证光伏产业指数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）	482,423,924.01	-	-89,522,536.39	392,901,387.62
二、本期期初净资产（基金净值）	482,423,924.01	-	-89,522,536.39	392,901,387.62
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	186,027,975.18	-	-80,003,850.21	106,024,124.97
（一）、综合收益总额	-	-	-42,837,413.76	-42,837,413.76
（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）	186,027,975.18	-	-37,166,436.45	148,861,538.73
其中：1.基金申购款	733,058,672.40	-	-157,636,924.00	575,421,748.40
2.基金赎回款	-547,030,697.22	-	120,470,487.55	-426,560,209.67
（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	668,451,899.19	-	-169,526,386.60	498,925,512.59

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)	357,294,922.01	-	-2,177,748.67	355,117,173.34
二、本期期初净资产 (基金净值)	357,294,922.01	-	-2,177,748.67	355,117,173.34
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	62,310,300.06	-	-2,309,715.71	60,000,584.35
(一)、综合收益总额	-	-	7,448,011.05	7,448,011.05
(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)	62,310,300.06	-	-9,757,726.76	52,552,573.30
其中：1.基金申购款	458,679,009.33	-	-71,161,920.95	387,517,088.38
2.基金赎回款	-396,368,709.27	-	61,404,194.19	-334,964,515.08
(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)	419,605,222.07	-	-4,487,464.38	415,117,757.69

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：杨明辉，主管会计工作负责人：朱威，会计机构负责人：朱威

#### 6.4 报表附注

##### 6.4.1 基金基本情况

华夏中证光伏产业指数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]1947 号文《关于准予华夏中证光伏产业指数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》、《华夏中证光

伏产业指数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 7 月 19 日至 2021 年 8 月 13 日共募集 263,392,517.75 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\_A114 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华夏中证光伏产业指数发起式证券投资基金基金合同》于 2021 年 8 月 17 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 263,471,832.30 份基金份额，其中认购资金利息折合 79,314.55 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，本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，基金还可投资于非成份股（含创业板及其他中国证监会注册或核准上市的股票）、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、次级债券、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、股票期权、国债期货）、资产支持证券、货币市场工具（含同业存单、债券回购等）、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。

本基金可根据法律法规的规定参与融资、转融通证券出借业务。

本基金投资范围中的股票包含存托凭证。

基金投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%；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 1 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。

#### 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	29,957,757.18
等于：本金	29,954,855.56
加：应计利息	2,901.62
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	29,957,757.18

## 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		556,188,758.86	-	471,614,405.98	-84,574,352.88
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		556,188,758.86	-	471,614,405.98	-84,574,352.88

## 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

无。

## 6.4.7.4 买入返售金融资产

## 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

## 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

## 6.4.7.5 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
应收利息	-
其他应收款	9,127.85
待摊费用	-

合计	9,127.85
----	----------

#### 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	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	105,415.94
其中：交易所市场	105,415.94
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	84,302.56
合计	189,718.50

#### 6.4.7.7 实收基金

华夏中证光伏产业指数发起式 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	258,402,771.06	258,402,771.06
本期申购	195,379,756.33	195,379,756.33
本期赎回（以“-”号填列）	-131,186,886.00	-131,186,886.00
本期末	322,595,641.39	322,595,641.39

华夏中证光伏产业指数发起式 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	224,021,152.95	224,021,152.95
本期申购	537,678,916.07	537,678,916.07
本期赎回（以“-”号填列）	-415,843,811.22	-415,843,811.22
本期末	345,856,257.80	345,856,257.80

#### 6.4.7.8 未分配利润

华夏中证光伏产业指数发起式 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	-1,000,783.68	-46,548,918.87	-47,549,702.55

本期利润	-8,512,058.73	-12,505,367.80	-21,017,426.53
本期基金份额交易产生的变动数	-311,569.62	-12,238,495.64	-12,550,065.26
其中：基金申购款	-1,568,164.59	-38,665,873.20	-40,234,037.79
基金赎回款	1,256,594.97	26,427,377.56	27,683,972.53
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-9,824,412.03	-71,292,782.31	-81,117,194.34

华夏中证光伏产业指数发起式 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	-1,697,801.12	-40,275,032.72	-41,972,833.84
本期利润	-9,475,461.47	-12,344,525.76	-21,819,987.23
本期基金份额交易产生的变动数	-997,167.99	-23,619,203.20	-24,616,371.19
其中：基金申购款	-6,760,551.51	-110,642,334.70	-117,402,886.21
基金赎回款	5,763,383.52	87,023,131.50	92,786,515.02
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-12,170,430.58	-76,238,761.68	-88,409,192.26

#### 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	48,409.98
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	2,792.52
其他	475.66
合计	51,678.16

#### 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	121,549,833.65
减：卖出股票成本总额	143,834,873.42
减：交易费用	316,039.24
买卖股票差价收入	-22,601,079.01

#### 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	418.51
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	238,500.53
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	238,919.04

## 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	1,549,993.69
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,311,000.00
减：应计利息总额	431.01
减：交易费用	62.15
买卖债券差价收入	238,500.53

## 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

无。

## 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	5,622,342.36
其中：证券出借权益补偿收入	128,111.90
基金投资产生的股利收益	-
合计	5,622,342.36

## 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	-24,849,893.56
——股票投资	-24,849,893.56
——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	-24,849,893.56

#### 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	131,850.84
合计	131,850.84

#### 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	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	6,927.46
其他	-
合计	91,230.02

#### 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	168,064,249.67	44.42%	7,393,128.10	3.84%

###### 6.4.10.1.2 债券回购交易

无。

###### 6.4.10.1.3 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	72,487.69	44.42%	45,824.12	43.47%
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	601.05	0.83%	-	-

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	1,134,811.91	830,851.12
其中：支付销售机构的客户维护费	371,793.45	251,513.37

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 0.50%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×0.50%/当年天数。

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

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 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	226,962.42	166,170.21

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 0.10%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×0.10%/当年天数。

##### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
----	----------------------------

销售 服务 费的 各关 联方 名称	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华夏中证光伏产业指数 发起式 A	华夏中证光伏产业指数 发起式 C	合计
招商银行	-	48,002.19	48,002.19
华夏 基金 管理 有限 公司	-	24,049.61	24,049.61
华夏 财富	-	2,994.47	2,994.47
中信 证券	-	1,213.32	1,213.32
中信 证券 (华 南)	-	272.03	272.03
中信 证券 (山 东)	-	213.85	213.85
中信 期货	-	49.61	49.61
合计	-	76,795.08	76,795.08
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		
	华夏中证光伏产业指数 发起式 A	华夏中证光伏产业指数 发起式 C	合计
招商 银行	-	60,487.08	60,487.08
华夏	-	18,917.10	18,917.10

基金 管理 有限 公司			
华夏 财富	-	403.55	403.55
中信 证券	-	384.36	384.36
中信 证券 (华 南)	-	286.57	286.57
中信 期货	-	62.53	62.53
中信 证券 (山 东)	-	49.80	49.80
合计	-	80,590.99	80,590.99

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 0.30% 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 × 0.30% / 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

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	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末证券出借业务余额
中信证券	28,340,044.00	22,789.36	-	-
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	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末证券出借业务余额
中信证券	-	-	-	-

注：因 2023 年注册制全面改革，自实施起没有与关联方通过约定方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务。

#### 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

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	合约编号	证券名称	成交时间	交易金额	交易数量（单位：股）	出借期限（单位：天）	费率（%）	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
中信证券	2023010300001265	捷佳伟创	2023-01-03	869,869.00	7,700.00	28	3.10	2,097.35	-	-
中信证券	2023010300001269	中来股份	2023-01-03	93,558.00	6,200.00	14	3.50	127.34	-	-
中信证券	2023010300001271	东方日升	2023-01-03	254,200.00	10,000.00	14	3.20	316.34	-	-
中信证券	2023010400001359	易事特	2023-01-04	69,600.00	10,000.00	14	3.30	89.32	-	-
中信证券	2023010400001381	东方日升	2023-01-04	249,300.00	10,000.00	14	3.20	310.24	-	-
中信证	2023010400001401	中来股	2023-01-04	156,800.00	10,000.00	14	3.50	213.42	-	-

券		份								
中信证券	202301050000 2065	金博股份	2023-01 -05	597,922.0 0	2,600.0 0	14	3.10	720.8 3	-	-
中信证券	202301110000 0856	中来股份	2023-01 -11	173,200.0 0	10,000. 00	14	4.10	374.7 9	-	-
中信证券	202301110000 0862	易事特	2023-01 -11	72,400.00	10,000. 00	14	3.30	126.1 0	-	-
中信证券	202301120001 4899	东方日升	2023-01 -12	337,200.0 0	10,000. 00	14	3.20	539.5 2	-	-
中信证券	202301170000 1103	易事特	2023-01 -17	71,700.00	10,000. 00	14	3.30	92.02	-	-
中信证券	202301170000 1175	帝尔激光	2023-01 -17	133,000.0 0	1,000.0 0	14	1.80	93.10	-	-
中信证券	202301170000 1180	锦浪科技	2023-01 -17	174,870.0 0	1,000.0 0	14	1.80	122.4 1	-	-
中信证券	202301170000 1270	高测股份	2023-01 -17	222,152.0 0	2,800.0 0	14	1.80	155.5 1	-	-
中信证券	202301170003 3301	东方日升	2023-01 -17	349,600.0 0	10,000. 00	14	3.40	462.2 5	-	-
中信证券	202301170003 3311	中来股份	2023-01 -17	105,710.0 0	6,200.0 0	14	4.10	168.5 5	-	-
中信证	202301180001 5061	东方日	2023-01 -18	348,400.0 0	10,000. 00	14	3.40	460.6 6	-	-

券		升								
中信证券	202301180001 5065	易事特	2023-01 -18	71,900.00	10,000.00	14	3.30	92.27	-	-
中信证券	202301180001 5069	中来股份	2023-01 -18	171,800.00	10,000.00	14	4.10	273.93	-	-
中信证券	202301190001 6776	金博股份	2023-01 -19	629,200.00	2,600.00	14	3.50	856.41	-	-
中信证券	202301300007 0765	中来股份	2023-01 -30	172,000.00	10,000.00	14	4.10	274.24	-	-
中信证券	202301300007 9869	东方日升	2023-01 -30	333,800.00	10,000.00	14	3.50	454.34	-	-
中信证券	202301300008 3857	易事特	2023-01 -30	73,400.00	10,000.00	14	3.30	94.20	-	-
中信证券	202301310002 3763	易事特	2023-01 -31	74,200.00	10,000.00	14	3.30	95.22	-	-
中信证券	202301310002 3789	东方日升	2023-01 -31	339,500.00	10,000.00	14	3.50	462.10	-	-
中信证券	202301310003 2157	捷佳伟创	2023-01 -31	948,101.00	7,700.00	28	6.60	4,866.92	-	-
中信证券	202301310003 2625	中来股份	2023-01 -31	110,484.00	6,200.00	14	3.40	146.08	-	-
中信证	202302010001 5142	东方日	2023-02 -01	342,800.00	10,000.00	14	3.50	466.59	-	-

