

**华夏科技龙头两年持有期混合型证券投资基金**  
**(原华夏科技龙头两年定期开放混合型证券投资基金转型)**

**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：中国光大银行股份有限公司

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。

基金托管人中国光大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。

基金管理人于 2023 年 2 月 20 日发布公告，以通讯方式召开华夏科技龙头两年定期开放混合型证券投资基金的基金份额持有人大会，审议《关于华夏科技龙头两年定期开放混合型证券投资基金转型为华夏科技龙头两年持有期混合型证券投资基金有关事项的议案》，会议议案于 2023 年 3 月 28 日获得通过，大会决议自同日起生效。自 2023 年 4 月 27 日起，“华夏科技龙头两年定期开放混合型证券投资基金”正式转型为“华夏科技龙头两年持有期混合型证券投资基金”。

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。

华夏科技龙头两年持有期混合型证券投资基金报告期自 2023 年 4 月 27 日起至 2023 年 6 月 30 日止，原华夏科技龙头两年定期开放混合型证券投资基金报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 2023 年 4 月 26 日止。如无特殊说明，本报告中“本基金”指华夏科技龙头两年持有期混合型证券投资基金及华夏科技龙头两年定期开放混合型证券投资基金。

1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	1
§2 基金简介.....	4
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	6
3.1 华夏科技龙头两年持有期混合型证券投资基金.....	6
3.1.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.1.2 基金净值表现.....	7
3.2 华夏科技龙头两年定期开放混合型证券投资基金.....	8
3.2.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2.2 基金净值表现.....	8
§4 管理人报告.....	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.1.2 华夏科技龙头两年持有期混合型证券投资基金.....	11
4.1.3 华夏科技龙头两年定期开放混合型证券投资基金.....	12
§5 托管人报告.....	15
§6 中期报告财务会计报告（未经审计）.....	16
6.1 华夏科技龙头两年持有期混合型证券投资基金.....	16
6.1.1 资产负债表.....	16
6.1.2 利润表.....	17
6.1.3 净资产（基金净值）变动表.....	18
6.1.4 报表附注.....	19
6.2 华夏科技龙头两年定期开放混合型证券投资基金.....	44
6.2.1 资产负债表.....	44
6.2.2 利润表.....	46
6.2.3 净资产（基金净值）变动表.....	47
6.2.4 报表附注.....	48
§7 投资组合报告.....	71
7.1 华夏科技龙头两年持有期混合型证券投资基金.....	71
7.1.1 期末基金资产组合情况.....	71
7.1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	72
7.1.3 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.....	73
7.1.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	76
7.1.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	77
7.1.6 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.....	78
7.1.7 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.....	78
7.1.8 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.....	78
7.1.9 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.....	78
7.1.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	78
7.1.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	78
7.1.12 投资组合报告附注.....	78
7.2 华夏科技龙头两年定期开放混合型证券投资基金.....	79
7.2.1 期末基金资产组合情况.....	79
7.2.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	80
7.2.3 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.....	81

7.2.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	83
7.2.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	85
7.2.6 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 .....	85
7.2.7 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.....	85
7.2.8 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.....	85
7.2.9 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 .....	85
7.2.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	85
7.2.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	85
7.2.12 投资组合报告附注 .....	85
§8 基金份额持有人信息 .....	86
8.1 华夏科技龙头两年持有期混合型证券投资基金 .....	86
8.2 华夏科技龙头两年定期开放混合型证券投资基金 .....	86
§9 开放式基金份额变动 .....	87
9.1 华夏科技龙头两年持有期混合型证券投资基金 .....	87
9.2 华夏科技龙头两年定期开放混合型证券投资基金 .....	87
§10 重大事件揭示 .....	87
§11 影响投资者决策的其他重要信息 .....	92
§12 备查文件目录 .....	92

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

#### 2.1.1 华夏科技龙头两年持有期混合型证券投资基金

基金名称	华夏科技龙头两年持有期混合型证券投资基金
基金简称	华夏科技龙头两年持有混合
基金主代码	010180
交易代码	010180
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2023 年 4 月 27 日
基金管理人	华夏基金管理有限公司
基金托管人	中国光大银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,992,850,477.65 份
基金合同存续期	不定期

#### 2.1.2 华夏科技龙头两年定期开放混合型证券投资基金

基金名称	华夏科技龙头两年定期开放混合型证券投资基金
基金简称	华夏科技龙头两年定开混合
基金主代码	010180
交易代码	010180
基金运作方式	契约型定期开放式
基金合同生效日	2020 年 10 月 26 日
基金管理人	华夏基金管理有限公司
基金托管人	中国光大银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	2,036,507,265.61 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

#### 2.2.1 华夏科技龙头两年持有期混合型证券投资基金

投资目标	在严格控制风险的前提下，精选科技龙头主题投资标的，追求超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	主要投资策略包括资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、股票期权投资策略、国债期货投资策略等。在股票投资策略上，本基金所指的科技龙头是指科技产业中拥有稳定或独特盈利模式、较高的“护城河”、具备“定价权”、优秀的管理层、市场空间广阔，已经或者未来有望成为所在领域龙头的相关企业。在具体行业配置方面，本基金界定的科技龙头主题相关上市公司包括信息技术、电子通信、集成电路、半导体、高端制造、新能源、新材料、科技含量较高的医药研发设备和医疗器械、节能环保、国防电子等领域的公司。

业绩比较基准	中证 TMT150 指数收益率*60%+中证港股通综合指数收益率*20%+中债综合（全价）指数收益率*20%。
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险和预期收益低于股票基金，高于债券基金与货币市场基金，属于中风险品种。本基金还将通过港股通渠道投资于香港证券市场，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还将面临汇率风险、香港市场风险等特殊投资风险。

### 2.2.2 华夏科技龙头两年定期开放混合型证券投资基金

投资目标	在严格控制风险的前提下，精选科技龙头主题投资标的，追求超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	主要投资策略包括资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、股票期权投资策略、国债期货投资策略、参与转融通证券出借业务等。在股票投资策略上，本基金所指的科技龙头是指科技产业中拥有稳定或独特盈利模式、较高的“护城河”、具备“定价权”、优秀的管理层、市场空间广阔，已经或者未来有望成为所在领域龙头的相关企业。在具体行业配置方面，本基金界定的科技龙头主题相关上市公司包括信息技术、电子通信、集成电路、半导体、高端制造、高端装备、新能源、新材料、医药生物、节能环保、国防军工、航空航天等领域的公司。
业绩比较基准	中证 TMT150 指数收益率*60%+中证港股通综合指数收益率*20%+中债综合（全价）指数收益率*20%。
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险和预期收益低于股票基金，高于债券基金与货币市场基金，属于中风险品种。本基金还将通过港股通渠道投资于香港证券市场，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还将面临汇率风险、香港市场风险等特殊投资风险。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	华夏基金管理有限公司	中国光大银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李彬
	联系电话	400-818-6666
	电子邮箱	service@ChinaAMC.com
客户服务电话	400-818-6666	95595
传真	010-63136700	010-63639132
注册地址	北京市顺义区安庆大街甲3号院	北京市西城区太平桥大街25号、甲25号中国光大中心
办公地址	北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座8层	北京市西城区太平桥大街25号中国光大中心

邮政编码	100033	100033
法定代表人	杨明辉	王江

## 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 华夏科技龙头两年持有期混合型证券投资基金

### 3.1.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1.1 期间数据和指标	报告期(2023 年 4 月 27 日至 2023 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-4,691,505.77
本期利润	46,226,037.64
加权平均基金份额本期利润	0.0230
本期加权平均净值利润率	3.27%
本期基金份额净值增长率	3.36%
3.1.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023年6月30日)
期末可供分配利润	-609,357,497.59
期末可供分配基金份额利润	-0.3058
期末基金资产净值	1,423,212,788.73
期末基金份额净值	0.7142
3.1.1.3 累计期末指标	报告期末(2023年6月30日)
基金份额累计净值增长率	3.36%

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。

④自 2023 年 4 月 27 日起,“华夏科技龙头两年定期开放混合型证券投资基金”正式转型为“华夏科技龙头两年持有期混合型证券投资基金”。

### 3.1.2 基金净值表现

#### 3.1.2.1 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

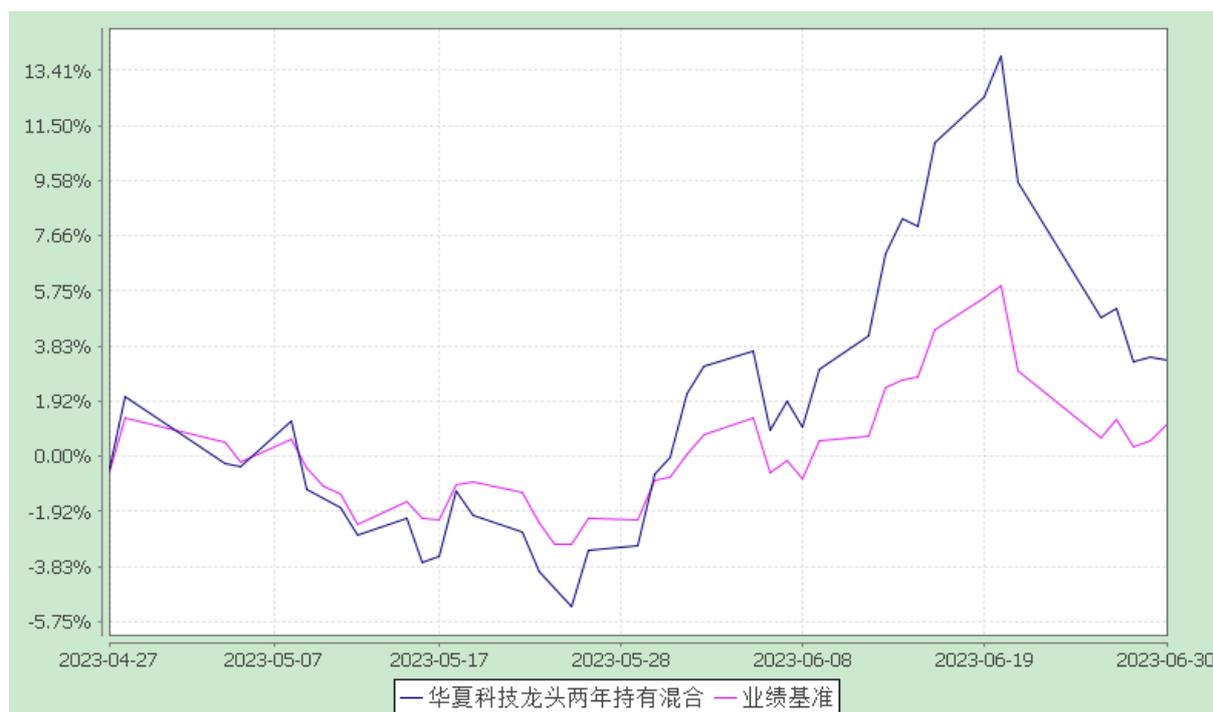
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	3.43%	2.00%	1.83%	1.22%	1.60%	0.78%
自基金转型起至今	3.36%	1.72%	1.10%	1.04%	2.26%	0.68%

