

華夏回報證券投資基金

2022 年年度報告

2022 年 12 月 31 日

基金管理人：華夏基金管理有限公司

基金託管人：中國銀行股份有限公司

送出日期：二〇二三年三月三十日

華夏回報證券投資基金（“**本基金**”）

2022 年年度報告

向香港投資者提供的資料

本基金是根據香港《證券及期貨條例》（「**證券及期貨條例**」）第 104 條在香港獲得證券及期貨事務監察委員會（「**證監會**」）認可。證監會認可不代表對本基金的推薦或認許，亦不代表其對本基金的商業。此並不意指本基金適合所有投資者，亦並非認許本基金適合任何特定投資者或利弊或其表現作出保證投資者類別。

本基金只有 H 類別份額可供香港投資者認購。

補充披露部分只編備以供在香港派發。補充披露部分載有本基金投資組合的額外詳情，其必須連同本基金的 2022 年年度報告一併閱覽。在年度報告中所提及的基金，除華夏回報證券投資基金和華夏興華混合型證券投資基金外，其他基金在香港未獲證監會認可及並非供香港居民投資。

華夏基金（香港）有限公司

香港代表

2023 年 3 月 30 日

§1 重要提示及目錄

1.1 重要提示

基金管理人的董事會、董事保證本報告所載資料不存在虛假記載、誤導性陳述或重大遺漏，並對其內容的真實性、準確性和完整性承擔個別及連帶的法律責任。本年度報告已經三分之二以上獨立董事簽字同意，並由董事長簽發。

基金託管人中國銀行股份有限公司根據本基金合同規定，於 2023 年 3 月 28 日覆核了本報告中的財務指標、淨值表現、利潤分配情況、財務會計報告、投資組合報告等內容，保證覆核內容不存在虛假記載、誤導性陳述或者重大遺漏。

基金管理人承諾以誠實信用、勤勉盡責的原則管理和運用基金資產，但不保證基金一定盈利。

基金的過往業績並不代表其未來表現。投資有風險，投資者在作出投資決策前應仔細閱讀本基金的招募說明書及其更新。

本報告中的財務資料經審計，安永華明會計師事務所（特殊普通合夥）為本基金出具了無保留意見的審計報告，請投資者注意閱讀。

本報告期自 2022 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目錄

§1 重要提示及目錄.....	2
§2 基金簡介.....	4
§3 主要財務指標、基金淨值表現及利潤分配情況.....	5
3.1 主要會計資料和財務指標.....	5
3.2 基金淨值表現.....	5
3.3 過去三年基金的利潤分配情況.....	7
§4 管理人報告.....	7
§5 託管人報告.....	14
§6 審計報告.....	15
§7 年度財務報表.....	17
7.1 資產負債表.....	17
7.2 利潤表.....	18
7.3 淨資產（基金淨值）變動表.....	19
7.4 報表附注.....	20
§8 投資組合報告.....	53
8.1 期末基金資產組合情況.....	53
8.3 期末按公允價值佔基金資產淨值比例大小排序的所有股票投資明細.....	54
8.4 報告期內股票投資組合的重大變動.....	57
8.5 期末按債券品種分類的債券投資組合.....	58
8.6 期末按公允價值佔基金資產淨值比例大小排序的前五名債券投資明細.....	59
8.7 期末按公允價值佔基金資產淨值比例大小排序的所有資產支持證券投資明細.....	59
8.8 報告期末按公允價值佔基金資產淨值比例大小排序的前五名貴金屬投資明細.....	59
8.9 期末按公允價值佔基金資產淨值比例大小排序的前五名權證投資明細.....	59
8.10 本基金投資股指期貨的投資政策.....	59
8.11 報告期末本基金投資的國債期貨交易情況說明.....	59
8.12 投資組合報告附注.....	59
§9 基金份額持有人信息.....	60
9.1 期末基金份額持有人戶數及持有人結構.....	60
9.2 期末基金管理人的從業人員持有本基金的情況.....	60
9.3 期末基金管理人的從業人員持有本開放式基金份額總量區間的情況.....	60
§10 開放式基金份額變動.....	61
§11 重大事件披露.....	61
§12 影響投資者決策的其他重要信息.....	65
§13 備查文件目錄.....	65
§14 補充披露.....	65

§2 基金簡介

2.1 基金基本情況

基金名稱	華夏回報證券投資基金	
基金簡稱	華夏回報混合	
基金主代碼	002001	
交易代碼	002001(前端)	002002(後端)
基金運作方式	契約型開放式	
基金合同生效日	2003 年 9 月 5 日	
基金管理人	華夏基金管理有限公司	
基金託管人	中國銀行股份有限公司	
報告期末基金份額總額	9,103,914,367.54 份	
基金合同存續期	不定期	