券		升								
中信证券	202302010001 5144	易事特	2023-02 -01	75,300.00	10,000. 00	14	3.30	96.64	-	-
中信证券	202302010001 8832	中来股份	2023-02 -01	193,000.0 0	10,000. 00	14	3.40	255.1 9	-	-
中信证券	202302020001 5793	金博股份	2023-02 -02	647,400.0 0	2,600.0 0	14	3.20	805.6 5	-	-
中信证券	202302090000 1519	易事特	2023-02 -09	313,100.0 0	40,400. 00	14	3.40	413.9 9	-	-
中信证券	202302130005 9718	中来股份	2023-02 -13	187,400.0 0	10,000. 00	14	3.50	255.0 7	-	-
中信证券	202302130006 0514	东方日升	2023-02 -13	318,700.0 0	10,000. 00	14	3.50	433.7 9	-	-
中信证券	202302130006 3608	易事特	2023-02 -13	77,000.00	10,000. 00	14	3.30	98.82	-	-
中信证券	202302140002 1221	东方日升	2023-02 -14	318,800.0 0	10,000. 00	14	3.20	396.7 3	-	-
中信证券	202302140002 4959	中来股份	2023-02 -14	116,498.0 0	6,200.0 0	14	3.50	158.5 7	-	-
中信证券	202302140002 5023	易事特	2023-02 -14	77,800.00	10,000. 00	14	3.40	102.8 7	-	-
中信证	202302150001 4764	中来股	2023-02 -15	182,600.0 0	10,000. 00	14	3.50	248.5 4	-	-

券		份								
中信证 券	202302150001 5500	东方 日升	2023-02 -15	315,000.0 0	10,000. 00	14	3.20	392.0 0	-	-
中信证 券	202302150001 7628	易事 特	2023-02 -15	80,000.00	10,000. 00	14	3.40	105.7 8	-	-
中信证 券	202302160001 5653	金博 股份	2023-02 -16	577,824.0 0	2,600.0 0	14	3.40	764.0 1	-	-
中信证 券	202302230000 5079	易事 特	2023-02 -23	305,828.0 0	40,400. 00	14	3.40	404.3 7	-	-
中信证 券	202302270007 4578	中来 股份	2023-02 -27	174,100.0 0	10,000. 00	14	3.50	236.9 7	-	-
中信证 券	202302270007 4672	东方 日升	2023-02 -27	320,800.0 0	10,000. 00	14	3.60	449.1 2	-	-
中信证 券	202302270007 7244	易事 特	2023-02 -27	76,000.00	10,000. 00	14	3.40	100.4 9	-	-
中信证 券	202302280001 9286	捷佳 伟创	2023-02 -28	994,070.0 0	7,700.0 0	28	3.30	2,551. 45	-	-
中信证 券	202302280001 9714	中来 股份	2023-02 -28	105,338.0 0	6,200.0 0	14	3.50	143.3 8	-	-
中信证 券	202302280001 9756	易事 特	2023-02 -28	76,500.00	10,000. 00	14	3.40	101.1 5	-	-
中信证 券	202302280001 9762	东方 日	2023-02 -28	314,000.0 0	10,000. 00	14	3.60	439.6 0	-	-

券		升								
中信证券	202303010001 4403	易事特	2023-03 -01	78,300.00	10,000.00	14	3.40	103.53	-	-
中信证券	202303010001 4409	中来股份	2023-03 -01	171,800.00	10,000.00	14	3.50	233.84	-	-
中信证券	202303010001 4441	东方日升	2023-03 -01	299,400.00	10,000.00	14	3.60	419.16	-	-
中信证券	202303020001 4245	金博股份	2023-03 -02	503,074.00	2,600.00	14	3.40	665.18	-	-
中信证券	202303090000 1322	捷佳伟创	2023-03 -09	497,562.00	3,900.00	14	3.50	677.24	-	-
中信证券	202303090000 6866	易事特	2023-03 -09	312,696.00	40,400.00	14	3.30	401.29	-	-
中信证券	202303130004 9440	易事特	2023-03 -13	74,700.00	10,000.00	14	3.40	98.77	-	-
中信证券	202303130004 9608	中来股份	2023-03 -13	153,500.00	10,000.00	14	4.00	238.78	-	-
中信证券	202303130005 6018	东方日升	2023-03 -13	301,500.00	10,000.00	14	3.60	422.10	-	-
中信证券	202303140002 2690	东方日升	2023-03 -14	296,000.00	10,000.00	14	3.60	414.40	-	-
中信证	202303140002 4060	中来股	2023-03 -14	92,938.00	6,200.00	14	4.00	144.57	-	-

券		份								
中信证券	202303140002 4518	易事特	2023-03 -14	72,200.00	10,000.00	14	3.40	95.46	-	-
中信证券	202303150002 0389	东方日升	2023-03 -15	294,800.00	10,000.00	14	3.60	412.72	-	-
中信证券	202303150002 0469	中来股份	2023-03 -15	151,400.00	10,000.00	14	4.00	235.51	-	-
中信证券	202303150002 0497	易事特	2023-03 -15	74,600.00	10,000.00	14	3.40	98.64	-	-
中信证券	202303160001 1236	金博股份	2023-03 -16	462,722.00	2,600.00	14	3.50	629.82	-	-
中信证券	202303230000 5810	易事特	2023-03 -23	312,696.00	40,400.00	14	3.50	425.61	-	-
中信证券	202303230000 6244	捷佳伟创	2023-03 -23	429,000.00	3,900.00	14	3.50	583.92	-	-
中信证券	202303270005 2091	易事特	2023-03 -27	78,300.00	10,000.00	14	3.10	94.40	-	-
中信证券	202303270005 4929	中来股份	2023-03 -27	152,200.00	10,000.00	14	3.60	213.08	-	-
中信证券	202303270005 8573	东方日升	2023-03 -27	284,000.00	10,000.00	14	3.50	386.56	-	-
中信证	202303280002 0059	中来股	2023-03 -28	92,752.00	6,200.00	14	3.60	129.85	-	-

券		份								
中信证券	2023032800020093	易事特	2023-03-28	77,400.00	10,000.00	14	3.10	93.31	-	-
中信证券	2023032800020541	捷佳伟创	2023-03-28	871,255.00	7,700.00	28	3.30	2,236.22	-	-
中信证券	2023032800022377	东方日升	2023-03-28	276,500.00	10,000.00	14	3.50	376.35	-	-
中信证券	2023032900018642	东方日升	2023-03-29	274,000.00	10,000.00	14	3.50	372.94	-	-
中信证券	2023032900020890	易事特	2023-03-29	77,000.00	10,000.00	14	3.10	92.83	-	-
中信证券	2023032900020908	中来股份	2023-03-29	148,000.00	10,000.00	14	3.60	207.20	-	-
中信证券	20230333000017145	金博股份	2023-03-30	491,348.00	2,600.00	14	3.40	649.67	-	-
中信证券	2023040600002006	易事特	2023-04-06	67,252.00	8,600.00	14	2.80	73.23	-	-
中信证券	2023040600002010	易事特	2023-04-06	117,300.00	15,000.00	14	2.80	127.73	-	-
中信证券	2023040600002160	易事特	2023-04-06	315,928.00	40,400.00	14	3.10	380.87	-	-
中信证	2023041000033355	吉电股	2023-04-10	459,772.00	83,900.00	14	1.70	303.96	-	-

券		份								
中信证券	202304100003 6395	爱旭股份	2023-04 -10	326,700.0 0	10,000. 00	14	1.70	215.9 9	-	-
中信证券	202304100005 0349	中来股份	2023-04 -10	153,800.0 0	10,000. 00	14	2.60	155.5 1	-	-
中信证券	202304100005 6889	东方日升	2023-04 -10	274,400.0 0	10,000. 00	14	3.50	373.4 9	-	-
中信证券	202304100006 2633	易事特	2023-04 -10	89,300.00	10,000. 00	14	2.80	97.24	-	-
中信证券	202304110000 5604	南网能源	2023-04 -11	76,000.00	10,000. 00	28	1.80	106.4 0	-	-
中信证券	202304110000 5614	林洋能源	2023-04 -11	77,400.00	10,000. 00	28	1.80	108.3 6	-	-
中信证券	202304110000 5700	森特股份	2023-04 -11	264,800.0 0	10,000. 00	14	1.70	175.0 6	-	-
中信证券	202304110000 9200	科华数据	2023-04 -11	442,500.0 0	10,000. 00	14	1.70	292.5 4	-	-
中信证券	202304110000 9358	露笑科技	2023-04 -11	89,200.00	10,000. 00	14	1.70	58.97	-	-
中信证券	202304110000 9366	露笑科技	2023-04 -11	89,200.00	10,000. 00	14	1.70	58.97	-	-
中信证	202304110000 9370	露笑科	2023-04 -11	89,200.00	10,000. 00	14	1.70	58.97	-	-

券		技								
中信证券	202304110001 1848	双良节能	2023-04 -11	156,400.0 0	10,000. 00	14	1.70	103.4 0	-	-
中信证券	202304110001 2484	双良节能	2023-04 -11	156,400.0 0	10,000. 00	28	1.80	218.9 6	-	-
中信证券	202304110001 2514	林洋能源	2023-04 -11	77,400.00	10,000. 00	14	1.70	51.17	-	-
中信证券	202304110001 8990	易事特	2023-04 -11	85,800.00	10,000. 00	14	2.80	93.43	-	-
中信证券	202304110002 2096	东方日升	2023-04 -11	269,600.0 0	10,000. 00	14	3.10	325.0 2	-	-
中信证券	202304110002 2128	中来股份	2023-04 -11	94,116.00	6,200.0 0	14	3.50	128.1 0	-	-
中信证券	202304120001 1163	禾望电气	2023-04 -12	100,908.0 0	3,600.0 0	14	3.20	125.5 7	-	-
中信证券	202304120001 1224	航天机电	2023-04 -12	134,696.0 0	14,900. 00	14	3.20	167.6 2	-	-
中信证券	202304120001 1442	吉电股份	2023-04 -12	66,543.00	12,300. 00	14	3.20	82.81	-	-
中信证券	202304120001 7646	南玻 A	2023-04 -12	66,600.00	10,000. 00	14	1.70	44.03	-	-
中信证	202304120001 9008	晶科科	2023-04 -12	48,300.00	10,000. 00	14	1.70	31.93	-	-