#### 3.1.2.2 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

华夏科技龙头两年持有期混合型证券投资基金

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

(2023 年 4 月 27 日至 2023 年 6 月 30 日)



注: ①自 2023 年 4 月 27 日起, 原华夏科技龙头两年定期开放混合型证券投资基金基金转型为华夏科技龙头两年持有期混合型证券投资基金。

②根据本基金的基金合同规定, 本基金自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同中投资范围、投资限制的有关约定。

### 3.2 华夏科技龙头两年定期开放混合型证券投资基金

#### 3.2.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.2.1.1 期间数据和指标	报告期(2023 年 1 月 1 日至 2023 年 4 月 26 日)
本期已实现收益	-53,346,736.04
本期利润	-37,562,088.54
加权平均基金份额本期利润	-0.0182
本期加权平均净值利润率	-2.45%
本期基金份额净值增长率	-2.70%
3.2.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023年4月26日)
期末可供分配利润	-629,180,271.15
期末可供分配基金份额利润	-0.3090
期末基金资产净值	1,407,326,994.46
期末基金份额净值	0.6910
3.2.1.3 累计期末指标	报告期末(2023年4月26日)
基金份额累计净值增长率	-30.90%

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。

④自 2023 年 4 月 27 日起，“华夏科技龙头两年定期开放混合型证券投资基金”正式转型为“华夏科技龙头两年持有期混合型证券投资基金”。

#### 3.2.2 基金净值表现

##### 3.2.2.1 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

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
2023 年 1 月 1 日至 2023 年 4 月 26 日	-2.70%	1.74%	11.34%	1.14%	-14.04%	0.60%
过去一个月	-6.72%	1.92%	-2.81%	1.40%	-3.91%	0.52%
过去三个月	-10.06%	1.81%	3.95%	1.21%	-14.01%	0.60%
过去六个月	-6.28%	1.56%	16.67%	1.10%	-22.95%	0.46%
过去一年	-1.41%	1.68%	18.51%	1.12%	-19.92%	0.56%
自基金合同生效起至	-30.90%	1.69%	-12.53%	1.09%	-18.37%	0.60%

2023 年 4 月 26 日						
--------------------	--	--	--	--	--	--

3.2.2.2 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

华夏科技龙头两年定期开放混合型证券投资基金  
 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  
 (2020 年 10 月 26 日至 2023 年 4 月 26 日)



## §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上, 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”奖评选活动上, 华夏基金将三大基金奖项收入囊中: 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 华夏科技龙头两年持有期混合型证券投资基金

##### 4.1.2.1 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		
刘平	本基金的基金经理	2023-04-27	-	16 年	硕士。2007 年 2 月加入华夏基金管理有限公司。历任行业研究员、投资经理、机构投资部总监、华夏优势增长混合型证

					券投资基金基金经理（2015年11月30日至2020年7月28日期间）、华夏领先股票型证券投资基金基金经理（2020年7月21日至2023年3月16日期间）、华夏科技龙头两年定期开放混合型证券投资基金基金经理（2020年10月26日至2023年4月26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。

#### 4.1.3 华夏科技龙头两年定期开放混合型证券投资基金

##### 4.1.3.1 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		
刘平	本基金的基金经理	2020-10-26	2023-04-26	16年	硕士。2007年2月加入华夏基金管理有限公司。历任行业研究员、投资经理、机构投资部总监、华夏优势增长混合型证券投资基金基金经理（2015年11月30日至2020年7月28日期间）、华夏领先股票型证券投资基金基金经理（2020年7月21日至2023年3月16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

上半年宏观经济 1 季度反弹、2 季度疲软，复苏的持续度低于预期、政策出台低于预期。上半年国内经济面临一些困难，国内需求不足、一些企业经营困难、外部环境也较为严峻，经济在恢复中，但是过程曲折。1 季度国内经济方面，我国疫情管控于 2022 年 12 月放开后，各项生产活动和生活秩序有序恢复，消费平稳恢复，新开工等基建也在缓慢复苏。为推动经济实现质的有效提升和量的合理增长，央行于 3 月 27 日降低金融机构存款准备金率 0.25 个百分点。1 季度经济的反弹到了 2 季度阶段性放缓，消费意愿较弱，需求疲软，央行于 6 月 20 日下调了 LPR（贷款市场报价利率）10 个基点。国际经济方面，1 季度美国通胀回落，美联储的态度转向鸽派，2 月和 3 月加息幅度都是只有 25 个基点。但是到了 2 季度美国经济表现出的韧性超预期，美联储继续年内第 3 次加息，于 5 月 3 日将联邦基金利率目标区间上调 25 个基点到 5%至 5.25%之间，从 2 季度开始美元对人民币汇率持续走强。

上半年 A 股表现疲软，沪深 300 指数跌 0.75%，上半年基本持平，但实际走了个过山车、先涨后跌。A 股上半年的市场交易主线有两条，分别是生成式 AI 和中特估。指数虽然上半年基本持平，但是行业分化严重，A 股里上半年涨幅较高的行业是传媒、通信、计算、以及家电、建筑和石化，前三个行业对应 AI 的行情，后两个行业的上涨主要是体现为中特估行情，而跌幅较大的行业是消费者服务、房地产、建材，这些板块走跌是整体国内需求较弱的体现。港股受到地缘政治和人民币贬值的影响表现较弱，恒生指数上半年收跌 4.9%。

本基金降低了港股的配置，主要对一些竞争格局短期不明朗的公司做了适当回避。对 AI 应用端的个股进行了波段交易，对部分估值较贵的个股进行了部分锁盈，同时也增配了一些 AI 在教育端落

地的个股配置，阶段性参与了 AI 算力的投资机会，增加了半导体板块的配置，从中长期个股阿尔法的角度增加了智能驾驶以及高端制造相关的个股配置。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

转型前，截至 2023 年 4 月 26 日，华夏科技龙头两年定期开放混合份额净值为 0.6910，2023 年 1 月 1 日至 4 月 26 日期间份额净值增长率为-2.70%，同期业绩比较基准收益率为 11.34%；转型后，截至 2023 年 6 月 30 日，华夏科技龙头两年持有期混合份额净值为 0.7142，2023 年 4 月 27 日至 6 月 30 日期间份额净值增长率为 3.36%；同期业绩比较基准收益率为 1.10%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

由于第 2 季度国内经济的恢复速度放缓，市场对于经济的预期从乐观走向过于悲观，这一般也是底部特征的信号之一。目前权益市场的性价比较高，股债比处于过去 10 年的 22% 的分位，已经很低了，按照历史统计来看，后市在未来走出正收益的概率较高。2 季度经济环比回落超预期是去库存周期和政策落实偏慢的共同结果，后续这两个因素都会发生变化。对于下半年的投资机会，一个是持续成长的主线—AI，一个是周期框架下的周期成长主线—汽车。AI 的板块虽然在调整，但是 AI 这个技术方向对我们工作和生活的影响将会是巨大的，从目前的办公小助手对工作效率的提升，到未来的具身智能的人形机器人对我们日常生活带来的全面改变，这都是必然会发生的，虽然目前在 A 股更多是主题投资的阶段，这时我们往往会高估一个新技术在短期的影响，甚至演绎出一场泡沫，但是却同时会低估这个技术在长期对我们带来的变革，围绕着生成式 AI 去挖掘投资机会会是一个贯穿全年甚至十年的方向，这是一场巨大的新技术引领的诞生下一个巨头的机会，产业界在兑现的技术的落地为产品，必将映射落实到投资标的上，应用端和算力端都是我们重点关注的方向。其实云计算公司的格局大概率就是 AI 公司的格局，所以我们在 5 年前就开始投资的 IAAS 和 SAAS 公司都会是这一轮生成式 AI 中的率先发布产品的公司。对于汽车的投资机会，我们认为新能源车在经历了竞争加剧、价格下跌和销量压力后，下半年将会看到供给拉动带来的销量恢复，有阶段性的投资机会。还有其他一些更细分领域的投资机会，比如来自于华为产业链、以及苹果的 Vision Pro，市场会逐渐上修明年后年 MR 出货量的预期。

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

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及基金合同约定，本基金管理人为准确、及时进行基金估值和份额净值计价，制定了基金估值和份额净值计价的业务管理制度，建立了估值委员会，使用可靠的估值业

务系统，设有完善的风险监测、控制和报告机制。本基金托管人审阅本基金管理人采用的估值原则及技术，并复核、审查基金资产净值和基金份额申购、赎回价格。会计师事务所在估值调整导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上时对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性发表专业意见。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期未进行利润分配，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

本报告期内，中国光大银行股份有限公司在华夏科技龙头两年持有期混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）托管过程中，严格遵守了《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》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，依法安全保管了基金的全部资产，对本基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督，对发现的问题及时提出了意见和建议。同时，按规定如实、独立地向监管机构提交了本基金运作情况报告，没有发生任何损害基金份额持有人利益的行为，诚实信用、勤勉尽责地履行了作为基金托管人所应尽的义务。

### 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

本报告期内，中国光大银行股份有限公司依据《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》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，对基金管理人的投资运作、信息披露等行为进行了复核、监督，未发现基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金在运作中遵守了有关法律法规的要求，各重要方面由投资管理人依据基金合同及实际运作情况进行处理。

### 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

中国光大银行股份有限公司依法对基金管理人编制的《华夏科技龙头两年持有期混合型证券投资基金 2023 年中期报告》进行了复核，认为报告中相关财务指标、净值表现、财务会计报告（注：

财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内)、投资组合报告等内容真实、准确。

## §6 中期报告财务会计报告（未经审计）

### 6.1 华夏科技龙头两年持有期混合型证券投资基金

#### 6.1.1 资产负债表

会计主体：华夏科技龙头两年持有期混合型证券投资基金

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
<b>资产：</b>		
银行存款	6.1.4.7.1	136,957,554.38
结算备付金		810,734.75
存出保证金		442,501.33
交易性金融资产	6.1.4.7.2	1,306,183,124.95
其中：股票投资		1,235,456,007.14
基金投资		-
债券投资		70,727,117.81
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
其他投资		-
衍生金融资产	6.1.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.1.4.7.4	-
应收清算款		-
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	6.1.4.7.5	-
资产总计		1,444,393,915.41
<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>负债：</b>		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.1.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-