注：投資者通過中國內地的銷售機構申購基金份額時僅可申購 A 類基金份額（002001（前端）、002002（後端）），投資者通過香港的銷售機構申購基金份額時僅可申購 H 類基金份額（960002）。

2.2 基金產品說明

投資目標	儘量避免基金資產損失，追求每年較高的絕對回報。
投資策略	主要投資策略包括資產配置策略、股票投資策略、債券投資策略等。在股票投資策略上，本基金股票投資部分主要採取價值型投資策略。
業績比較基準	本基金業績比較基準為絕對回報標準，為同期一年期定期存款利率。
風險收益特徵	本基金在證券投資基金中屬於中等風險的品種，其長期平均的預期收益和風險高於債券基金，低於股票基金。

2.3 基金管理人和基金託管人

項目		基金管理人	基金託管人
名稱		華夏基金管理有限公司	中國銀行股份有限公司
信息披露 負責人	姓名	李彬	許俊
	聯繫電話	400-818-6666	95566
	電子郵箱	service@ChinaAMC.com	fcid@bankofchina.com
客戶服務電話		400-818-6666	95566
傳真		010-63136700	010-66594942
註冊地址		北京市順義區安慶大街甲3號院	北京市西城區復興門內大街1號
辦公地址		北京市西城區金融大街33號通泰大廈B座8層	北京市西城區復興門內大街1號
郵政編碼		100033	100818
法定代表人		楊明輝	劉連舸

2.4 信息披露方式

本基金選定的信息披露報紙名稱	《證券時報》
刊登基金年度報告正文的管理人互聯網網址	www.ChinaAMC.com
基金年度報告備置地地點	基金管理人和/或基金託管人的住所/辦公地址

2.5 其他相關資料

項目	名稱	辦公地址
會計師事務所	安永華明會計師事務所（特殊普通合夥）	北京市東城區東長安街 1 號東方廣場安永大樓 17 層
註冊登記機構	華夏基金管理有限公司	北京市西城區金融大街 33 號通泰大廈 B 座 8 層

§3 主要財務指標、基金淨值表現及利潤分配情況

3.1 主要會計資料和財務指標

金額單位：人民幣元

3.1.1 期間資料和指標	2022 年	2021 年	2020 年
本期已實現收益	-189,310,228.11	2,913,859,266.59	1,697,710,227.71
本期利潤	-1,303,067,933.76	-2,229,564,213.74	5,719,847,333.84
加權平均基金份額 本期利潤	-0.1399	-0.2549	0.7432
本期加權平均淨值 利潤率	-10.35%	-14.45%	45.15%
本期基金份額淨值 增長率	-9.56%	-13.53%	54.05%
3.1.2 期末資料和指標	2022 年末	2021 年末	2020 年末
期末可供分配利潤	-201,530,140.85	125,100,145.20	68,608,987.72
期末可供分配基金 份額利潤	-0.0221	0.0132	0.0086
期末基金資產淨值	11,937,144,389.67	13,840,764,145.02	16,305,257,036.20
期末基金份額淨值	1.311	1.465	2.049
3.1.3 累計期末指標	2022 年末	2021 年末	2020 年末
基金份額累計淨值 增長率	1,442.87%	1,605.97%	1,872.94%

① 所述基金業績指標不包括持有人認購或交易基金的各項費用，計入費用後實際收益水平低於所列數字。

② 本期已實現收益指基金本期利息收入、投資收益、其他收入（不含公允價值變動收益）扣除相關費用和信用減值損失後的餘額，本期利潤為本期已實現收益加上本期公允價值變動收益。

③ 期末可供分配利潤為期末資產負債表中未分配利潤與未分配利潤中已實現部分的孰低數。

3.2 基金淨值表現

3.2.1 基金份額淨值增長率及其與同期業績比較基準收益率的比較

階段	份額淨值 增長率①	份額淨值 增長率標 準差②	業績比較 基準收益 率③	業績比較 基準收益 率標準差 ④	①—③	②—④
過去三個月	-2.16%	0.65%	0.38%	0.00%	-2.54%	0.65%

過去六個月	-6.49%	0.55%	0.76%	0.00%	-7.25%	0.55%
過去一年	-9.56%	0.65%	1.50%	0.00%	-11.06%	0.65%
過去三年	20.47%	1.05%	4.50%	0.00%	15.97%	1.05%
過去五年	31.19%	1.05%	7.50%	0.00%	23.69%	1.05%
自基金合同生效起至今	1,442.87%	1.01%	45.18%	0.00%	1,397.69%	1.01%