券		技								
中信证 券	202304120002 0346	太阳 能	2023-04 -12	204,300.0 0	30,000. 00	14	1.70	135.0 7	-	-
中信证 券	202304120002 1516	双良 节能	2023-04 -12	157,800.0 0	10,000. 00	14	1.70	104.3 2	-	-
中信证 券	202304120002 3176	露笑 科技	2023-04 -12	89,200.00	10,000. 00	14	1.70	58.97	-	-
中信证 券	202304120002 6026	东方 日升	2023-04 -12	265,300.0 0	10,000. 00	14	3.10	319.8 3	-	-
中信证 券	202304120002 6040	中来 股份	2023-04 -12	149,200.0 0	10,000. 00	14	3.50	203.0 8	-	-
中信证 券	202304120002 6108	易事 特	2023-04 -12	85,900.00	10,000. 00	14	2.80	93.54	-	-
中信证 券	202304130000 4205	中来 股份	2023-04 -13	85,842.00	5,700.0 0	14	3.60	120.1 8	-	-
中信证 券	202304130000 4280	航天 机电	2023-04 -13	134,398.0 0	14,900. 00	14	3.20	167.2 5	-	-
中信证 券	202304130000 4379	禾望 电气	2023-04 -13	101,935.0 0	3,700.0 0	14	3.20	126.8 5	-	-
中信证 券	202304130001 0279	浙江 新能	2023-04 -13	115,700.0 0	10,000. 00	14	1.70	76.49	-	-
中信证 券	202304130001 0361	南玻 A	2023-04 -13	155,996.0 0	23,600. 00	14	1.70	103.1 3	-	-

券										
中信证券	2023041300010363	爱康科技	2023-04-13	227,640.00	81,300.00	14	1.70	150.50	-	-
中信证券	2023041300010819	林洋能源	2023-04-13	76,800.00	10,000.00	28	1.80	107.52	-	-
中信证券	2023041300015197	金博股份	2023-04-13	491,738.00	2,600.00	14	3.20	611.94	-	-
中信证券	2023041800005970	露笑科技	2023-04-18	18,524.00	2,200.00	14	3.20	26.35	-	-
中信证券	2023041800006251	科士达	2023-04-18	92,663.00	1,900.00	14	3.00	123.55	-	-
中信证券	2023041800007415	林洋能源	2023-04-18	126,360.00	16,200.00	14	3.20	179.71	-	-
中信证券	2023042000010069	易事特	2023-04-20	364,004.00	40,400.00	14	3.00	424.67	-	-
中信证券	2023042000010519	福莱特	2023-04-20	322,400.00	10,000.00	14	3.20	401.21	-	-
中信证券	2023042000013731	易事特	2023-04-20	77,486.00	8,600.00	14	3.00	90.40	-	-
中信证券	2023042000013771	易事特	2023-04-20	135,150.00	15,000.00	14	3.00	157.68	-	-
中信证	2023042000013787	浙江新	2023-04-20	113,500.00	10,000.00	14	3.20	141.24	-	-

券		能								
中信证 券	202304240002 5591	易事特	2023-04 -24	84,600.00	10,000. 00	14	3.50	115.1 5	-	-
中信证 券	202304240003 2921	中来股 份	2023-04 -24	138,300.0 0	10,000. 00	14	3.60	193.6 2	-	-
中信证 券	202304240004 5571	爱旭股 份	2023-04 -24	292,300.0 0	10,000. 00	14	3.30	375.1 2	-	-
中信证 券	202304240005 7023	东方日 升	2023-04 -24	242,400.0 0	10,000. 00	14	3.40	320.5 1	-	-
中信证 券	202304240006 8237	吉电股 份	2023-04 -24	441,314.0 0	83,900. 00	14	3.30	566.3 5	-	-
中信证 券	202304250000 4468	联泓新 科	2023-04 -25	24,830.00	1,000.0 0	14	3.20	30.90	-	-
中信证 券	202304250005 2403	易事特	2023-04 -25	80,400.00	10,000. 00	14	3.50	109.4 3	-	-
中信证 券	202304250005 4515	露笑科 技	2023-04 -25	73,600.00	10,000. 00	14	3.20	91.59	-	-
中信证 券	202304250005 5395	捷佳伟 创	2023-04 -25	770,000.0 0	7,700.0 0	28	2.60	1,557. 11	-	-
中信证 券	202304250005 5437	科华数 据	2023-04 -25	411,300.0 0	10,000. 00	14	3.20	511.8 4	-	-
中信证 券	202304250005 5943	露笑科 技	2023-04 -25	73,600.00	10,000. 00	14	3.20	91.59	-	-

券		技								
中信证 券	202304250005 9891	露 笑 科 技	2023-04 -25	73,600.00	10,000. 00	14	3.20	91.59	-	-
中信证 券	202304250006 4651	森 特 股 份	2023-04 -25	231,000.0 0	10,000. 00	14	3.30	296.4 5	-	-
中信证 券	202304250006 4689	东 方 日 升	2023-04 -25	242,000.0 0	10,000. 00	14	3.40	319.9 8	-	-
中信证 券	202304250006 4699	林 洋 能 源	2023-04 -25	71,600.00	10,000. 00	14	3.30	91.89	-	-
中信证 券	202304250006 4905	中 来 股 份	2023-04 -25	82,708.00	6,200.0 0	14	3.60	115.7 9	-	-
中信证 券	202304260000 7342	南 玻 A	2023-04 -26	65,600.00	10,000. 00	14	1.50	38.27	-	-
中信证 券	202304260001 4946	晶 科 科 技	2023-04 -26	47,000.00	10,000. 00	14	2.10	38.38	-	-
中信证 券	202304260001 5010	吉 电 股 份	2023-04 -26	65,190.00	12,300. 00	14	3.30	83.66	-	-
中信证 券	202304260001 7484	东 方 日 升	2023-04 -26	261,600.0 0	10,000. 00	14	3.40	345.8 9	-	-
中信证 券	202304260001 7498	太 阳 能	2023-04 -26	210,900.0 0	30,000. 00	14	2.40	196.8 4	-	-
中信证 券	202304260002 2126	禾 望 电	2023-04 -26	103,860.0 0	3,600.0 0	14	3.30	133.2 9	-	-

券		气								
中信证 券	202304260002 8926	易事特	2023-04 -26	86,900.00	10,000. 00	14	3.50	118.2 8	-	-
中信证 券	202304260002 8986	中来股 份	2023-04 -26	143,100.0 0	10,000. 00	14	3.60	200.3 4	-	-
中信证 券	202304270000 6082	南玻 A	2023-04 -27	6,510.00	1,000.0 0	14	2.20	5.57	-	-
中信证 券	202304270001 4648	露笑科 技	2023-04 -27	74,900.00	10,000. 00	28	2.80	163.1 2	-	-
中信证 券	202304270001 5006	航天机 电	2023-04 -27	129,630.0 0	14,900. 00	14	3.30	166.3 6	-	-
中信证 券	202304270001 5042	爱康科 技	2023-04 -27	227,640.0 0	81,300. 00	14	3.10	274.4 3	-	-
中信证 券	202304270001 7922	禾望电 气	2023-04 -27	105,487.0 0	3,700.0 0	14	3.30	135.3 7	-	-
中信证 券	202304270002 0368	中来股 份	2023-04 -27	78,375.00	5,700.0 0	14	3.60	109.7 3	-	-
中信证 券	202304270002 0484	金博股 份	2023-04 -27	458,614.0 0	2,600.0 0	14	3.30	588.5 5	-	-
中信证 券	202304270002 2210	南玻 A	2023-04 -27	153,636.0 0	23,600. 00	14	1.50	89.62	-	-
中信证 券	202304270002 2286	浙江新	2023-04 -27	113,700.0 0	10,000. 00	14	3.10	137.0 7	-	-

券		能								
中信证 券	202305040000 7050	协鑫集 成	2023-05 -04	3,140.00	1,000.0 0	14	1.60	1.95	-	-
中信证 券	202305040001 7609	浙江新 能	2023-05 -04	113,100.0 0	10,000. 00	14	3.30	145.1 5	-	-
中信证 券	202305040002 0271	易事特	2023-05 -04	75,336.00	8,600.0 0	14	3.10	90.82	-	-
中信证 券	202305040002 4091	科士达	2023-05 -04	87,210.00	1,900.0 0	14	3.00	101.7 5	-	-
中信证 券	202305040003 1669	林洋能 源	2023-05 -04	128,952.0 0	16,200. 00	14	3.30	165.4 9	-	-
中信证 券	202305040003 4041	福莱特	2023-05 -04	307,600.0 0	10,000. 00	14	3.10	370.8 3	-	-
中信证 券	202305040003 4069	爱旭股 份	2023-05 -04	387,200.0 0	12,100. 00	28	3.40	1,023. 93	-	-
中信证 券	202305040003 4145	易事特	2023-05 -04	131,400.0 0	15,000. 00	14	3.10	158.4 1	-	-
中信证 券	202305040004 2749	易事特	2023-05 -04	353,904.0 0	40,400. 00	14	3.10	426.6 5	-	-
中信证 券	202305040005 1589	露笑科 技	2023-05 -04	17,182.00	2,200.0 0	14	2.90	19.38	-	-
中信证 券	202305080001 2319	爱旭股	2023-05 -08	310,900.0 0	10,000. 00	14	3.50	423.1 7	-	-

券		份								
中信证券	202305080003 6259	吉电股份	2023-05 -08	465,645.0 0	83,900. 00	14	3.10	561.3 6	-	-
中信证券	202305080004 4757	易事特	2023-05 -08	81,200.00	10,000. 00	14	3.10	97.89	-	-
中信证券	202305080005 6405	东方日升	2023-05 -08	239,300.0 0	10,000. 00	14	3.50	325.7 1	-	-
中信证券	202305080005 6407	中来股份	2023-05 -08	134,200.0 0	10,000. 00	14	3.50	182.6 6	-	-
中信证券	202305090000 6741	中信博	2023-05 -09	84,780.00	1,200.0 0	28	3.20	211.0 1	-	-
中信证券	202305090000 6832	中信博	2023-05 -09	84,780.00	1,200.0 0	14	3.30	108.8 0	-	-
中信证券	202305090000 6876	高测股份	2023-05 -09	64,330.00	1,000.0 0	14	3.50	87.56	-	-
中信证券	202305090001 2595	露笑科技	2023-05 -09	73,500.00	10,000. 00	14	2.90	82.89	-	-
中信证券	202305090001 2739	中来股份	2023-05 -09	81,530.00	6,200.0 0	14	3.50	110.9 7	-	-
中信证券	202305090001 6897	森特股份	2023-05 -09	230,400.0 0	10,000. 00	14	2.40	215.0 4	-	-
中信证	202305090001 6999	科华数	2023-05 -09	394,000.0 0	10,000. 00	14	3.10	474.9 9	-	-