应付清算款		16,623,912.21
应付赎回款		602,207.32
应付管理人报酬		1,805,015.22
应付托管费		300,835.90
应付销售服务费		-
应付投资顾问费		-
应交税费		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.1.4.7.6	1,849,156.03
负债合计		21,181,126.68
<b>净资产：</b>		
实收基金	6.1.4.7.7	1,992,850,477.65
未分配利润	6.1.4.7.8	-569,637,688.92
净资产合计		1,423,212,788.73
负债和净资产总计		1,444,393,915.41

注：①报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.7142 元，基金份额总额 1,992,850,477.65 份。

②自 2023 年 4 月 27 日起，原华夏科技龙头两年定期开放混合型证券投资基金转型为华夏科技龙头两年持有期混合型证券投资基金，本报告期自 2023 年 4 月 27 日至 2023 年 6 月 30 日。

### 6.1.2 利润表

会计主体：华夏科技龙头两年持有期混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 4 月 27 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期
		2023 年 4 月 27 日至 2023 年 6 月 30 日
一、营业总收入		50,742,728.02
1.利息收入		68,508.06
其中：存款利息收入	6.1.4.7.9	68,508.06
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）		-243,323.45
其中：股票投资收益	6.1.4.7.10	-4,393,337.89
基金投资收益		-
债券投资收益	6.1.4.7.11	235,242.81
资产支持证券投资收益	6.1.4.7.12	-

贵金属投资收益		-
衍生工具收益	6.1.4.7.13	-
股利收益	6.1.4.7.14	3,914,771.63
其他投资收益		-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.1.4.7.15	50,917,543.41
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.1.4.7.16	-
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>4,516,690.38</b>
1.管理人报酬		3,788,529.10
2.托管费		631,421.55
3.销售服务费		-
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	6.1.4.7.17	-
7.税金及附加		-
8.其他费用	6.1.4.7.18	96,739.73
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>46,226,037.64</b>
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>46,226,037.64</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		<b>-</b>
<b>六、综合收益总额</b>		<b>46,226,037.64</b>

注：自 2023 年 4 月 27 日起，原华夏科技龙头两年定期开放混合型证券投资基金转型为华夏科技龙头两年持有期混合型证券投资基金，本报告期自 2023 年 4 月 27 日至 2023 年 6 月 30 日。

### 6.1.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：华夏科技龙头两年持有期混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 4 月 27 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 4 月 27 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、本期期初净资产（基金净值）	2,036,507,265.61	-	-629,180,271.15	1,407,326,994.46
二、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-43,656,787.96	-	59,542,582.23	15,885,794.27

(一)、综合收益总额	-	-	46,226,037.64	46,226,037.64
(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)	-43,656,787.96	-	13,316,544.59	-30,340,243.37
其中: 1.基金申购款	1,107,953.18	-	-337,741.11	770,212.07
2.基金赎回款	-44,764,741.14	-	13,654,285.70	-31,110,455.44
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	1,992,850,477.65	-	-569,637,688.92	1,423,212,788.73

注:自 2023 年 4 月 27 日起,原华夏科技龙头两年定期开放混合型证券投资基金转型为华夏科技龙头两年持有期混合型证券投资基金,本报告期自 2023 年 4 月 27 日至 2023 年 6 月 30 日。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1.1 至 6.1.4, 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

#### 6.1.4 报表附注

##### 6.1.4.1 基金基本情况

华夏科技龙头两年定期开放混合型证券投资基金(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[2020]1854 号《关于准予华夏科技龙头两年定期开放混合型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》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《华夏科技龙头两年定期开放混合型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。本基金为契约型定期开放式,存续期限为不定期。本基金于 2020 年 10 月 20 日至 2020 年 10 月 22 日募集 2,664,452,258.51 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(2020)验字第 60739337\_A66 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华夏科技龙头两年定期开放混合型证券投资基金基金合同》于 2020 年 10 月 26 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 2,664,785,236.30 份基金份额,其中认购资金利息折合 332,977.79 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,基金托管人为中国光大银行股份有限公司。根据华夏基金管理有限公司 2023 年 3 月 29 日发布的《华夏科技龙头两年定期开放混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效公告》,自 2023 年 4 月 27 日起,华夏科技龙头两年定期开放混合型证券投资基金

正式转型为华夏科技龙头两年持有期混合型证券投资基金。

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、存托凭证及其他经中国证监会注册或核准上市的股票)、港股通标的股票、债券(包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、衍生品（包括股指期货、国债期货、股票期权等）、资产支持证券、货币市场工具（含同业存单）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（但须符合中国证监会相关规定）。

本基金的投资组合比例为：本基金投资于股票资产占基金资产的比例为 60%-95%，其中港股通标的股票投资比例不超过股票资产的 50%，基金投资于科技龙头主题相关的股票资产占非现金基金资产的比例不低于 80%。每个交易日日终在扣除国债期货合约、股指期货合约和股票期权合约需缴纳的交易保证金后保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

#### 6.1.4.2 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 6.1.4.4 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。

#### 6.1.4.3 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。

#### 6.1.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 6.1.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本会计报表的实际编制期间为 2023 年 4 月 27 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日。

##### 6.1.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 6.1.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

##### 1、金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

##### (1) 债务工具

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

##### 以摊余成本计量：

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

##### 以公允价值计量且其变动计入当期损益：

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

##### (2) 权益工具

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

##### 2、金融负债的分类

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

##### 3、衍生金融工具

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

#### 6.1.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

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

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

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

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

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

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

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况。当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信

用减值的金融资产。当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额。

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

#### 6.1.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

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

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

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

#### 6.1.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

#### 6.1.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。对于曾经实施份额拆分或折算的基金，由于基金份额拆分或折算引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日或基金份额折算日根据拆分前或折算前的基金份额数及确定的拆分或折算比例计算认列。由于申购

和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。对于已开放转换业务的基金，上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 6.1.4.4.8 损益平准金

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

#### 6.1.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

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

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

#### 6.1.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

#### 6.1.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红

利或将现金红利按分红权益再投资日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。期末可供分配利润指期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

#### 6.1.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

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

#### 6.1.4.4.13 分部报告

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

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

本基金目前以一个经营分部运作。

#### 6.1.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

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

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

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

3、对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处

理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外),按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场交易的固定收益品种,按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

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

#### 6.1.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.1.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

##### 6.1.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

##### 6.1.4.5.3 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。

#### 6.1.4.6 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。

#### 6.1.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.1.4.7.1 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	136,957,554.38
等于：本金	136,944,939.31
加：应计利息	12,615.07
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	136,957,554.38

6.1.4.7.2 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	1,213,906,601.22	-	1,235,456,007.14	21,549,405.92	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	-	-	-	
	银行间市场	70,076,510.00	573,117.81	70,727,117.81	77,490.00
	合计	70,076,510.00	573,117.81	70,727,117.81	77,490.00
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	1,283,983,111.22	573,117.81	1,306,183,124.95	21,626,895.92	

6.1.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.1.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

6.1.4.7.4 买入返售金融资产

6.1.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.1.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

## 6.1.4.7.5 其他资产

无。

## 6.1.4.7.6 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	1,754,936.48
其中：交易所市场	1,754,461.48
银行间市场	475.00
应付利息	-
预提费用	94,219.55
合计	1,849,156.03

## 6.1.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 4 月 27 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	2,036,507,265.61	2,036,507,265.61
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期申购	1,107,953.18	1,107,953.18
本期赎回（以“-”号填列）	-44,764,741.14	-44,764,741.14
本期末	1,992,850,477.65	1,992,850,477.65

## 6.1.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-618,338,740.73	-10,841,530.42	-629,180,271.15
本期利润	-4,691,505.77	50,917,543.41	46,226,037.64
本期基金份额交易产生的变动数	13,672,748.91	-356,204.32	13,316,544.59
其中：基金申购款	-346,413.09	8,671.98	-337,741.11
基金赎回款	14,019,162.00	-364,876.30	13,654,285.70
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-609,357,497.59	39,719,808.67	-569,637,688.92

## 6.1.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 4 月 27 日至 2023 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	54,110.60
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	12,863.95
其他	1,533.51
合计	68,508.06

#### 6.1.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 4 月 27 日至 2023 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	396,622,979.44
减：卖出股票成本总额	400,047,611.07
减：交易费用	968,706.26
买卖股票差价收入	-4,393,337.89

#### 6.1.4.7.11 债券投资收益

##### 6.1.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2023年4月27日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	235,717.81
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-475.00
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	235,242.81

##### 6.1.4.7.11.2 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4月27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	-
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	-
减：应计利息总额	-

减：交易费用	475.00
买卖债券差价收入	-475.00

6.1.4.7.12 资产支持证券投资收益

无。

6.1.4.7.13 衍生工具收益

6.1.4.7.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.1.4.7.13.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.1.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年4月27日至2023年6月30日
股票投资产生的股利收益	3,914,771.63
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	3,914,771.63

6.1.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年4月27日至2023年6月30日
1.交易性金融资产	50,917,543.41
——股票投资	50,840,053.41
——债券投资	77,490.00
——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	50,917,543.41

6.1.4.7.16 其他收入

无。

6.1.4.7.17 信用减值损失

无。

6.1.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年4月27日至2023年6月30日
审计费用	12,465.70
信息披露费	21,370.05
证券出借违约金	-
银行间账户维护费	-
证券组合费	2,903.98
存托服务费	-
其他	60,000.00
合计	96,739.73

6.1.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.1.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无或有事项。

6.1.4.8.2 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。

6.1.4.9 关联方关系

6.1.4.9.1 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%）。

6.1.4.9.2 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
中国光大银行股份有限公司（“中国光大银行”）	基金托管人

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。

6.1.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.1.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.1.4.10.1.1 股票交易

无。

6.1.4.10.1.2 权证交易

无。

#### 6.1.4.10.1.3 债券交易

无。

#### 6.1.4.10.1.4 债券回购交易

无。

#### 6.1.4.10.2 关联方报酬

##### 6.1.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2023年4月27日至2023年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	3,788,529.10
其中：支付销售机构的客户维护费	1,490,552.00

注：①支付基金管理人的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

②基金管理人报酬计算公式为：日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×1.50%/当年天数。

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

##### 6.1.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2023年4月27日至2023年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	631,421.55

注：①支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

②基金托管费计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

#### 6.1.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

#### 6.1.4.10.4 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

##### 6.1.4.10.4.1 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。

##### 6.1.4.10.4.2 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。

6.1.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.1.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.1.4.10.5.2 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。

6.1.4.10.6 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 2023年4月27日至2023年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国光大银行活期存款	136,957,554.38	54,110.60

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国光大银行保管，按银行同业利率或约定利率计息。

6.1.4.10.7 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4月27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	688581	安杰思	新股发行	1,629	204,928.20
中信证券	688523	航天环宇	新股发行	4,717	103,113.62
中信证券	301323	新莱福	新股发行	2,277	88,939.62
中信证券	001324	长青科技	新股发行	1,131	21,353.28

6.1.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.1.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.1.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配事项。

6.1.4.12 期末（2023年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.1.4.12.1 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

6.1.4.12.1.1 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
688343	云天励飞	2023-03-28	6个月	新发流通受限	43.92	50.67	21,883	961,101.36	1,108,811.61	-
688249	晶合集成	2023-04-24	6个月	新发流通受限	19.86	18.06	7,405	147,063.30	133,734.30	-
688472	阿特斯	2023-06-02	6个月	新发流通受限	11.10	17.04	5,920	65,712.00	100,876.80	-
301358	湖南裕能	2023-02-01	6个月	新发流通受限	23.77	42.89	2,023	48,086.71	86,766.47	-
688469	中芯集成	2023-04-28	6个月	新发流通受限	5.69	5.41	13,800	78,522.00	74,658.00	-
301260	格力博	2023-01-20	6个月	新发流通受限	30.85	23.63	2,789	86,040.65	65,904.07	-
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	-
688531	日联科技	2023-03-24	6个月	新发流通受限	152.38	135.97	346	52,723.48	47,045.62	-
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	-
688146	中船特气	2023-04-13	6个月	新发流通受限	36.15	38.13	1,011	36,547.65	38,549.43	-
688484	南芯科技	2023-03-28	6个月	新发流通受限	39.99	36.71	1,008	40,309.92	37,003.68	-
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	-
001287	中电港	2023-03-30	6个月	新发流通受限	11.88	21.02	1,386	16,465.68	29,133.72	-
688576	西山科技	2023-05-30	6个月	新发流通	135.80	120.41	240	32,592.00	28,898.40	-

				受限						
301246	宏源药业	2023-03-10	6个月	新发流通受限	50.00	30.71	931	46,550.00	28,591.01	-
688352	硕中科技	2023-04-11	6个月	新发流通受限	12.10	12.07	2,361	28,568.10	28,497.27	-
688507	索辰科技	2023-04-10	6个月	新发流通受限	245.56	122.11	222	36,834.00	27,108.42	含证券送配
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	-
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	-
301303	真兰仪表	2023-02-13	6个月	新发流通受限	26.80	22.32	1,058	28,354.40	23,614.56	-
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	-
301322	绿通科技	2023-02-27	6个月	新发流通受限	131.11	53.24	391	34,219.71	20,816.84	含证券送配
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	新发流通受限	12.68	22.31	726	9,205.68	16,197.06	-
301439	泓淋电力	2023-03-10	6个月	新发流通受限	19.99	16.90	949	18,970.51	16,038.10	-
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	-
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	-
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	-
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	-
301345	涛涛车业	2023-03-10	6个月	新发流通受限	73.45	46.64	266	19,537.70	12,406.24	-
688523	航天环宇	2023-05-26	6个月	新发流通	21.86	23.85	472	10,317.92	11,257.20	-

				受限						
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	-
601065	江盐集团	2023-03-31	6个月	新发流通受限	10.36	11.84	875	9,065.00	10,360.00	-
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	-
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	-
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	-
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	-
301337	亚华	2023-05-16	6个月	新发	32.60	30.37	232	7,563.20	7,045.84	-

	电子		月	流通受限						
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。

#### 6.1.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

#### 6.1.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.1.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

##### 6.1.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 6.1.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

#### 6.1.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.1.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

##### 6.1.4.13.2 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。

##### 6.1.4.13.3 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“6.1.4.12 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。

#### 6.1.4.13.3.1 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。

#### 6.1.4.13.4 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。

##### 6.1.4.13.4.1 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。

##### 6.1.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	合计
银行存款	136,957,554.38	-	-	136,957,554.38
结算备付金	810,734.75	-	-	810,734.75
结算保证金	442,501.33	-	-	442,501.33
债券投资	70,727,117.81	-	-	70,727,117.81
资产支持证券	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-

应收直销申购款	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-

注：本表所示为本基金生息资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.1.4.13.4.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率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	
	利率下降 25 个基点	115,845.63	
	利率上升 25 个基点	-115,467.41	

#### 6.1.4.13.4.3 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。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。

##### 6.1.4.13.4.3.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
银行存款	-	-	-	-
交易性金融资产	-	188,217,570.22	-	188,217,570.22
衍生金融资产	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产合计	-	188,217,570.22	-	188,217,570.22
以外币计价的负债				
应付在途资金	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-
应付换汇款	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-
应付赎回费	-	-	-	-

负债合计	-	-	-	-
------	---	---	---	---

## 6.1.4.13.4.3.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率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	
	港币相对人民币升值 5%		9,410,878.51
	港币相对人民币贬值 5%		-9,410,878.51

## 6.1.4.13.4.4 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。

## 6.1.4.13.4.4.1 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	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	1,235,456,007.14	86.81
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	1,235,456,007.14	86.81

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。

## 6.1.4.13.4.5 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	
	-5%		-72,082,709.77
	+5%		72,082,709.77

## 6.1.4.14 公允价值

#### 6.1.4.14.1 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。

#### 6.1.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

##### 6.1.4.14.2.1 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	1,232,880,233.53
第二层次	70,727,117.81
第三层次	2,575,773.61
合计	1,306,183,124.95

##### 6.1.4.14.2.2 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。

##### 6.1.4.14.3 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。

##### 6.1.4.14.4 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。

##### 6.1.4.15 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。

## 6.2 华夏科技龙头两年定期开放混合型证券投资基金

### 6.2.1 资产负债表

会计主体：华夏科技龙头两年定期开放混合型证券投资基金

报告截止日：2023 年 4 月 26 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 4 月 26 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.2.4.7.1	64,381,211.99	78,882,637.75
结算备付金		3,410,811.84	9,420,785.30
存出保证金		584,839.74	819,352.62
交易性金融资产	6.2.4.7.2	1,311,310,116.44	1,393,559,356.86
其中：股票投资		1,311,310,116.44	1,393,559,356.86
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	6.2.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.2.4.7.4	-	-
应收清算款		36,957,267.09	74,342.30
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.2.4.7.5	-	-
资产总计		1,416,644,247.10	1,482,756,474.83
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023 年 4 月 26 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	6.2.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	8,111,385.36
应付赎回款		4,489,683.96	-
应付管理人报酬		1,663,976.04	1,884,164.49
应付托管费		277,329.35	314,027.41
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.2.4.7.6	2,886,263.29	2,790,094.54
负债合计		9,317,252.64	13,099,671.80
<b>净资产：</b>			

实收基金	6.2.4.7.7	2,036,507,265.61	2,069,385,144.24
未分配利润	6.2.4.7.8	-629,180,271.15	-599,728,341.21
净资产合计		1,407,326,994.46	1,469,656,803.03
负债和净资产总计		1,416,644,247.10	1,482,756,474.83

注：①报告截止日 2023 年 4 月 26 日，基金份额净值 0.6910 元，基金份额总额 2,036,507,265.61 份。

②自 2023 年 4 月 27 日起，原华夏科技龙头两年定期开放混合型证券投资基金转型为华夏科技龙头两年持有期混合型证券投资基金。本报告期自 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 4 月 26 日。

## 6.2.2 利润表

会计主体：华夏科技龙头两年定期开放混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 4 月 26 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 4 月 26 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>		-28,922,298.85	-603,297,379.17
1.利息收入		188,116.52	1,230,984.06
其中：存款利息收入	6.2.4.7.9	188,116.52	1,177,012.90
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		-	53,971.16
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-44,895,631.73	-211,480,331.70
其中：股票投资收益	6.2.4.7.10	-45,464,462.99	-218,908,738.15
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.2.4.7.11	-	-
资产支持证券投资收益	6.2.4.7.12	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.2.4.7.13	-	-
股利收益	6.2.4.7.14	568,831.26	7,428,406.45
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.2.4.7.15	15,784,647.50	-393,048,031.53
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.2.4.7.16	568.86	-
<b>减：二、营业总支出</b>		8,639,789.69	20,477,811.77
1.管理人报酬		7,327,491.43	17,439,800.66
2.托管费		1,221,248.60	2,906,633.43
3.销售服务费		-	-

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	6.2.4.7.17	-	-
7.税金及附加		-	-
8.其他费用	6.2.4.7.18	91,049.66	131,377.68
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-37,562,088.54</b>	<b>-623,775,190.94</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-37,562,088.54</b>	<b>-623,775,190.94</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		<b>-</b>	<b>-</b>
<b>六、综合收益总额</b>		<b>-37,562,088.54</b>	<b>-623,775,190.94</b>

注：自 2023 年 4 月 27 日起，原华夏科技龙头两年定期开放混合型证券投资基金转型为华夏科技龙头两年持有期混合型证券投资基金，本报告期自 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 4 月 26 日。

#### 6.2.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：华夏科技龙头两年定期开放混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 4 月 26 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 4 月 26 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）	2,069,385,144.24	-	-599,728,341.21	1,469,656,803.03
二、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-32,877,878.63	-	-29,451,929.94	-62,329,808.57
（一）、综合收益总额	-	-	-37,562,088.54	-37,562,088.54
（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）	-32,877,878.63	-	8,110,158.60	-24,767,720.03
其中：1.基金申购款	-	-	-	-
2.基金赎回款	-32,877,878.63	-	8,110,158.60	-24,767,720.03
（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)				
三、本期期末净资产(基金净值)	2,036,507,265.61	-	-629,180,271.15	1,407,326,994.46
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)	2,664,785,236.30	-	329,363,389.48	2,994,148,625.78
二、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-	-	-623,775,190.94	-623,775,190.94
(一)、综合收益总额	-	-	-623,775,190.94	-623,775,190.94
(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)	-	-	-	-
其中: 1.基金申购款	-	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-	-
(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)	-	-	-	-
三、本期期末净资产(基金净值)	2,664,785,236.30	-	-294,411,801.46	2,370,373,434.84

注:自 2023 年 4 月 27 日起,原华夏科技龙头两年定期开放混合型证券投资基金转型为华夏科技龙头两年持有期混合型证券投资基金。本报告期自 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 4 月 26 日。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.2.1 至 6.2.4, 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

## 6.2.4 报表附注

### 6.2.4.1 基金基本情况

华夏科技龙头两年定期开放混合型证券投资基金(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[2020]1854 号《关于准予华夏科技龙头两年定期开放混合型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》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《华夏科技龙头两年定期开放混合型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。本基金为契约型定期开放式，存续期限为不定期。本基金于 2020 年 10 月 20 日至 2020 年 10 月 22 日募集 2,664,452,258.51 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（2020）验字第 60739337\_A66 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华夏科技龙头两年定期开放混合型证券投资基金基金合同》于 2020 年 10 月 26 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 2,664,785,236.30 份基金份额，其中认购资金利息折合 332,977.79 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，基金托管人为中国光大银行股份有限公司。