券		据								
中信 证券	202305090002 3295	双 良 节 能	2023-05 -09	135,600.0 0	10,000. 00	28	3.20	337.4 9	-	-
中信 证券	202305090002 3359	林 洋 能 源	2023-05 -09	77,100.00	10,000. 00	14	3.30	98.95	-	-
中信 证券	202305090002 3455	东 方 日 升	2023-05 -09	232,500.0 0	10,000. 00	14	3.50	316.4 6	-	-
中信 证券	202305090002 4215	易 事 特	2023-05 -09	76,800.00	10,000. 00	14	3.10	92.59	-	-
中信 证券	202305090002 4563	南 网 能 源	2023-05 -09	64,700.00	10,000. 00	28	1.00	50.32	-	-
中信 证券	202305090002 4579	林 洋 能 源	2023-05 -09	77,100.00	10,000. 00	28	3.20	191.8 9	-	-
中信 证券	202305090002 6933	露 笑 科 技	2023-05 -09	73,500.00	10,000. 00	14	2.90	82.89	-	-
中信 证券	202305090002 6999	露 笑 科 技	2023-05 -09	73,500.00	10,000. 00	14	2.90	82.89	-	-
中信 证券	202305090002 7233	联 泓 新 科	2023-05 -09	25,800.00	1,000.0 0	14	3.20	32.11	-	-
中信 证券	202305100001 6290	吉 电 股 份	2023-05 -10	68,634.00	12,300. 00	14	3.10	82.74	-	-
中信 证	202305100001 9860	太 阳 能	2023-05 -10	212,400.0 0	30,000. 00	14	2.50	206.5 0	-	-

券										
中信证券	202305100002 3772	晶科科技	2023-05 -10	47,600.00	10,000.00	14	3.10	57.38	-	-
中信证券	202305100002 5154	南玻 A	2023-05 -10	66,100.00	10,000.00	14	2.20	56.55	-	-
中信证券	202305100002 9274	东方日升	2023-05 -10	237,500.00	10,000.00	14	3.50	323.26	-	-
中信证券	202305100002 9384	禾望电气	2023-05 -10	102,996.00	3,600.00	14	3.30	132.18	-	-
中信证券	202305100003 1780	易事特	2023-05 -10	80,500.00	10,000.00	14	3.40	106.44	-	-
中信证券	202305100003 1938	中来股份	2023-05 -10	133,700.00	10,000.00	14	3.50	181.98	-	-
中信证券	202305110001 1217	中来股份	2023-05 -11	75,753.00	5,700.00	14	3.50	103.11	-	-
中信证券	202305110001 4761	林洋能源	2023-05 -11	78,800.00	10,000.00	28	3.20	196.12	-	-
中信证券	202305110001 6491	爱康科技	2023-05 -11	221,136.00	81,300.00	14	3.20	275.19	-	-
中信证券	202305110001 6493	金博股份	2023-05 -11	430,274.00	2,600.00	14	3.30	552.18	-	-
中信证	202305110001 6495	浙江新	2023-05 -11	112,900.00	10,000.00	14	3.30	144.89	-	-

券		能								
中信证券	202305110001 6523	禾望电气	2023-05 -11	107,522.0 0	3,700.0 0	14	3.30	137.9 9	-	-
中信证券	202305110001 9029	航天机电	2023-05 -11	129,928.0 0	14,900. 00	14	3.30	166.7 4	-	-
中信证券	202305110002 0845	南玻 A	2023-05 -11	6,580.00	1,000.0 0	14	2.20	5.63	-	-
中信证券	202305110002 0899	南玻 A	2023-05 -11	155,288.0 0	23,600. 00	14	2.20	132.8 6	-	-
中信证券	202305160000 2657	南玻 A	2023-05 -16	12,940.00	2,000.0 0	28	2.40	21.57	-	-
中信证券	202305180000 8146	露笑科技	2023-05 -18	15,466.00	2,200.0 0	14	3.10	18.65	-	-
中信证券	202305180001 7864	林洋能源	2023-05 -18	130,086.0 0	16,200. 00	14	3.30	166.9 4	-	-
中信证券	202305180002 0410	科士达	2023-05 -18	79,819.00	1,900.0 0	14	3.10	96.23	-	-
中信证券	202305180002 7514	协鑫集成	2023-05 -18	2,970.00	1,000.0 0	14	2.30	2.66	-	-
中信证券	202305180002 9042	易事特	2023-05 -18	290,880.0 0	40,400. 00	14	3.40	384.6 1	-	-
中信证	202305180002 9050	易事特	2023-05 -18	108,000.0 0	15,000. 00	14	3.40	142.8 0	-	-

券										
中信证券	202305180002 9092	浙江新能	2023-05 -18	113,300.0 0	10,000. 00	14	3.40	149.8 1	-	-
中信证券	202305180003 0748	易事特	2023-05 -18	61,920.00	8,600.0 0	14	3.40	81.87	-	-
中信证券	202305180003 5734	福莱特	2023-05 -18	309,400.0 0	10,000. 00	14	3.30	397.0 6	-	-
中信证券	202305220001 1756	吉电股份	2023-05 -22	477,391.0 0	83,900. 00	14	3.20	594.0 9	-	-
中信证券	202305220002 6382	中来股份	2023-05 -22	133,200.0 0	10,000. 00	14	3.50	181.3 0	-	-
中信证券	202305220002 6970	东方日升	2023-05 -22	240,800.0 0	10,000. 00	14	3.50	327.7 6	-	-
中信证券	202305220003 2706	易事特	2023-05 -22	72,400.00	10,000. 00	14	3.50	98.54	-	-
中信证券	202305220004 9404	爱旭股份	2023-05 -22	328,800.0 0	10,000. 00	14	3.50	447.5 3	-	-
中信证券	202305230000 8806	高测股份	2023-05 -23	46,380.00	1,000.0 0	14	3.30	59.52	-	-
中信证券	202305230001 6682	科华数据	2023-05 -23	393,100.0 0	10,000. 00	14	3.10	473.9 0	-	-
中信证	202305230002 1060	中来股	2023-05 -23	83,638.00	6,200.0 0	14	3.50	113.8 4	-	-

券		份								
中信证 券	202305230002 1064	露 笑 科 技	2023-05 -23	70,300.00	10,000. 00	14	3.10	84.75	-	-
中信证 券	202305230002 1508	易 事 特	2023-05 -23	70,500.00	10,000. 00	14	3.50	95.96	-	-
中信证 券	202305230002 1514	中 信 博	2023-05 -23	87,072.00	1,200.0 0	14	3.40	115.1 3	-	-
中信证 券	202305230002 1566	露 笑 科 技	2023-05 -23	70,300.00	10,000. 00	14	3.10	84.75	-	-
中信证 券	202305230002 1598	东 方 日 升	2023-05 -23	239,100.0 0	10,000. 00	14	3.50	325.4 4	-	-
中信证 券	202305230002 2088	联 泓 新 科	2023-05 -23	25,840.00	1,000.0 0	14	3.30	33.16	-	-
中信证 券	202305230002 4276	露 笑 科 技	2023-05 -23	70,300.00	10,000. 00	14	3.10	84.75	-	-
中信证 券	202305230002 4610	捷 佳 伟 创	2023-05 -23	796,411.0 0	7,700.0 0	28	2.30	1,424. 69	-	-
中信证 券	202305230002 4612	森 特 股 份	2023-05 -23	218,000.0 0	10,000. 00	14	2.40	203.4 7	-	-
中信证 券	202305240000 3317	南 玻 A	2023-05 -24	24,726.00	3,900.0 0	14	2.60	25.00	-	-
中信证 券	202305240000 4794	南 玻 A	2023-05 -24	63,400.00	10,000. 00	14	2.50	61.64	-	-

券										
中信证券	202305240000 4866	晶科科技	2023-05 -24	47,200.00	10,000.00	14	3.20	58.74	-	-
中信证券	202305240000 5206	东方日升	2023-05 -24	246,000.00	10,000.00	14	3.50	334.83	-	-
中信证券	202305240000 5218	易事特	2023-05 -24	70,300.00	10,000.00	14	3.50	95.69	-	-
中信证券	202305240000 7324	禾望电气	2023-05 -24	105,120.00	3,600.00	14	3.10	126.73	-	-
中信证券	202305240002 1880	吉电股份	2023-05 -24	67,896.00	12,300.00	14	3.20	84.49	-	-
中信证券	202305240002 1938	太阳能	2023-05 -24	207,600.00	30,000.00	14	2.70	217.98	-	-
中信证券	202305240002 6934	中来股份	2023-05 -24	138,900.00	10,000.00	14	3.50	189.06	-	-
中信证券	202305250001 2860	南玻 A	2023-05 -25	148,444.00	23,600.00	14	2.50	144.32	-	-
中信证券	202305250001 6108	航天机电	2023-05 -25	126,799.00	14,900.00	14	3.20	157.79	-	-
中信证券	202305250001 6990	浙江新能	2023-05 -25	134,700.00	10,000.00	14	3.30	172.87	-	-
中信证	202305250001 7010	金博股	2023-05 -25	416,988.00	2,600.00	14	3.30	535.13	-	-

券		份								
中信证 券	202305250001 7044	露 笑 科 技	2023-05 -25	71,600.00	10,000. 00	28	3.00	190.9 3	-	-
中信证 券	202305250001 9624	爱 康 科 技	2023-05 -25	214,632.0 0	81,300. 00	14	3.20	267.1 0	-	-
中信证 券	202305250002 2504	禾 望 电 气	2023-05 -25	115,070.0 0	3,700.0 0	14	3.10	138.7 2	-	-
中信证 券	202305250002 3388	中 来 股 份	2023-05 -25	84,246.00	5,700.0 0	14	3.50	114.6 7	-	-
中信证 券	202305250002 6266	南 玻 A	2023-05 -25	6,290.00	1,000.0 0	14	2.50	6.12	-	-
中信证 券	202305300001 7767	联 泓 新 科	2023-05 -30	24,390.00	1,000.0 0	14	3.30	31.30	-	-
中信证 券	202305300001 7788	中 来 股 份	2023-05 -30	13,680.00	1,000.0 0	14	3.30	17.56	-	-
中信证 券	202306010000 4852	联 泓 新 科	2023-06 -01	24,180.00	1,000.0 0	14	3.30	31.03	-	-
中信证 券	202306010002 3147	林 洋 能 源	2023-06 -01	125,712.0 0	16,200. 00	7	3.10	75.78	-	-
中信证 券	202306010002 6827	福 莱 特	2023-06 -01	317,300.0 0	10,000. 00	7	3.30	203.6 0	-	-
中信证 券	202306010002 9690	爱 旭 股	2023-06 -01	412,610.0 0	12,100. 00	14	3.20	513.4 7	-	-