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(包括中小板、创业板、存托凭证及其他经中国证监会注册或核准上市的股票)、港股通标的股票、债券(包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、衍生品(包括股指期货、国债期货、股票期权等)、资产支持证券、货币市场工具（含同业存单）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（但须符合中国证监会相关规定）。在封闭期内，本基金可根据法律法规的规定参与转融通证券出借业务。

#### 6.2.4.2 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 6.2.4.4 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。

#### 6.2.4.3 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。

#### 6.2.4.4 重要会计政策和会计估计

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。

#### 6.2.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.2.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

##### 6.2.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

##### 6.2.4.5.3 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。

#### 6.2.4.6 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。

#### 6.2.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.2.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 4 月 26 日
活期存款	64,381,211.99
等于：本金	64,341,714.06
加：应计利息	39,497.93
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	64,381,211.99

6.2.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 4 月 26 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	1,340,600,763.93	-	1,311,310,116.44	-29,290,647.49
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	1,340,600,763.93	-	1,311,310,116.44	-29,290,647.49

6.2.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.2.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

6.2.4.7.4 买入返售金融资产

6.2.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.2.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.2.4.7.5 其他资产

无。

6.2.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 4 月 26 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	0.24
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	2,815,879.25

其中：交易所市场	2,815,879.25
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	70,383.80
合计	2,886,263.29

#### 6.2.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年4月26日	
	基金份额	账面金额
基金合同生效日	2,069,385,144.24	2,069,385,144.24
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-32,877,878.63	-32,877,878.63
本期末	2,036,507,265.61	2,036,507,265.61

#### 6.2.4.7.8 未分配利润

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	-574,824,675.04	-24,903,666.17	-599,728,341.21
本期利润	-53,346,736.04	15,784,647.50	-37,562,088.54
本期基金份额交易产生的变动数	9,832,670.35	-1,722,511.75	8,110,158.60
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	9,832,670.35	-1,722,511.75	8,110,158.60
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-618,338,740.73	-10,841,530.42	-629,180,271.15

#### 6.2.4.7.9 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4月26日
	活期存款利息收入
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	37,928.91
其他	4,679.28
合计	188,116.52

#### 6.2.4.7.10 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4月26日

卖出股票成交总额	1,261,647,977.83
减：卖出股票成本总额	1,303,531,191.27
减：交易费用	3,581,249.55
买卖股票差价收入	-45,464,462.99

6.2.4.7.11 债券投资收益

6.2.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

无。

6.2.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

6.2.4.7.12 资产支持证券投资收益

无。

6.2.4.7.13 衍生工具收益

6.2.4.7.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.2.4.7.13.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.2.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年4月26日
股票投资产生的股利收益	568,831.26
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	568,831.26

6.2.4.7.15 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4月26日
1.交易性金融资产	15,784,647.50
——股票投资	15,784,647.50
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——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	15,784,647.50

#### 6.2.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年4月26日
基金赎回费收入	568.86
合计	568.86

#### 6.2.4.7.17 信用减值损失

无。

#### 6.2.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年4月26日
审计费用	22,246.48
信息披露费	38,137.32
证券出借违约金	-
银行间账户维护费	18,000.00
证券组合费	12,065.86
存托服务费	-
其他	600.00
合计	91,049.66

#### 6.2.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.2.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无或有事项。

##### 6.2.4.8.2 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。

##### 6.2.4.9 关联方关系

###### 6.2.4.9.1 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%）。

6.2.4.9.2 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
中国光大银行股份有限公司（“中国光大银行”）	基金托管人

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。

6.2.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.2.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.2.4.10.1.1 股票交易

无。

6.2.4.10.1.2 权证交易

无。

6.2.4.10.1.3 债券交易

无。

6.2.4.10.1.4 债券回购交易

无。

6.2.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

6.2.4.10.2 关联方报酬

6.2.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年4月 26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	7,327,491.43	17,439,800.66
其中：支付销售机构的客户维护费	2,881,058.12	6,868,128.96

注：①支付基金管理人的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

②基金管理人报酬计算公式为：日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×1.50%/当年天数。

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

6.2.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年4月26日	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	1,221,248.60	2,906,633.43

注：①支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

②基金托管费计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

6.2.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.2.4.10.4 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

6.2.4.10.4.1 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。

6.2.4.10.4.2 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。

6.2.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.2.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.2.4.10.5.2 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。

6.2.4.10.6 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4月26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
中国光大银行活期存款	64,381,211.99	145,508.33	95,023,311.44	1,106,902.54

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国光大银行保管，按银行同业利率或约定利率计息。

6.2.4.10.7 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4月26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	21,883	961,101.36
中信证券	688146	中船特气	新股发行	10,101	365,151.15
中信证券	001286	陕西能源	新股发行	37,667	361,603.20
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	4,299	200,677.32
中信证券	301439	泓淋电力	新股发行	9,486	189,625.14
中信证券	301293	三博脑科	新股发行	3,324	98,390.40
中信证券	601133	柏诚股份	新股发行	6,632	77,329.12
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	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	600938	中国海油	新股发行	120,005	1,296,054.00
中信证券	688223	晶科能源	新股发行	213,000	1,065,000.00
中信证券	688326	经纬恒润	新股发行	6,832	826,672.00
中信证券	301200	大族数控	新股发行	8,566	655,812.96
中信证券	688302	海创药业	新股发行	13,082	561,479.44
中信证券	301109	军信股份	新股发行	12,250	426,422.50
中信证券	301302	华如科技	新股发行	4,651	241,991.53
中信证券	688150	莱特光电	新股发行	5,626	124,053.30
中信证券	688290	景业智能	新股发行	3,040	103,025.60
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

#### 6.2.4.10.8 其他关联交易事项的说明

##### 6.2.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.2.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配事项。

#### 6.2.4.12 期末(2023 年 4 月 26 日)本基金持有的流通受限证券

6.2.4.12.1 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

6.2.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688343	云天励飞	2023-03-28	6个月	新发流通受限	43.92	54.37	21,883	961,101.36	1,189,778.71	-
688249	晶合集成	2023-04-24	6个月	新发流通受限	19.86	19.86	59,231	1,176,327.66	1,176,327.66	-
688362	甬矽电子	2022-11-09	6个月	新发流通受限	18.54	33.43	7,779	144,222.66	260,051.97	-
688249	晶合集成	2023-04-24	6个月	新发流通受限	19.86	19.86	7,405	147,063.30	147,063.30	-
301293	三博脑科	2023-04-25	6个月	新发流通受限	29.60	29.60	2,991	88,533.60	88,533.60	-
301267	华夏眼科	2022-10-26	6个月	新发流通	50.88	78.15	1,006	51,185.28	78,618.90	-

				受限						
301358	湖南裕能	2023-02-01	6个月	新发流通受限	23.77	34.44	2,023	48,086.71	69,672.12	-
301260	格力博	2023-01-20	6个月	新发流通受限	30.85	21.07	2,789	86,040.65	58,764.23	-
301165	锐捷网络	2022-11-14	6个月	新发流通受限	32.38	52.05	1,077	34,873.26	56,057.85	-
688531	日联科技	2023-03-24	6个月	新发流通受限	152.38	149.66	346	52,723.48	51,782.36	-
688146	中船特气	2023-04-13	6个月	新发流通受限	36.15	42.18	1,011	36,547.65	42,643.98	-
688507	索辰科技	2023-04-10	6个月	新发流通受限	245.56	247.65	150	36,834.00	37,147.50	-
688484	南芯科技	2023-03-28	6个月	新发流通受限	39.99	36.44	1,008	40,309.92	36,731.52	-

001286	陕西能源	2023-03-31	6个月	新发流通受限	9.60	9.21	3,767	36,163.20	34,694.07	-
301356	天振股份	2022-11-03	6个月	新发流通受限	63.00	49.89	614	38,682.00	30,632.46	-
301246	宏源药业	2023-03-10	6个月	新发流通受限	50.00	31.66	931	46,550.00	29,475.46	-
301322	绿通科技	2023-02-27	6个月	新发流通受限	131.11	112.05	261	34,219.71	29,245.05	-
688352	颀中科技	2023-04-11	6个月	新发流通受限	12.10	11.74	2,361	28,568.10	27,718.14	-
001287	中电港	2023-03-30	6个月	新发流通受限	11.88	18.90	1,386	16,465.68	26,195.40	-
301389	隆扬电子	2022-10-18	6个月	新发流通受限	22.50	18.33	1,269	28,552.50	23,260.77	-
301391	卡莱	2022-11-24	6个月	新发	96.00	91.24	247	23,712.00	22,536.28	-

	特		月	流 通 受 限						
301303	真 兰 仪 表	2023-02-13	6 个 月	新 发 流 通 受 限	26.80	20.55	1,058	28,354.40	21,741.90	-
301307	美 利 信	2023-04-14	6 个 月	新 发 流 通 受 限	32.34	27.46	687	22,217.58	18,865.02	-
301439	泓 淋 电 力	2023-03-10	6 个 月	新 发 流 通 受 限	19.99	16.16	949	18,970.51	15,335.84	-
301317	鑫 磊 股 份	2023-01-12	6 个 月	新 发 流 通 受 限	20.67	21.76	694	14,344.98	15,101.44	-
301335	天 元 宠 物	2022-11-11	6 个 月	新 发 流 通 受 限	49.98	34.40	420	20,991.60	14,448.00	-
301230	泓 博 医 药	2022-10-21	6 个 月	新 发 流 通 受 限	40.00	53.47	269	10,760.00	14,383.43	-
301277	新 天 地	2022-11-09	6 个 月	新 发 流 通	27.00	32.23	439	11,853.00	14,148.97	-

				受限						
301396	宏景科技	2022-11-04	6个月	新发流通受限	40.13	35.11	396	15,891.48	13,903.56	-
301377	鼎泰高科	2022-11-11	6个月	新发流通受限	22.88	17.33	770	17,617.60	13,344.10	-
301365	矩阵股份	2022-11-14	6个月	新发流通受限	34.72	23.92	516	17,915.52	12,342.72	-
301345	涛涛车业	2023-03-10	6个月	新发流通受限	73.45	44.37	266	19,537.70	11,802.42	-
301387	光大同创	2023-04-10	6个月	新发流通受限	58.32	37.93	307	17,904.24	11,644.51	-
301429	森泰股份	2023-04-10	6个月	新发流通受限	28.75	20.57	499	14,346.25	10,264.43	-
603135	中重科技	2023-03-29	6个月	新发流通受限	17.80	16.33	628	11,178.40	10,255.24	-

301293	三博脑科	2023-04-25	6个月	新发流通受限	29.60	29.60	333	9,856.80	9,856.80	-
688433	华曙高科	2023-04-07	6个月	新发流通受限	26.66	22.94	418	11,143.88	9,588.92	-
301141	中科磁业	2023-03-27	6个月	新发流通受限	41.20	35.50	262	10,794.40	9,301.00	-
301265	华新环保	2022-12-08	6个月	新发流通受限	13.28	11.32	819	10,876.32	9,271.08	-
301357	北方长龙	2023-04-11	6个月	新发流通受限	50.00	46.82	190	9,500.00	8,895.80	-
301360	荣旗科技	2023-04-17	6个月	新发流通受限	71.88	65.85	134	9,631.92	8,823.90	-
601065	江盐集团	2023-03-31	6个月	新发流通受限	10.36	9.75	875	9,065.00	8,531.25	-
601133	柏诚	2023-03-31	6个月	新发	11.66	12.51	664	7,742.24	8,306.64	-

	股份		月	流通受限						
301386	未来电器	2023-03-21	6个月	新发流通受限	29.99	21.63	378	11,336.22	8,176.14	-
688535	华海诚科	2023-03-28	6个月	新发流通受限	35.00	50.60	161	5,635.00	8,146.60	-
301203	国泰环保	2023-03-28	6个月	新发流通受限	46.13	34.14	225	10,379.25	7,681.50	-
301398	星源卓镁	2022-12-08	6个月	新发流通受限	34.40	29.06	255	8,772.00	7,410.30	-
301368	丰立智能	2022-12-07	6个月	新发流通受限	22.33	21.02	337	7,525.21	7,083.74	-
301388	欣灵电气	2022-10-26	6个月	新发流通受限	25.88	22.76	292	7,556.96	6,645.92	-
603125	常青科技	2023-03-30	6个月	新发流通	25.98	26.19	160	4,156.80	4,190.40	-

				受限						
001328	登康口腔	2023-03-29	6 个月	新发流通受限	20.68	24.67	145	2,998.60	3,577.15	-
001360	南矿集团	2023-03-31	6 个月	新发流通受限	15.38	16.01	177	2,722.26	2,833.77	-
001367	海森药业	2023-03-30	6 个月	新发流通受限	44.48	47.60	55	2,446.40	2,618.00	-

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。

#### 6.2.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

#### 6.2.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.2.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

##### 6.2.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 6.2.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

#### 6.2.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.2.4.13.1 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。

##### 6.2.4.13.2 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。

##### 6.2.4.13.3 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“6.2.4.12 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。

##### 6.2.4.13.3.1 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。

#### 6.2.4.13.4 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。

##### 6.2.4.13.4.1 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。

##### 6.2.4.13.4.2 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。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。

###### 6.2.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2023年4月26日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
银行存款	-	-	-	-
交易性金融资产	-	229,993,263.94	-	229,993,263.94
衍生金融资产	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-

应收利息	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产合计	-	229,993,263.94	-	229,993,263.94
以外币计价的负债				
应付在途资金	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-
应付换汇款	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-
应付赎回费	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
项目	上年度末 2022年12月31日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
银行存款	-	-	-	-
交易性金融资产	-	532,807,479.53	-	532,807,479.53
衍生金融资产	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产合计	-	532,807,479.53	-	532,807,479.53
以外币计价的负债				
应付在途资金	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-
应付换汇款	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-
应付赎回费	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-

## 6.2.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率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4月26日	上年度末 2022年12月31日
	港币相对人民币升值 5%	11,499,663.20	26,640,373.98
	港币相对人民币贬值 5%	-11,499,663.20	-26,640,373.98

## 6.2.4.13.4.3 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。

#### 6.2.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 4 月 26 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	1,311,310,116.44	93.18	1,393,559,356.86	94.82
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	1,311,310,116.44	93.18	1,393,559,356.86	94.82

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。

#### 6.2.4.13.4.3.2 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 4 月 26 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	-5%	-67,373,745.43	-90,942,719.29
	+5%	67,373,745.43	90,942,719.29

#### 6.2.4.14 公允价值

##### 6.2.4.14.1 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。

#### 6.2.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

##### 6.2.4.14.2.1 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 4 月 26 日
第一层次	1,307,317,601.32
第二层次	1,568,844.66
第三层次	2,423,670.46
合计	1,311,310,116.44

##### 6.2.4.14.2.2 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。

##### 6.2.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

截至 2023 年 4 月 26 日止，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

##### 6.2.4.14.4 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。

#### 6.2.5 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 华夏科技龙头两年持有期混合型证券投资基金

（报告期：2023年4月27日-2023年6月30日）

#### 7.1.1 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	1,235,456,007.14	85.53
	其中：股票	1,235,456,007.14	85.53
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	70,727,117.81	4.90
	其中：债券	70,727,117.81	4.90
	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	137,768,289.13	9.54
8	其他各项资产	442,501.33	0.03
9	合计	1,444,393,915.41	100.00

注：本基金本报告期末通过港股通机制投资香港股票的公允价值为188,217,570.22元，占基金资产净值比例为13.22%。

#### 7.1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

##### 7.1.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	406,260,478.06	28.55
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	35,447.47	0.00
E	建筑业	19,748,140.64	1.39
F	批发和零售业	29,133.72	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	535,268,354.32	37.61
J	金融业	16,196,047.28	1.14
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	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	22,566.57	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	69,654,486.00	4.89
S	综合	-	-

合计	1,047,238,436.92	73.58
----	------------------	-------

## 7.1.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
通讯服务	117,888,935.82	8.28
信息技术	70,328,634.40	4.94
保健	-	-
必需消费品	-	-
材料	-	-
房地产	-	-
非必需消费品	-	-
工业	-	-
公用事业	-	-
金融	-	-
能源	-	-
合计	188,217,570.22	13.22

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

## 7.1.3 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	00700	腾讯控股	385,600	117,888,935.82	8.28
2	002230	科大讯飞	1,588,300	107,940,868.00	7.58
3	688111	金山办公	143,325	67,680,931.50	4.76
4	300161	华中数控	1,202,300	64,347,096.00	4.52
5	300454	深信服	532,766	60,335,749.50	4.24
6	688012	中微公司	385,421	60,299,115.45	4.24
7	00268	金蝶国际	6,200,000	59,906,572.48	4.21
8	002920	德赛西威	321,410	50,078,892.10	3.52
9	002063	远光软件	4,213,921	36,576,834.28	2.57
10	688981	中芯国际	700,000	35,364,000.00	2.48
11	002371	北方华创	109,600	34,814,440.00	2.45
12	000719	中原传媒	2,966,700	34,710,390.00	2.44
13	301185	鸥玛软件	996,800	32,914,336.00	2.31
14	300996	普联软件	920,910	28,271,937.00	1.99
15	002153	石基信息	1,781,512	24,941,168.00	1.75
16	002409	雅克科技	335,300	24,436,664.00	1.72
17	603283	赛腾股份	544,760	24,241,820.00	1.70
18	600845	宝信软件	426,647	21,677,934.07	1.52
19	000032	深桑达 A	600,000	19,740,000.00	1.39
20	688082	盛美上海	159,415	17,599,416.00	1.24
21	300033	同花顺	92,401	16,196,047.28	1.14

22	002997	瑞鹤模具	510,000	15,162,300.00	1.07
23	688256	寒武纪	80,126	15,063,688.00	1.06
24	300604	长川科技	313,400	14,883,366.00	1.05
25	000988	华工科技	390,000	14,823,900.00	1.04
26	600570	恒生电子	319,482	14,149,857.78	0.99
27	600602	云赛智联	938,468	14,133,328.08	0.99
28	300559	佳发教育	842,765	13,905,622.50	0.98
29	601900	南方传媒	676,300	13,870,913.00	0.97
30	002558	巨人网络	750,000	13,447,500.00	0.94
31	002410	广联达	410,447	13,335,423.03	0.94
32	002987	京北方	601,580	13,186,633.60	0.93
33	688558	国盛智科	367,299	13,134,612.24	0.92
34	688023	安恒信息	74,482	13,012,750.22	0.91
35	601100	恒立液压	200,000	12,866,000.00	0.90
36	688031	星环科技	95,047	12,664,062.28	0.89
37	300782	卓胜微	114,320	11,046,741.60	0.78
38	00763	中兴通讯	360,000	10,422,061.92	0.73
39	601928	凤凰传媒	910,000	10,374,000.00	0.73
40	688083	中望软件	70,840	10,264,007.60	0.72
41	601098	中南传媒	857,600	9,948,160.00	0.70
42	300624	万兴科技	80,000	9,372,000.00	0.66
43	300750	宁德时代	38,459	8,799,034.61	0.62
44	688258	卓易信息	91,500	6,105,795.00	0.43
45	300212	易华录	150,000	4,984,500.00	0.35
46	603358	华达科技	150,600	2,870,436.00	0.20
47	688343	云天励飞	21,883	1,108,811.61	0.08
48	601019	山东出版	81,900	751,023.00	0.05
49	301360	荣旗科技	1,340	138,170.08	0.01
50	688249	晶合集成	7,405	133,734.30	0.01
51	688472	阿特斯	5,920	100,876.80	0.01
52	301358	湖南裕能	2,023	86,766.47	0.01
53	688676	金盘科技	2,509	75,997.61	0.01
54	688469	中芯集成	13,800	74,658.00	0.01
55	301260	格力博	2,789	65,904.07	0.00
56	301262	海看股份	2,117	57,189.75	0.00
57	300508	维宏股份	1,520	56,878.40	0.00
58	688361	中科飞测	831	53,740.77	0.00
59	688531	日联科技	346	47,045.62	0.00
60	301325	曼恩斯特	364	39,293.80	0.00
61	688146	中船特气	1,011	38,549.43	0.00
62	001311	多利科技	649	37,272.07	0.00
63	688484	南芯科技	1,008	37,003.68	0.00
64	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.00