券		份								
中信证 券	202306010002 9793	科 士 达	2023-06 -01	73,454.00	1,900.0 0	7	3.00	42.85	-	-
中信证 券	202306010003 1840	协 鑫 集 成	2023-06 -01	2,930.00	1,000.0 0	7	2.30	1.31	-	-
中信证 券	202306010003 2352	易 事 特	2023-06 -01	282,800.0 0	40,400. 00	7	3.60	197.9 6	-	-
中信证 券	202306010003 4899	易 事 特	2023-06 -01	105,000.0 0	15,000. 00	7	3.60	73.50	-	-
中信证 券	202306010003 5248	浙 江 新 能	2023-06 -01	121,000.0 0	10,000. 00	7	3.40	79.99	-	-
中信证 券	202306010003 6213	露 笑 科 技	2023-06 -01	15,422.00	2,200.0 0	7	3.40	10.20	-	-
中信证 券	202306010003 7648	易 事 特	2023-06 -01	60,200.00	8,600.0 0	7	3.60	42.14	-	-
中信证 券	202306050002 0079	东 方 日 升	2023-06 -05	233,000.0 0	10,000. 00	7	3.50	158.5 7	-	-
中信证 券	202306050002 0090	易 事 特	2023-06 -05	71,100.00	10,000. 00	7	3.50	48.39	-	-
中信证 券	202306050002 2057	中 来 股 份	2023-06 -05	134,100.0 0	10,000. 00	7	3.30	86.05	-	-
中信证 券	202306050002 2125	爱 旭 股	2023-06 -05	337,100.0 0	10,000. 00	7	3.30	216.3 1	-	-

券		份								
中信证券	202306050002 3836	吉电股份	2023-06 -05	466,484.0 0	83,900.0 00	7	3.20	290.2 6	-	-
中信证券	202306060000 5698	高测股份	2023-06 -06	84,094.00	1,900.0 0	14	3.50	114.4 6	-	-
中信证券	202306060001 6119	高测股份	2023-06 -06	44,260.00	1,000.0 0	7	3.30	28.40	-	-
中信证券	202306060001 6215	中来股份	2023-06 -06	84,630.00	6,200.0 0	7	3.30	54.30	-	-
中信证券	202306060001 6832	易事特	2023-06 -06	70,000.00	10,000.0 00	7	3.50	47.64	-	-
中信证券	202306060001 7929	双良节能	2023-06 -06	121,600.0 0	10,000.0 00	14	3.10	146.6 0	-	-
中信证券	202306060001 7953	联泓新科	2023-06 -06	24,370.00	1,000.0 0	7	3.30	15.64	-	-
中信证券	202306060001 8027	露笑科技	2023-06 -06	70,600.00	10,000.0 00	7	3.30	45.30	-	-
中信证券	202306060001 8487	露笑科技	2023-06 -06	70,600.00	10,000.0 00	7	3.30	45.30	-	-
中信证券	202306060001 8745	森特股份	2023-06 -06	199,200.0 0	10,000.0 00	7	3.10	120.0 7	-	-
中信证	202306060001 9904	东方日	2023-06 -06	241,900.0 0	10,000.0 00	7	3.50	164.6 3	-	-

券		升								
中信证券	2023060600020835	科华数据	2023-06-06	377,200.00	10,000.00	7	3.20	234.70	-	-
中信证券	2023060600021105	露笑科技	2023-06-06	70,600.00	10,000.00	7	3.30	45.30	-	-
中信证券	2023060600021567	林洋能源	2023-06-06	76,500.00	10,000.00	14	3.00	89.25	-	-
中信证券	2023060700022529	晶科科技	2023-06-07	48,700.00	10,000.00	7	3.40	32.20	-	-
中信证券	2023060700024353	东方日升	2023-06-07	235,200.00	10,000.00	7	3.60	164.64	-	-
中信证券	2023060700024496	太阳能	2023-06-07	204,900.00	30,000.00	7	3.00	119.53	-	-
中信证券	2023060700024548	易事特	2023-06-07	69,100.00	10,000.00	7	3.60	48.37	-	-
中信证券	2023060700025698	吉电股份	2023-06-07	65,313.00	12,300.00	7	3.30	41.91	-	-
中信证券	2023060700025862	中来股份	2023-06-07	133,400.00	10,000.00	7	3.40	88.19	-	-
中信证券	2023060800004243	爱康科技	2023-06-08	136,230.00	57,000.00	14	3.30	224.78	-	-
中信证	2023060800017207	中来股	2023-06-08	76,380.00	5,700.00	7	3.30	49.01	-	-

券		份								
中信证券	202306080001 7449	爱康科技	2023-06 -08	194,307.0 0	81,300.0 00	7	3.30	124.6 8	-	-
中信证券	202306080001 7827	易事特	2023-06 -08	58,738.00	8,600.0 0	7	3.60	41.12	-	-
中信证券	202306080002 0508	易事特	2023-06 -08	275,932.0 0	40,400.0 00	7	3.60	193.1 5	-	-
中信证券	202306080002 0785	易事特	2023-06 -08	102,450.0 0	15,000.0 00	7	3.60	71.72	-	-
中信证券	202306080002 1742	林洋能源	2023-06 -08	75,900.00	10,000.0 00	7	3.00	44.28	-	-
中信证券	202306080002 2774	浙江新能	2023-06 -08	119,600.0 0	10,000.0 00	7	2.90	67.44	-	-
中信证券	202306080002 3392	金博股份	2023-06 -08	358,800.0 0	2,600.0 0	7	3.10	216.2 8	-	-
中信证券	202306080002 3721	协鑫集成	2023-06 -08	2,900.00	1,000.0 0	7	2.30	1.30	-	-
中信证券	202306080002 4169	露笑科技	2023-06 -08	15,444.00	2,200.0 0	7	3.40	10.21	-	-
中信证券	202306080002 4703	林洋能源	2023-06 -08	122,958.0 0	16,200.0 00	7	3.20	76.51	-	-
中信证	202306080002 7444	浙江新	2023-06 -08	119,600.0 0	10,000.0 00	7	3.30	76.74	-	-

券		能								
中信证 券	202306090000 3122	南玻 A	2023-05 -16	12,940.00	2,000.0 0	27	2.40	23.29	-	-
中信证 券	202306120004 0776	爱旭 股份	2023-06 -12	384,800.0 0	10,000. 00	7	3.40	254.4 0	-	-
中信证 券	202306120004 1468	易事 特	2023-06 -12	70,600.00	10,000. 00	7	3.60	49.42	-	-
中信证 券	202306120004 1869	中来 股份	2023-06 -12	133,100.0 0	10,000. 00	7	3.40	87.99	-	-
中信证 券	202306120004 1882	吉电 股份	2023-06 -12	442,992.0 0	83,900. 00	7	3.40	292.8 7	-	-
中信证 券	202306120004 1887	东方 日升	2023-06 -12	235,700.0 0	10,000. 00	7	3.60	164.9 9	-	-
中信证 券	202306130001 9013	高测 股份	2023-06 -13	42,170.00	1,000.0 0	7	3.60	29.52	-	-
中信证 券	202306130001 9185	联泓 新科	2023-06 -13	23,360.00	1,000.0 0	7	3.40	15.44	-	-
中信证 券	202306130001 9232	科华 数据	2023-06 -13	372,500.0 0	10,000. 00	7	3.30	239.0 2	-	-
中信证 券	202306130002 0385	易事 特	2023-06 -13	71,800.00	10,000. 00	7	3.60	50.26	-	-
中信证 券	202306130002 0460	森特 股	2023-06 -13	196,500.0 0	10,000. 00	7	3.40	129.9 1	-	-

券		份								
中信证券	2023061300020877	中来股份	2023-06-13	13,290.00	1,000.00	7	3.40	8.79	-	-
中信证券	2023061300020984	中来股份	2023-06-13	82,398.00	6,200.00	7	3.40	54.47	-	-
中信证券	2023061300021116	露笑科技	2023-06-13	73,700.00	10,000.00	7	3.40	48.72	-	-
中信证券	2023061300021609	露笑科技	2023-06-13	73,700.00	10,000.00	7	3.40	48.72	-	-
中信证券	2023061300021886	东方日升	2023-06-13	233,000.00	10,000.00	7	3.60	163.10	-	-
中信证券	2023061300022067	露笑科技	2023-06-13	73,700.00	10,000.00	7	3.40	48.72	-	-
中信证券	2023061300022280	联泓新科	2023-06-13	23,360.00	1,000.00	7	3.40	15.44	-	-
中信证券	2023061400048914	晶科科技	2023-06-14	50,000.00	10,000.00	7	3.70	35.97	-	-
中信证券	2023061400049600	太阳能	2023-06-14	205,800.00	30,000.00	7	2.70	108.05	-	-
中信证券	2023061400049673	吉电股份	2023-06-14	63,468.00	12,300.00	14	3.30	81.45	-	-
中信证	2023061400050026	中来股	2023-06-14	131,100.00	10,000.00	14	3.30	168.25	-	-

券		份								
中信证券	202306140005 1702	东方日升	2023-06 -14	225,200.0 0	10,000. 00	14	3.50	306.5 2	-	-
中信证券	202306140005 1981	易事特	2023-06 -14	71,100.00	10,000. 00	14	3.50	96.78	-	-
中信证券	202306150001 2835	TC L 科技	2023-06 -15	1,940,000 .00	500,000 .00	14	3.30	2,489. 67	-	-
中信证券	202306150001 2836	太阳能	2023-06 -15	579,630.0 0	83,400. 00	14	2.60	586.0 7	-	-
中信证券	202306150001 3216	德业股份	2023-06 -15	139,250.0 0	1,000.0 0	14	3.50	189.5 3	-	-
中信证券	202306150002 9016	协鑫集成	2023-06 -15	2,920.00	1,000.0 0	14	2.20	2.50	-	-
中信证券	202306150002 9344	林洋能源	2023-06 -15	79,800.00	10,000. 00	14	3.10	96.20	-	-
中信证券	202306150002 9617	爱旭股份	2023-06 -15	488,719.0 0	12,100. 00	7	3.40	507.7 2	-	-
中信证券	202306150003 0987	联泓新科	2023-06 -15	24,110.00	1,000.0 0	14	3.30	30.94	-	-
中信证券	202306150003 1598	易事特	2023-06 -15	107,850.0 0	15,000. 00	14	3.50	146.8 0	-	-
中信证	202306150003 4081	浙江新	2023-06 -15	118,500.0 0	10,000. 00	14	2.40	110.6 0	-	-

券		能									
中信证 券	202306150003 4430	林 洋 能 源	2023-06 -15	129,276.0 0	16,200. 00	14	3.10	155.8 5	-	-	
中信证 券	202306150003 4435	浙 江 新 能	2023-06 -15	118,500.0 0	10,000. 00	14	2.40	110.6 0	-	-	
中信证 券	202306150003 4609	易 事 特	2023-06 -15	61,834.00	8,600.0 0	14	3.50	84.16	-	-	
中信证 券	202306150003 5807	露 笑 科 技	2023-06 -15	16,104.00	2,200.0 0	14	3.30	20.67	-	-	
中信证 券	202306150003 8111	中 来 股 份	2023-06 -15	78,261.00	5,700.0 0	14	3.30	100.4 3	-	-	
中信证 券	202306150003 8112	爱 康 科 技	2023-06 -15	199,185.0 0	81,300. 00	14	3.30	255.6 2	-	-	
中信证 券	202306150003 8801	金 博 股 份	2023-06 -15	400,140.0 0	2,600.0 0	7	3.20	391.2 5	-	-	
中信证 券	202306150003 9499	易 事 特	2023-06 -15	290,476.0 0	40,400. 00	14	3.50	395.3 7	-	-	
中信证 券	202306190001 8879	爱 旭 股 份	2023-06 -19	302,500.0 0	10,000. 00	14	3.30	305.0 2	302,500.0 0	305.0 2	
中信证 券	202306190002 1701	中 来 股 份	2023-06 -19	134,300.0 0	10,000. 00	14	3.30	135.4 2	134,300.0 0	135.4 2	
中信证 券	202306190002 2420	易 事 特	2023-06 -19	72,300.00	10,000. 00	14	3.50	77.32	72,300.00	77.32	

券										
中信证券	202306200003 1446	林洋能源	2023-06 -20	79,500.00	10,000.00	14	3.10	68.46	79,500.00	68.46
中信证券	202306200003 2240	露笑科技	2023-06 -20	71,600.00	10,000.00	14	3.30	65.64	71,600.00	65.64
中信证券	202306200003 2834	双良节能	2023-06 -20	136,100.00	10,000.00	14	3.30	124.76	136,100.00	124.76
中信证券	202306200003 4987	易事特	2023-06 -20	71,700.00	10,000.00	14	3.50	69.71	71,700.00	69.71
中信证券	202306200003 5025	露笑科技	2023-06 -20	71,600.00	10,000.00	14	3.30	65.64	71,600.00	65.64
中信证券	202306200003 5185	露笑科技	2023-06 -20	71,600.00	10,000.00	14	3.30	65.64	71,600.00	65.64
中信证券	202306200003 5208	联泓新科	2023-06 -20	23,940.00	1,000.00	14	3.30	21.94	23,940.00	21.94
中信证券	202306200003 5596	中来股份	2023-06 -20	13,330.00	1,000.00	14	3.30	12.22	13,330.00	12.22
中信证券	202306200003 5826	科华数据	2023-06 -20	377,700.00	10,000.00	14	3.30	346.23	377,700.00	346.23
中信证券	202306200003 5966	中来股份	2023-06 -20	82,646.00	6,200.00	14	3.30	75.76	82,646.00	75.76
中信证	202306200003 6155	联泓新	2023-06 -20	23,940.00	1,000.00	14	3.30	21.94	23,940.00	21.94

券		科								
中信证券	202306200003 6345	高测股份	2023-06 -20	92,663.00	1,900.0 0	14	3.50	90.09	92,663.00	90.09
中信证券	202306200003 6486	森特股份	2023-06 -20	203,200.0 0	10,000. 00	14	3.30	186.2 6	203,200.0 0	186.2 6
中信证券	202306200003 6505	东方日升	2023-06 -20	238,600.0 0	10,000. 00	14	3.50	231.9 7	238,600.0 0	231.9 7
中信证券	202306200003 6670	高测股份	2023-06 -20	48,770.00	1,000.0 0	14	3.50	47.41	48,770.00	47.41
中信证券	202306210001 4671	晶科科技	2023-06 -21	48,200.00	10,000. 00	14	3.10	37.36	48,200.00	37.36
中信证券	202306210001 4869	太阳能	2023-06 -21	204,300.0 0	30,000. 00	14	2.60	3,972. 80	204,300.0 0	3,972. 80
中信证券	202306260003 6265	爱康科技	2023-06 -26	137,940.0 0	57,000. 00	14	3.30	50.58	137,940.0 0	50.58
中信证券	202306260004 0352	爱旭股份	2023-06 -26	377,641.0 0	12,100. 00	14	3.30	138.4 7	377,641.0 0	138.4 7
中信证券	202306260004 5036	金博股份	2023-06 -26	409,058.0 0	2,600.0 0	14	3.10	140.9 0	409,058.0 0	140.9 0
中信证券	202306270000 8648	吉电股份	2023-06 -27	178,976.0 0	32,900. 00	14	2.90	43.25	178,976.0 0	43.25
中信证	202306280001 0020	中来股	2023-06 -28	138,800.0 0	10,000. 00	14	3.10	23.90	138,800.0 0	23.90

券		份									
中信证 券	202306280004 4097	吉 电 股 份	2023-06 -28	67,404.00	12,300. 00	14	2.90	10.86	67,404.00	10.86	
中信证 券	202306290003 0615	易 事 特	2023-06 -29	97,350.00	15,000. 00	14	3.40	9.19	97,350.00	9.19	
中信证 券	202306290003 1221	联 泓 新 科	2023-06 -29	24,730.00	1,000.0 0	14	3.20	2.20	24,730.00	2.20	
中信证 券	202306290003 1479	浙 江 新 能	2023-06 -29	123,900.0 0	10,000. 00	14	2.70	9.29	123,900.0 0	9.29	
中信证 券	202306290003 1593	爱 康 科 技	2023-06 -29	205,689.0 0	81,300. 00	14	2.60	14.86	205,689.0 0	14.86	
中信证 券	202306290003 1654	协 鑫 集 成	2023-06 -29	2,890.00	1,000.0 0	14	1.20	0.10	2,890.00	0.10	
中信证 券	202306290003 2384	德 业 股 份	2023-06 -29	147,680.0 0	1,000.0 0	14	3.30	13.54	147,680.0 0	13.54	
中信证 券	202306290003 3631	易 事 特	2023-06 -29	55,814.00	8,600.0 0	14	3.40	5.27	55,814.00	5.27	
中信证 券	202306290003 4389	易 事 特	2023-06 -29	262,196.0 0	40,400. 00	14	3.40	24.76	262,196.0 0	24.76	
中信证 券	202306290003 5139	露 笑 科 技	2023-06 -29	17,754.00	2,200.0 0	14	1.90	0.94	17,754.00	0.94	
中信证 券	202306290003 6012	中 来 股	2023-06 -29	80,028.00	5,700.0 0	14	3.10	6.89	80,028.00	6.89	

券		份									
中信 证券	202306290004 0169	TC L 科技	2023-06 -29	1,925,000 .00	500,000 .00	14	3.40	181.8 1	1,925,000 .00	181.8 1	
中信 证券	202306290004 3351	林 洋 能源	2023-06 -29	131,706.0 0	16,200. 00	14	2.20	8.05	131,706.0 0	8.05	
中信 证券	202306290004 3426	林 洋 能源	2023-06 -29	81,300.00	10,000. 00	14	2.20	4.97	81,300.00	4.97	
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	合 约 编 号	证 券 名 称	成 交 时 间	交 易 金 额	交 易 数 量 ( 单 位 : 股 )	出 借 期 限 ( 单 位 : 天 )	费 率 ( % )	利 息 收 入	期 末 证 券 出 借 业 务 余 额	期 末 应 收 利 息 余 额	
中 信 证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	

#### 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	
	华夏中证光伏产业 指数发起式A	华夏中证光伏产业 指数发起式C	华夏中证光伏产业 指数发起式A	华夏中证光伏产业 指数发起式C
期初持有的基金份额	10,001,666.83	-	10,001,666.83	-
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	10,001,666.83	-	10,001,666.83	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	3.10%	-	4.14%	-

## 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	29,957,757.18	48,409.98	27,637,309.68	35,781.82

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	001286	陕西能源	新股发行	37,667	361,603.20
中信证券	688343	云天励飞	新股发行	6,573	288,686.16
中信证券	688539	高华科技	新股发行	5,334	203,865.48
中信证券	688146	中船特气	新股发行	4,692	169,615.80
中信证券	688581	安杰思	新股发行	1,204	151,463.20
中信证券	688522	纳睿雷达	新股发行	3,009	140,460.12
中信证券	301439	泓淋电力	新股发行	5,913	118,200.87
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	301261	恒工精密	新股发行	1,973	72,803.70
中信证券	601133	柏诚股份	新股发行	4,672	54,475.52
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	8,285	355,592.20
中信证券	688223	晶科能源	新股发行	42,671	213,355.00
中信证券	301302	华如科技	新股发行	3,435	178,723.05
中信证券	688326	经纬恒润	新股发行	1,366	165,286.00
中信证券	301200	大族数控	新股发行	2,055	157,330.80
中信证券	301109	军信股份	新股发行	4,348	151,353.88
中信证券	688150	莱特光电	新股发行	5,225	115,211.25
中信证券	688290	景业智能	新股发行	3,040	103,025.60
中信证券	600938	中国海油	新股发行	3,000	32,400.00
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
688539	高华	2023-04-11	6 个月	新	38.22	43.49	5,334	203,865.48	231,975.66	-

	科技			发 流 通 受 限						
301486	致尚科技	2023-06-30	1 个月 内(含)	新发 流 通 受 限	57.66	57.66	2,997	172,807.02	172,807.02	-
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	-
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 流 通 受 限	36.90	36.90	1,775	65,497.50	65,497.50	-

				通受限						
688249	晶合集成	2023-04-24	6 个月	新发流通受限	19.86	18.06	2,826	56,124.36	51,037.56	-
688472	阿特斯	2023-06-02	6 个月	新发流通受限	11.10	17.04	2,219	24,630.90	37,811.76	-
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	-
688361	中科飞测	2023-05-12	6 个月	新发流通受限	23.60	64.67	532	12,555.20	34,404.44	-
301325	曼恩斯特	2023-05-04	6 个月	新发流通受限	76.80	107.95	260	19,968.00	28,067.00	-
301358	湖南裕能	2023-02-01	6 个月	新发流通受限	23.77	42.89	561	13,334.97	24,061.29	-
301310	鑫宏业	2023-05-26	6 个月	新发流通受	67.28	65.43	365	24,557.20	23,881.95	-

				限						
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	-
688582	芯动 联科	2023-06-21	6 个月	新发 流通 受限	26.74	40.68	576	15,402.24	23,431.68	-
688543	国科 军工	2023-06-14	6 个月	新发 流通 受限	43.67	53.05	372	16,245.24	19,734.60	-
301307	美利 信	2023-04-14	6 个月	新发 流通 受限	32.34	31.86	618	19,986.12	19,689.48	-
301486	致尚 科技	2023-06-30	6 个月	新发 流通 受限	57.66	57.66	333	19,200.78	19,200.78	-
301291	明阳 电气	2023-06-21	6 个月	新发 流通 受限	38.13	31.03	614	23,411.82	19,052.42	-
688531	日联 科技	2023-03-24	6 个月	新发 流通 受限	152.38	135.97	139	21,180.82	18,899.83	-
301317	鑫磊	2023-01-12	6 个月	新	20.67	26.17	694	14,344.98	18,161.98	-