65	001287	中电港	1,386	29,133.72	0.00
66	688576	西山科技	240	28,898.40	0.00
67	301246	宏源药业	931	28,591.01	0.00
68	688352	颀中科技	2,361	28,497.27	0.00
69	688507	索辰科技	222	27,108.42	0.00
70	301310	鑫宏业	409	26,760.87	0.00
71	301293	三博脑科	333	23,782.86	0.00
72	301303	真兰仪表	1,058	23,614.56	0.00
73	688552	航天南湖	956	22,466.00	0.00
74	688570	天玛智控	884	22,391.72	0.00
75	301307	美利信	687	21,887.82	0.00
76	301322	绿通科技	391	20,816.84	0.00
77	688458	美芯晟	221	20,057.96	0.00
78	688581	安杰思	163	19,238.89	0.00
79	301317	鑫磊股份	694	18,161.98	0.00
80	301383	天键股份	493	17,609.96	0.00
81	688562	航天软件	726	16,197.06	0.00
82	301439	泓淋电力	949	16,038.10	0.00
83	688623	双元科技	178	15,448.62	0.00
84	301332	德尔玛	1,122	15,405.06	0.00
85	301399	英特科技	293	15,110.01	0.00
86	301305	朗坤环境	753	14,826.57	0.00
87	301387	光大同创	307	13,925.52	0.00
88	688512	慧智微	721	13,814.36	0.00
89	301382	蜂助手	408	13,398.72	0.00
90	688433	华曙高科	418	13,167.00	0.00
91	301345	涛涛车业	266	12,406.24	0.00
92	688523	航天环宇	472	11,257.20	0.00
93	603135	中重科技	628	11,234.92	0.00
94	301141	中科磁业	262	11,184.78	0.00
95	301225	恒勃股份	333	11,075.58	0.00
96	301429	森泰股份	499	10,488.98	0.00
97	601065	江盐集团	875	10,360.00	0.00
98	688479	友车科技	332	9,790.68	0.00
99	301232	飞沃科技	165	9,639.30	0.00
100	301355	南王科技	563	9,430.25	0.00
101	301357	北方长龙	190	9,194.10	0.00
102	301386	未来电器	378	8,992.62	0.00
103	301323	新莱福	228	8,974.08	0.00
104	688535	华海诚科	161	8,248.03	0.00
105	601133	柏诚股份	664	8,140.64	0.00
106	301203	国泰环保	225	7,740.00	0.00
107	301337	亚华电子	232	7,045.84	0.00

108	301428	世纪恒通	229	7,007.40	0.00
109	001380	华纬科技	170	5,232.60	0.00
110	603125	常青科技	160	3,924.80	0.00
111	603507	振江股份	108	3,916.08	0.00
112	001328	登康口腔	145	3,696.05	0.00
113	001282	三联锻造	105	3,468.15	0.00
114	001360	南矿集团	177	2,631.99	0.00
115	001324	长青科技	114	2,234.40	0.00
116	001367	海森药业	55	2,171.40	0.00
117	603172	万丰股份	122	1,967.86	0.00

注：所用证券代码采用当地市场代码。

#### 7.1.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 7.1.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	603000	人民网	29,568,668.49	2.08
2	002153	石基信息	29,477,525.18	2.07
3	300308	中际旭创	25,413,016.55	1.79
4	000719	中原传媒	21,189,042.99	1.49
5	002558	巨人网络	15,527,035.50	1.09
6	601900	南方传媒	14,017,492.00	0.98
7	601928	凤凰传媒	13,801,060.00	0.97
8	601098	中南传媒	13,726,923.76	0.96
9	601100	恒立液压	13,291,015.16	0.93
10	300559	佳发教育	13,185,316.00	0.93
11	000977	浪潮信息	12,964,670.00	0.91
12	002230	科大讯飞	11,826,815.48	0.83
13	00763	中兴通讯	10,441,604.15	0.73
14	301185	鸥玛软件	8,508,902.00	0.60
15	300394	天孚通信	7,637,809.80	0.54
16	603888	新华网	7,181,746.00	0.50
17	688258	卓易信息	6,762,732.24	0.48
18	688111	金山办公	6,158,810.67	0.43
19	300454	深信服	5,898,882.00	0.41
20	601019	山东出版	1,037,770.00	0.07

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

##### 7.1.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产
----	------	------	----------	---------

				净值比例 (%)
1	002410	广联达	42,499,158.80	2.99
2	002415	海康威视	35,326,995.94	2.48
3	603000	人民网	34,938,498.69	2.45
4	300308	中际旭创	32,833,631.00	2.31
5	301165	锐捷网络	28,686,697.29	2.02
6	00268	金蝶国际	27,225,590.75	1.91
7	600602	云赛智联	26,891,420.00	1.89
8	600570	恒生电子	24,420,214.70	1.72
9	00700	腾讯控股	17,237,078.94	1.21
10	605398	新炬网络	14,508,360.60	1.02
11	300559	佳发教育	13,727,834.68	0.96
12	600584	长电科技	13,563,872.02	0.95
13	000977	浪潮信息	12,514,979.00	0.88
14	300474	景嘉微	12,411,872.19	0.87
15	600633	浙数文化	9,562,964.61	0.67
16	300454	深信服	7,875,219.00	0.55
17	688031	星环科技	6,774,061.01	0.48
18	300394	天孚通信	6,616,026.68	0.46
19	002903	宇环数控	6,572,412.00	0.46
20	603888	新华网	6,260,041.00	0.44

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。

#### 7.1.4.3 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	273,353,448.36
卖出股票收入（成交）总额	396,622,979.44

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。

#### 7.1.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	70,727,117.81	4.97
	其中：政策性金融债	70,727,117.81	4.97
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-

8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	70,727,117.81	4.97

7.1.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	230401	23 农发 01	700,000	70,727,117.81	4.97
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

7.1.7 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。

7.1.8 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。

7.1.9 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。

7.1.10 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。

7.1.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.1.11.1 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。

7.1.11.2 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。

7.1.12 投资组合报告附注

7.1.12.1 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。

7.1.12.2 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。

7.1.12.3 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	442,501.33

2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	442,501.33

#### 7.1.12.4 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。

#### 7.1.12.5 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。

#### 7.1.12.6 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。

### 7.2 华夏科技龙头两年定期开放混合型证券投资基金

(报告期: 2023年1月1日-2023年4月26日)

#### 7.2.1 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	1,311,310,116.44	92.56
	其中: 股票	1,311,310,116.44	92.56
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	67,792,023.83	4.79
8	其他各项资产	37,542,106.83	2.65
9	合计	1,416,644,247.10	100.00

注: 本基金本报告期末通过港股通机制投资香港股票的公允价值为229,993,263.94元, 占基金资

产净值比例为16.34%。

## 7.2.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	465,180,192.09	33.05
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	34,694.07	0.00
E	建筑业	18,176,306.64	1.29
F	批发和零售业	26,195.40	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	560,972,419.43	39.86
J	金融业	16,162,782.92	1.15
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	26,726.15	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	7,681.50	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	177,009.30	0.01
R	文化、体育和娱乐业	20,552,845.00	1.46
S	综合	-	-
	合计	1,081,316,852.50	76.83

### 7.2.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
通讯服务	135,630,061.75	9.64
信息技术	94,363,202.19	6.71
保健	-	-
必需消费品	-	-
材料	-	-
房地产	-	-
非必需消费品	-	-
工业	-	-
公用事业	-	-
金融	-	-
能源	-	-
合计	229,993,263.94	16.34

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

## 7.2.3 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	00700	腾讯控股	441,600	135,630,061.75	9.64
2	00268	金蝶国际	8,856,000	94,363,202.19	6.71
3	002230	科大讯飞	1,416,400	80,706,472.00	5.73
4	688012	中微公司	385,421	67,641,385.50	4.81
5	300454	深信服	544,166	65,169,320.16	4.63
6	002410	广联达	1,111,148	63,313,213.04	4.50
7	688111	金山办公	130,325	56,054,085.75	3.98
8	300161	华中数控	1,202,300	44,845,790.00	3.19
9	600570	恒生电子	920,282	41,964,859.20	2.98
10	688981	中芯国际	700,000	40,712,000.00	2.89
11	002063	远光软件	4,773,921	39,384,848.25	2.80
12	002415	海康威视	998,643	37,049,655.30	2.63
13	002371	北方华创	109,600	36,714,904.00	2.61
14	002920	德赛西威	321,410	32,668,112.40	2.32
15	300996	普联软件	657,793	28,291,676.93	2.01
16	301165	锐捷网络	484,766	26,949,166.25	1.91
17	600602	云赛智联	2,672,068	25,919,059.60	1.84
18	603283	赛腾股份	544,760	24,230,924.80	1.72
19	002409	雅克科技	335,300	20,848,954.00	1.48
20	000719	中原传媒	1,503,500	20,552,845.00	1.46
21	688256	寒武纪	80,126	19,069,988.00	1.36
22	600845	宝信软件	355,539	19,064,001.18	1.35
23	000032	深桑达 A	600,000	18,168,000.00	1.29
24	688082	盛美上海	159,415	17,594,633.55	1.25
25	688031	星环科技	150,000	16,773,000.00	1.19
26	301185	鸥玛软件	664,800	16,300,896.00	1.16
27	300033	同花顺	92,401	16,162,782.92	1.15
28	300474	景嘉微	150,000	14,982,000.00	1.06
29	688023	安恒信息	74,482	14,903,848.20	1.06
30	300604	长川科技	313,400	14,573,100.00	1.04
31	600584	长电科技	500,000	14,170,000.00	1.01
32	002987	京北方	429,700	14,137,130.00	1.00
33	000988	华工科技	390,000	13,435,500.00	0.95
34	002997	瑞鹄模具	510,000	12,148,200.00	0.86
35	300559	佳发教育	729,965	11,847,331.95	0.84
36	688558	国盛智科	367,299	11,632,359.33	0.83
37	300782	卓胜微	114,320	11,448,004.80	0.81
38	605398	新炬网络	353,700	11,106,180.00	0.79

39	600633	浙数文化	728,700	10,835,769.00	0.77
40	300624	万兴科技	80,000	10,318,400.00	0.73
41	688083	中望软件	50,600	9,361,000.00	0.67
42	300750	宁德时代	38,459	8,634,045.50	0.61
43	002903	宇环数控	250,000	5,887,500.00	0.42
44	300212	易华录	150,000	5,164,500.00	0.37
45	603358	华达科技	150,600	3,144,528.00	0.22
46	002594	比亚迪	12,143	3,047,893.00	0.22
47	688249	晶合集成	74,041	1,470,454.26	0.10
48	688343	云天励飞	21,883	1,189,778.71	0.08
49	688362	甬矽电子	7,779	260,051.97	0.02
50	301307	美利信	6,865	195,061.58	0.01
51	301293	三博脑科	3,324	98,390.40	0.01
52	301360	荣旗科技	1,340	91,109.28	0.01
53	688676	金盘科技	2,509	89,997.83	0.01
54	301267	华夏眼科	1,006	78,618.90	0.01
55	301358	湖南裕能	2,023	69,672.12	0.00
56	301260	格力博	2,789	58,764.23	0.00
57	688531	日联科技	346	51,782.36	0.00
58	300508	维宏股份	1,520	46,010.40	0.00
59	688146	中船特气	1,011	42,643.98	0.00
60	001311	多利科技	499	38,926.99	0.00
61	688507	索辰科技	150	37,147.50	0.00
62	688484	南芯科技	1,008	36,731.52	0.00
63	001286	陕西能源	3,767	34,694.07	0.00
64	301356	天振股份	614	30,632.46	0.00
65	301246	宏源药业	931	29,475.46	0.00
66	301322	绿通科技	261	29,245.05	0.00
67	688352	颀中科技	2,361	27,718.14	0.00
68	001287	中电港	1,386	26,195.40	0.00
69	301389	隆扬电子	1,269	23,260.77	0.00
70	301391	卡莱特	247	22,536.28	0.00
71	301303	真兰仪表	1,058	21,741.90	0.00
72	301439	泓淋电力	949	15,335.84	0.00
73	301223	中荣股份	815	15,240.50	0.00
74	301317	鑫磊股份	694	15,101.44	0.00
75	301335	天元宠物	420	14,448.00	0.00
76	301230	泓博医药	269	14,383.43	0.00
77	301277	新天地	439	14,148.97	0.00
78	301396	宏景科技	396	13,903.56	0.00
79	301377	鼎泰高科	770	13,344.10	0.00
80	301365	矩阵股份	516	12,342.72	0.00
81	301345	涛涛车业	266	11,802.42	0.00