	股份			发 流 通 受 限						
688146	中船 特气	2023-04-13	6 个月	新 发 流 通 受 限	36.15	38.13	470	16,990.50	17,921.10	-
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	-
301262	海看 股份	2023-06-13	6 个月	新 发 流 通 受 限	30.22	25.50	683	20,640.26	17,416.50	-
688458	美芯 晟	2023-05-15	6 个月	新 发 流 通 受 限	75.00	90.76	188	14,100.00	17,062.88	-
301303	真兰 仪表	2023-02-13	6 个月	新 发 流 通 受 限	26.80	22.32	751	20,126.80	16,762.32	-
688352	顾中 科技	2023-04-11	6 个月	新 发 流 通 受 限	12.10	12.07	1,386	16,770.60	16,729.02	-
688552	航天 南湖	2023-05-08	6 个月	新 发 流 通	21.17	23.50	697	14,755.49	16,379.50	-

				通受限						
688562	航天软件	2023-05-15	6 个月	新发流通受限	12.68	22.31	726	9,205.68	16,197.06	-
688484	南芯科技	2023-03-28	6 个月	新发流通受限	39.99	36.71	435	17,395.65	15,968.85	-
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	-
301332	德尔玛	2023-05-09	6 个月	新发流通受限	14.81	13.73	1,064	15,757.84	14,608.72	-
688581	安杰思	2023-05-12	6 个月	新发流通受限	125.80	118.03	121	15,221.80	14,281.63	-
688570	天玛智控	2023-05-29	6 个月	新发流通受限	30.26	25.33	554	16,764.04	14,032.82	-
001287	中电港	2023-03-30	6 个月	新发流通受限	11.88	21.02	666	7,912.08	13,999.32	-

				限						
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	-
301305	朗坤环境	2023-05-15	6 个月	新发流通受限	25.25	19.69	686	17,321.50	13,507.34	-
301397	溯联股份	2023-06-15	6 个月	新发流通受限	53.27	40.20	336	17,898.72	13,507.20	-
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	-
688507	索辰科技	2023-04-10	6 个月	新发流通受限	245.56	122.11	108	17,925.88	13,187.88	含 证 券 送 配
301360	荣旗	2023-04-17	6 个月	新	71.88	92.60	134	9,631.92	12,408.40	-

	科技			发 流 通 受 限						
688433	华曙 高科	2023-04-07	6 个月	新 发 流 通 受 限	26.66	31.50	382	10,184.12	12,033.00	-
688512	慧智 微	2023-05-08	6 个月	新 发 流 通 受 限	20.92	19.16	620	12,970.40	11,879.20	-
301292	海科 新源	2023-06-29	6 个月	新 发 流 通 受 限	19.99	19.99	583	11,654.17	11,654.17	-
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	-
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	28.75	21.02	499	14,346.25	10,488.98	-

				通受限						
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	-
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	-
301439	泓淋电力	2023-03-10	6 个月	新发流通受限	19.99	16.90	592	11,834.08	10,004.80	-
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	-

				限						
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	-
603135	中重科技	2023-03-29	6 个月	新发流通受限	17.80	17.89	504	8,971.20	9,016.56	-
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	337	10,647.38	8,458.70	含 证 券 送 配
688535	华海	2023-03-28	6 个月	新	35.00	51.23	161	5,635.00	8,248.03	-

	诚科			发 流 通 受 限						
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 流 通 受 限	25.82	25.82	306	7,900.92	7,900.92	-
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	36.90	36.90	198	7,306.20	7,306.20	-

				通受限						
301337	亚华电子	2023-05-16	6 个月	新发流通受限	32.60	30.37	232	7,563.20	7,045.84	-
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	-
601065	江盐集团	2023-03-31	6 个月	新发流通受限	10.36	11.84	543	5,625.48	6,429.12	-
301345	涛涛车业	2023-03-10	6 个月	新发流通受限	73.45	46.64	130	9,548.50	6,063.20	-
601133	柏诚股份	2023-03-31	6 个月	新发流通受限	11.66	12.26	468	5,456.88	5,737.68	-
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	157	4,078.86	3,851.21	-

				限						
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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	出借到期日	期末估值 单价	数量（股）	期末估值总额
1	002459	晶澳科技	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 11 日	41.70	116,000.00	4,837,200.00
2	000100	TCL 科技	2023 年 7 月 11 日 -2023 年 7 月 13 日	3.94	649,200.00	2,557,848.00
3	600732	爱旭股份	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 10 日	30.75	61,800.00	1,900,350.00
4	601865	福莱特	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 3 日	38.51	30,000.00	1,155,300.00
5	603688	石英股份	2023 年 7 月 10 日 -2023 年 7 月 10 日	113.84	10,000.00	1,138,400.00
6	600089	特变电工	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 3 日	22.29	47,000.00	1,047,630.00
7	688556	高测股份	2023 年 7 月 4 日 -2023 年 7 月 24 日	53.14	19,100.00	1,014,974.00
8	601222	林洋能源	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 13 日	8.19	118,500.00	970,515.00
9	688390	固德威	2023 年 7 月 11 日 -2023 年 7 月 11 日	166.86	5,000.00	834,300.00
10	300118	东方日升	2023 年 7 月 4 日 -2023 年 7 月 10 日	25.63	31,700.00	812,471.00
11	300376	易事特	2023 年 7 月 3 日	6.70	109,600.00	734,320.00

			-2023 年 7 月 13 日			
12	002610	爱康科技	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 13 日	2.56	270,000.00	691,200.00
13	601778	晶科科技	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 5 日	4.94	138,200.00	682,708.00
14	300861	美畅股份	2023 年 7 月 4 日 -2023 年 7 月 11 日	43.37	13,200.00	572,484.00
15	300393	中来股份	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 13 日	14.04	37,800.00	530,712.00
16	605117	德业股份	2023 年 7 月 4 日 -2023 年 7 月 13 日	149.55	3,000.00	448,650.00
17	688598	金博股份	2023 年 7 月 10 日 -2023 年 7 月 10 日	171.50	2,600.00	445,900.00
18	003022	联泓新科	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 13 日	24.90	17,900.00	445,710.00
19	000875	吉电股份	2023 年 7 月 4 日 -2023 年 7 月 12 日	5.39	77,300.00	416,647.00
20	603806	福斯特	2023 年 7 月 5 日 -2023 年 7 月 5 日	37.19	10,000.00	371,900.00
21	002335	科华数据	2023 年 7 月 4 日 -2023 年 7 月 4 日	35.95	10,000.00	359,500.00
22	003035	南网能源	2023 年 7 月 12 日 -2023 年 7 月 12 日	7.12	44,000.00	313,280.00
23	002617	露笑科技	2023 年 7 月 4 日 -2023 年 7 月 13 日	7.88	35,300.00	278,164.00
24	603098	森特股份	2023 年 7 月 4 日 -2023 年 7 月 4 日	20.50	10,000.00	205,000.00
25	000591	太阳能	2023 年 7 月 5 日 -2023 年 7 月 5 日	6.78	30,000.00	203,400.00
26	601908	京运通	2023 年 7 月 4 日 -2023 年 7 月 4 日	6.05	30,000.00	181,500.00
27	600481	双良节能	2023 年 7 月 4 日 -2023 年 7 月 4 日	13.98	10,000.00	139,800.00
28	600032	浙江新能	2023 年 7 月 13 日 -2023 年 7 月 13 日	12.56	10,000.00	125,600.00
29	002518	科士达	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 3 日	40.01	1,000.00	40,010.00
30	002506	协鑫集成	2023 年 7 月 13 日 -2023 年 7 月 13 日	2.93	1,000.00	2,930.00
合计	-	-	-	-	1,949,200.00	23,458,403.00

注：出借证券中如有其他流通受限的情况详见本报告“本基金持有的流通受限证券”部分内容。

#### 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	471,614,405.98	94.53	372,307,740.50	94.76
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
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	471,614,405.98	94.53	372,307,740.50	94.76

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	除中证光伏产业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%	-23,609,371.35	-18,719,276.15
	+5%	23,609,371.35	18,719,276.15

#### 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	469,622,466.77
第二层次	779,520.78
第三层次	1,212,418.43
合计	471,614,405.98

###### 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	471,614,405.98	92.04
	其中：股票	471,614,405.98	92.04
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	30,245,594.38	5.90
8	其他各项资产	10,540,675.48	2.06
9	合计	512,400,675.84	100.00

注：报告期末，本基金参与转融通证券出借业务借出股票的公允价值为 23,458,403.00 元，占本基金期末资产净值的 4.70%。

### 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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	452,551,830.71	90.71
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,757,145.47	2.76

E	建筑业	1,498,137.68	0.30
F	批发和零售业	23,453.52	0.00
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	94,080.40	0.02
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	3,644,728.00	0.73
N	水利、环境和公共设施管理业	21,247.34	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	23,782.86	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	471,614,405.98	94.53

## 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	601012	隆基绿能	1,526,527	43,765,529.09	8.77
2	300274	阳光电源	351,200	40,960,456.00	8.21
3	002129	TCL 中环	1,091,750	36,246,100.00	7.26
4	600438	通威股份	912,600	31,311,306.00	6.28
5	600089	特变电工	1,313,600	29,280,144.00	5.87
6	002459	晶澳科技	557,340	23,241,078.00	4.66
7	000100	TCL 科技	5,075,100	19,995,894.00	4.01
8	300316	晶盛机电	221,000	15,668,900.00	3.14
9	688599	天合光能	367,110	15,642,557.10	3.14
10	600732	爱旭股份	370,260	11,385,495.00	2.28
11	300724	捷佳伟创	94,043	10,565,731.05	2.12
12	601877	正泰电器	363,129	10,040,516.85	2.01
13	688223	晶科能源	675,634	9,499,414.04	1.90
14	603806	福斯特	251,881	9,367,454.39	1.88
15	688303	大全能源	216,614	8,762,036.30	1.76
16	605117	德业股份	58,080	8,685,864.00	1.74
17	300751	迈为股份	47,096	7,977,120.48	1.60
18	300763	锦浪科技	67,000	6,974,700.00	1.40
19	603688	石英股份	61,000	6,944,240.00	1.39
20	601865	福莱特	172,000	6,623,720.00	1.33
21	000591	太阳能	924,400	6,267,432.00	1.26
22	300118	东方日升	231,100	5,923,093.00	1.19

23	002865	钧达股份	38,300	5,841,899.00	1.17
24	688390	固德威	34,865	5,817,573.90	1.17
25	688598	金博股份	31,876	5,466,734.00	1.10
26	600481	双良节能	379,248	5,301,887.04	1.06
27	603185	弘元绿能	69,440	5,176,752.00	1.04
28	002056	横店东磁	274,800	5,004,108.00	1.00
29	688516	奥特维	26,190	4,934,196.00	0.99
30	002506	协鑫集成	1,581,000	4,632,330.00	0.93
31	688556	高测股份	86,715	4,608,035.10	0.92
32	300393	中来股份	294,500	4,134,780.00	0.83
33	002617	露笑科技	519,700	4,095,236.00	0.82
34	688032	禾迈股份	11,325	4,022,073.75	0.81
35	601222	林洋能源	487,100	3,989,349.00	0.80
36	002335	科华数据	109,200	3,925,740.00	0.79
37	002610	爱康科技	1,513,200	3,873,792.00	0.78
38	003035	南网能源	511,900	3,644,728.00	0.73
39	000875	吉电股份	659,800	3,556,322.00	0.71
40	003022	联泓新科	135,400	3,371,460.00	0.68
41	002518	科士达	78,700	3,148,787.00	0.63
42	300776	帝尔激光	46,204	2,998,639.60	0.60
43	601778	晶科科技	603,200	2,979,808.00	0.60
44	601908	京运通	489,695	2,962,654.75	0.59
45	300861	美畅股份	64,900	2,814,713.00	0.56
46	300376	易事特	392,300	2,628,410.00	0.53
47	688680	海优新材	17,046	2,076,543.72	0.42
48	603098	森特股份	72,800	1,492,400.00	0.30
49	600032	浙江新能	73,100	918,136.00	0.18
50	301268	铭利达	13,600	569,432.00	0.11
51	688539	高华科技	5,334	231,975.66	0.05
52	301291	明阳电气	6,138	199,134.82	0.04
53	301486	致尚科技	3,330	192,007.80	0.04
54	301210	金杨股份	2,801	143,168.37	0.03
55	301397	溯联股份	3,356	141,555.20	0.03
56	301395	仁信新材	5,196	138,629.28	0.03
57	301292	海科新源	5,824	116,421.76	0.02
58	301488	豪恩汽电	2,618	104,144.04	0.02
59	301202	朗威股份	3,060	79,009.20	0.02
60	300804	广康生化	2,257	77,134.83	0.02
61	688603	天承科技	1,391	76,505.00	0.02
62	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	0.01
63	688249	晶合集成	2,826	51,037.56	0.01
64	688472	阿特斯	2,219	37,811.76	0.01
65	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.01

66	688361	中科飞测	532	34,404.44	0.01
67	301325	曼恩斯特	260	28,067.00	0.01
68	301358	湖南裕能	561	24,061.29	0.00
69	301310	鑫宏业	365	23,881.95	0.00
70	301293	三博脑科	333	23,782.86	0.00
71	688582	芯动联科	576	23,431.68	0.00
72	688543	国科军工	372	19,734.60	0.00
73	301307	美利信	618	19,689.48	0.00
74	688531	日联科技	139	18,899.83	0.00
75	301317	鑫磊股份	694	18,161.98	0.00
76	688146	中船特气	470	17,921.10	0.00
77	301383	天键股份	493	17,609.96	0.00
78	301262	海看股份	683	17,416.50	0.00
79	688458	美芯晟	188	17,062.88	0.00
80	301303	真兰仪表	751	16,762.32	0.00
81	688352	颀中科技	1,386	16,729.02	0.00
82	688552	航天南湖	697	16,379.50	0.00
83	688562	航天软件	726	16,197.06	0.00
84	688484	南芯科技	435	15,968.85	0.00
85	301399	英特科技	293	15,110.01	0.00
86	301332	德尔玛	1,064	14,608.72	0.00
87	688581	安杰思	121	14,281.63	0.00
88	688570	天玛智控	554	14,032.82	0.00
89	001287	中电港	666	13,999.32	0.00
90	301387	光大同创	307	13,925.52	0.00
91	301305	朗坤环境	686	13,507.34	0.00
92	301382	蜂助手	408	13,398.72	0.00
93	688507	索辰科技	108	13,187.88	0.00
94	301360	荣旗科技	134	12,408.40	0.00
95	688433	华曙高科	382	12,033.00	0.00
96	688512	慧智微	620	11,879.20	0.00
97	688523	航天环宇	472	11,257.20	0.00
98	301141	中科磁业	262	11,184.78	0.00
99	301225	恒勃股份	333	11,075.58	0.00
100	301429	森泰股份	499	10,488.98	0.00
101	688631	莱斯信息	336	10,036.32	0.00
102	301439	泓淋电力	592	10,004.80	0.00
103	688479	友车科技	332	9,790.68	0.00
104	301232	飞沃科技	165	9,639.30	0.00
105	301376	致欧科技	420	9,454.20	0.00
106	301355	南王科技	563	9,430.25	0.00
107	301357	北方长龙	190	9,194.10	0.00
108	603135	中重科技	504	9,016.56	0.00

109	301386	未来电器	378	8,992.62	0.00
110	301323	新莱福	228	8,974.08	0.00
111	688429	时创能源	346	8,833.38	0.00
112	301170	锡南科技	250	8,732.50	0.00
113	301281	科源制药	337	8,458.70	0.00
114	688535	华海诚科	161	8,248.03	0.00
115	301157	华塑科技	150	7,939.50	0.00
116	301295	美硕科技	215	7,755.05	0.00
117	301203	国泰环保	225	7,740.00	0.00
118	301337	亚华电子	232	7,045.84	0.00
119	301428	世纪恒通	229	7,007.40	0.00
120	601065	江盐集团	543	6,429.12	0.00
121	301345	涛涛车业	130	6,063.20	0.00
122	601133	柏诚股份	468	5,737.68	0.00
123	001380	华纬科技	170	5,232.60	0.00
124	603125	常青科技	157	3,851.21	0.00
125	001328	登康口腔	145	3,696.05	0.00
126	001282	三联锻造	105	3,468.15	0.00
127	001360	南矿集团	177	2,631.99	0.00
128	001324	长青科技	114	2,234.40	0.00
129	001367	海森药业	55	2,171.40	0.00
130	603172	万丰股份	122	1,967.86	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	601012	隆基绿能	28,231,695.96	7.19
2	000100	TCL 科技	20,733,646.50	5.28
3	300274	阳光电源	17,579,305.29	4.47
4	002129	TCL 中环	16,780,116.63	4.27
5	600438	通威股份	16,102,292.39	4.10
6	600089	特变电工	12,928,266.00	3.29
7	002459	晶澳科技	9,846,632.40	2.51
8	688599	天合光能	8,890,928.72	2.26
9	688223	晶科能源	8,716,282.71	2.22
10	688303	大全能源	6,774,453.32	1.72
11	300316	晶盛机电	6,759,600.00	1.72
12	002865	钧达股份	5,373,548.14	1.37
13	300724	捷佳伟创	4,735,703.00	1.21
14	603806	福斯特	4,680,022.62	1.19
15	601877	正泰电器	4,633,967.64	1.18

16	300763	锦浪科技	4,505,139.00	1.15
17	300751	迈为股份	4,242,843.73	1.08
18	688032	禾迈股份	4,184,196.45	1.06
19	605117	德业股份	4,094,277.00	1.04
20	600732	爱旭股份	3,788,327.00	0.96

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	300274	阳光电源	10,298,573.00	2.62
2	002129	TCL 中环	8,870,681.50	2.26
3	600438	通威股份	8,330,620.00	2.12
4	600089	特变电工	7,504,433.00	1.91
5	601012	隆基绿能	4,703,342.70	1.20
6	688599	天合光能	4,421,675.19	1.13
7	300316	晶盛机电	3,868,621.00	0.98
8	603063	禾望电气	3,570,910.00	0.91
9	000012	南玻 A	3,540,386.00	0.90
10	600151	航天机电	3,315,581.00	0.84
11	688408	中信博	2,732,964.68	0.70
12	601877	正泰电器	2,648,629.00	0.67
13	300724	捷佳伟创	2,548,505.00	0.65
14	603806	福斯特	2,334,321.00	0.59
15	002459	晶澳科技	2,333,645.00	0.59
16	605117	德业股份	2,209,930.00	0.56
17	300751	迈为股份	2,028,799.18	0.52
18	300763	锦浪科技	1,977,968.00	0.50
19	603688	石英股份	1,820,633.00	0.46
20	300118	东方日升	1,816,218.00	0.46

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	267,991,432.46
卖出股票收入（成交）总额	121,549,833.65

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

本基金本报告期末无股指期货投资。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末无国债期货投资。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货投资。

7.12 投资组合报告附注

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

7.12.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	55,714.15
2	应收清算款	6,192,973.59
3	应收股利	3,840.00
4	应收利息	-
5	应收申购款	4,279,019.89
6	其他应收款	9,127.85
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,540,675.48

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	002459	晶澳科技	4,837,200.00	0.97	转融通出借证券受限
2	000100	TCL 科技	2,557,848.00	0.51	转融通出借证券受限
3	600732	爱旭股份	1,900,350.00	0.38	转融通出借证券受限
4	600089	特变电工	1,047,630.00	0.21	转融通出借证券受限

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## §8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
华夏中证光伏产业指数发起式 A	23,569	13,687.29	15,450,015.41	4.79%	307,145,625.98	95.21%
华夏中证光伏产业指数发起式 C	24,049	14,381.32	2,710,761.72	0.78%	343,145,496.08	99.22%
合计	47,618	14,037.80	18,160,777.13	2.72%	650,291,122.06	97.28%

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	华夏中证光伏产业指数发起式 A	902,014.80	0.28%

有本基金	华夏中证光伏产业指数发起式 C	22,778.53	0.01%
	合计	924,793.33	0.14%

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	华夏中证光伏产业指数发起式 A	0
	华夏中证光伏产业指数发起式 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	华夏中证光伏产业指数发起式 A	0
	华夏中证光伏产业指数发起式 C	0
	合计	0

## 8.4 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	10,001,666.83	1.50%	10,000,000.00	1.50%	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	10,001,666.83	1.50%	10,000,000.00	1.50%	不少于三年

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华夏中证光伏产业指数发起式 A	华夏中证光伏产业指数发起式 C
基金合同生效日（2021 年 8 月 17 日）基金份额总额	178,273,122.59	85,198,709.71
本报告期期初基金份额总额	258,402,771.06	224,021,152.95
本报告期基金总申购份额	195,379,756.33	537,678,916.07
减：本报告期基金总赎回份额	131,186,886.00	415,843,811.22
本报告期基金拆分变动份额	-	-

本报告期末基金份额总额	322,595,641.39	345,856,257.80
-------------	----------------	----------------

## §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	
中信证券	11	168,064,249.67	44.42%	72,487.69	44.42%	-
招商证券	6	105,240,005.92	27.82%	45,390.08	27.82%	-
中信建投证券	4	95,063,507.37	25.13%	41,001.29	25.13%	-
兴业证券	1	9,948,192.97	2.63%	4,290.35	2.63%	-

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、西部证券、中金公司、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
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	1,549,993.69	100.00%	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-

#### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华夏基金管理有限公司公告	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
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	2023-04-01
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	2023-04-13
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	2023-04-15
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	2023-04-27
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	2023-05-13
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	2023-05-27
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	2023-05-31

## §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

本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况。

## §12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予基金注册的文件；
- 2、《华夏中证光伏产业指数发起式证券投资基金基金合同》；

- 3、《华夏中证光伏产业指数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