82	301387	光大同创	307	11,644.51	0.00
83	301429	森泰股份	499	10,264.43	0.00
84	603135	中重科技	628	10,255.24	0.00
85	688433	华曙高科	418	9,588.92	0.00
86	301141	中科磁业	262	9,301.00	0.00
87	301265	华新环保	819	9,271.08	0.00
88	301357	北方长龙	190	8,895.80	0.00
89	601065	江盐集团	875	8,531.25	0.00
90	601133	柏诚股份	664	8,306.64	0.00
91	301386	未来电器	378	8,176.14	0.00
92	688535	华海诚科	161	8,146.60	0.00
93	301203	国泰环保	225	7,681.50	0.00
94	301398	星源卓镁	255	7,410.30	0.00
95	301368	丰立智能	337	7,083.74	0.00
96	301388	欣灵电气	292	6,645.92	0.00
97	603125	常青科技	160	4,190.40	0.00
98	603507	振江股份	108	3,873.96	0.00
99	001328	登康口腔	145	3,577.15	0.00
100	001360	南矿集团	177	2,833.77	0.00
101	001367	海森药业	55	2,618.00	0.00

注：所用证券代码采用当地市场代码。

## 7.2.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.2.4.1 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	002415	海康威视	125,101,160.20	8.51
2	688012	中微公司	69,051,112.25	4.70
3	02333	长城汽车	46,122,552.93	3.14
3	601633	长城汽车	14,248,619.02	0.97
4	002230	科大讯飞	50,619,368.98	3.44
5	002063	远光软件	45,430,696.90	3.09
6	300033	同花顺	45,372,827.57	3.09
7	300161	华中数控	43,227,085.42	2.94
8	688981	中芯国际	41,647,067.38	2.83
9	002371	北方华创	36,775,327.00	2.50
10	01797	东方甄选	33,614,599.20	2.29
11	300491	通合科技	32,476,346.20	2.21
12	300782	卓胜微	27,539,237.47	1.87
13	603283	赛腾股份	24,362,965.60	1.66
14	688023	安恒信息	23,992,002.52	1.63

15	300454	深信服	22,722,364.65	1.55
16	002409	雅克科技	22,263,897.00	1.51
17	301165	锐捷网络	22,062,886.35	1.50
18	300661	圣邦股份	20,106,514.24	1.37
19	600584	长电科技	18,898,328.00	1.29
20	002153	石基信息	18,239,826.60	1.24

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。

#### 7.2.4.2 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	01024	快手-W	100,296,209.86	6.82
2	03690	美团-W	99,538,060.00	6.77
3	002415	海康威视	98,690,022.57	6.72
4	300750	宁德时代	75,427,259.50	5.13
5	688111	金山办公	62,213,920.90	4.23
6	002436	兴森科技	57,786,212.80	3.93
7	002410	广联达	54,515,355.70	3.71
8	688008	澜起科技	52,418,638.37	3.57
9	02333	长城汽车	32,864,768.32	2.24
9	601633	长城汽车	11,568,451.00	0.79
10	300661	圣邦股份	42,024,950.51	2.86
11	300033	同花顺	39,403,396.00	2.68
12	300782	卓胜微	36,781,655.45	2.50
13	688123	聚辰股份	33,986,483.91	2.31
14	300767	震安科技	30,754,280.46	2.09
15	300491	通合科技	29,609,669.00	2.01
16	002594	比亚迪	29,150,704.00	1.98
17	01797	东方甄选	27,233,747.14	1.85
18	002920	德赛西威	25,979,545.11	1.77
19	603908	牧高笛	23,760,222.93	1.62
20	002153	石基信息	22,048,634.39	1.50

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。

#### 7.2.4.3 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	1,205,497,303.35
卖出股票收入（成交）总额	1,261,647,977.83

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。

7.2.5 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。

7.2.6 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。

7.2.7 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。

7.2.8 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。

7.2.9 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。

7.2.10 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。

7.2.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.2.11.1 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。

7.2.11.2 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。

7.2.12 投资组合报告附注

7.2.12.1 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。

7.2.12.2 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	584,839.74
2	应收清算款	36,957,267.09
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	37,542,106.83

7.2.12.3 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。

7.2.12.4 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。

7.2.12.5 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 华夏科技龙头两年持有期混合型证券投资基金

(报告期: 2023年4月27日-2023年6月30日)

8.1.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位: 份

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
17,453	114,183.84	296,477.69	0.01%	1,992,553,999.96	99.99%

8.1.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	571,533.28	0.03%

8.1.3 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	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

8.2 华夏科技龙头两年定期开放混合型证券投资基金

(报告期: 2023年1月1日-2023年4月26日)

8.2.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位: 份

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

17,884	113,873.14	296,477.69	0.01%	2,036,210,787.92	99.99%
--------	------------	------------	-------	------------------	--------

### 8.2.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	571,533.28	0.03%

### 8.2.3 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	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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

## §9 开放式基金份额变动

### 9.1 华夏科技龙头两年持有期混合型证券投资基金

单位：份

基金合同生效日（2023 年 4 月 27 日）基金份额总额	2,036,507,265.61
本报告期基金总申购份额	1,107,953.18
减：本报告期基金总赎回份额	44,764,741.14
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,992,850,477.65

注：自 2023 年 4 月 27 日起，“华夏科技龙头两年定期开放混合型证券投资基金”正式转型为“华夏科技龙头两年持有期混合型证券投资基金”。

### 9.2 华夏科技龙头两年定期开放混合型证券投资基金

单位：份

基金合同生效日（2020 年 10 月 26 日）基金份额总额	2,664,785,236.30
本报告期期初基金份额总额	2,069,385,144.24
本报告期基金总申购份额	-
减：本报告期基金总赎回份额	32,877,878.63
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	2,036,507,265.61

注：自 2023 年 4 月 27 日起，“华夏科技龙头两年定期开放混合型证券投资基金”正式转型为“华夏科技龙头两年持有期混合型证券投资基金”。

## §10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

华夏科技龙头两年定期开放混合型证券投资基金基金份额持有人大会的公告于 2023 年 2 月 20 日公告以通讯方式召开基金份额持有人大会，审议《关于华夏科技龙头两年定期开放混合型证券投资基金转型为华夏科技龙头两年持有期混合型证券投资基金有关事项的议案》，会议议案于 2023 年 3 月 28 日获得通过，大会决议自同日起生效。自 2023 年 4 月 27 日，“华夏科技龙头两年定期开放混合型证券投资基金”正式转型为“华夏科技龙头两年持有期混合型证券投资基金”。

### 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

根据《华夏科技龙头两年定期开放混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效公告》，自 2023 年 4 月 27 日起，“华夏科技龙头两年定期开放混合型证券投资基金”正式转型为“华夏科技龙头两年持有期混合型证券投资基金”。根据修订后的基金合同，本基金调整股票投资策略，并在“股指期货投资策略”、“股票期权投资策略”、“国债期货投资策略”部分，明确基金投资股指期货、国债期货、股票期权以套期保值为主要目的。

### 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

报告期内，本基金托管人及其高级管理人员在开展基金托管业务过程中无受稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 华夏科技龙头两年持有期混合型证券投资基金

##### 10.7.1.1 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	股票交易	应支付该券商的佣金	备注
------	-----	------	-----------	----

	元数量	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	
东兴证券	1	238,377,547.93	35.89%	176,123.86	35.98%	-
财通证券	1	177,965,856.46	26.79%	132,121.62	26.99%	-
华创证券	1	164,814,760.26	24.81%	120,524.19	24.62%	-
东方财富证券	1	83,081,652.76	12.51%	60,758.70	12.41%	-

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本基金合同于 2023 年 4 月 27 日生效，除本表列示外，本基金还选择了东海证券、广发证券、华宝证券、华林证券、上海证券、申万宏源证券、世纪证券、银河证券、招商证券、中国银河证券、中金公司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。

#### 10.7.1.2 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
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-	-	-

东方财富证券	-	-	-	-	-	-	-
--------	---	---	---	---	---	---	---

10.7.2 华夏科技龙头两年定期开放混合型证券投资基金

10.7.2.1 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	
财通证券	1	645,485,078.17	26.28%	482,148.70	26.38%	-
开源证券	2	606,225,955.65	24.68%	450,819.35	24.67%	-
长城证券	1	545,722,377.23	22.22%	399,083.44	21.84%	-
华金证券	1	258,462,214.23	10.52%	193,638.57	10.60%	-
东兴证券	1	221,507,351.94	9.02%	171,045.25	9.36%	-
东方财富证券	1	178,882,497.72	7.28%	130,814.66	7.16%	-

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，本基金还选择了东海证券、广发证券、华宝证券、华林证券、上海证券、申万宏源证券、世纪证券、银河证券、招商证券、中国银河证券、中金公司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。

10.7.2.2 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
财通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-	-	-

#### 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以通讯方式召开华夏科技龙头两年定期开放混合型证券投资基金基金份额持有人大会的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-02-20
4	华夏基金管理有限公司关于以通讯方式召开华夏科技龙头两年定期开放混合型证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-02-21
5	华夏基金管理有限公司关于以通讯方式召开华夏科技龙头两年定期开放混合型证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-02-22
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	2023-02-24
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	2023-03-11
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	2023-03-23

9	华夏科技龙头两年定期开放混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-03-29
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	2023-03-30
11	华夏科技龙头两年定期开放混合型证券投资基金转型提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-04-11
12	华夏科技龙头两年持有期混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换、定期定额申购业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-04-24
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	2023-05-11
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	2023-05-13
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	2023-05-27
16	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-05-31

## §11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 华夏科技龙头两年持有期混合型证券投资基金

#### 11.1.1 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。

### 11.2 华夏科技龙头两年定期开放混合型证券投资基金

#### 11.2.1 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、《华夏科技龙头两年持有期混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《华夏科技龙头两年持有期混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、《华夏科技龙头两年定期开放混合型证券投资基金基金合同》；
- 5、《华夏科技龙头两年定期开放混合型证券投资基金托管协议》；

6、法律意见书;

7、基金管理人业务资格批件、营业执照;

8、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。

二〇二三年八月三十日