3.2.2 自基金合同生效以來基金份額累計淨值增長率變動及其與同期業績比較基準收益率變動的比較

華夏回報證券投資基金

份額累計淨值增長率與業績比較基準收益率歷史走勢對比圖

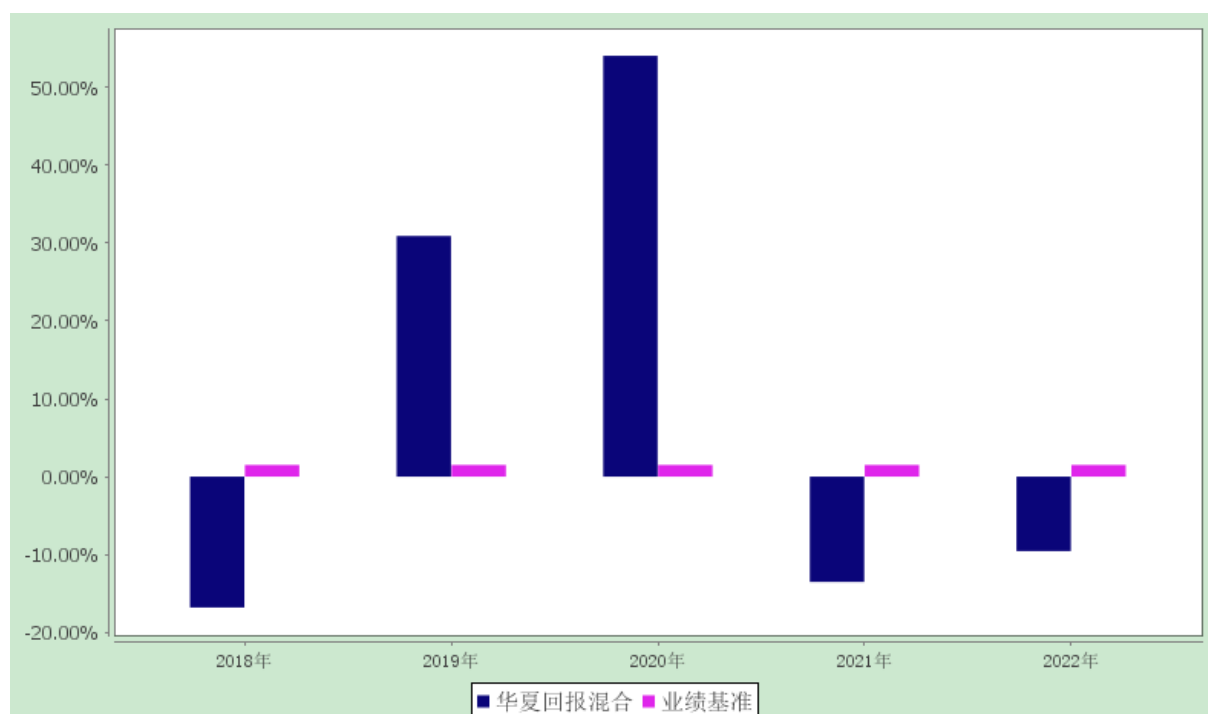
(2003 年 9 月 5 日至 2022 年 12 月 31 日)



3.2.3 過去五年基金每年淨值增長率及其與同期業績比較基準收益率的比較

華夏回報證券投資基金

過去五年基金淨值增長率與業績比較基準收益率的對比圖



3.3 過去三年基金的利潤分配情況

單位：人民幣元

年度	每10份基金份額 分紅數	現金形式發放總 額	再投資形式發放 總額	年度利潤分配合 計	備註
2022 年	0.150	46,528,460.13	94,761,003.64	141,289,463.77	-
2021 年	3.300	959,998,278.90	1,926,358,717.90	2,886,356,996.80	-
2020 年	2.100	549,072,903.38	1,037,309,954.57	1,586,382,857.95	-
合計	5.550	1,555,599,642.41	3,058,429,676.11	4,614,029,318.52	-

§4 管理人報告

4.1 基金管理人及基金經理情況

4.1.1 基金管理人及其管理基金的經驗

華夏基金管理有限公司成立於 1998 年 4 月 9 日，是經中國證監會批准成立的首批全國性基金管理公司之一。公司總部設在北京，在北京、上海、深圳、成都、南京、杭州、廣州和青島設有分公司，在香港、深圳、上海設有子公司。公司是首批全國社保基金管理人、首批企業年金基金管理人、境內首批 QDII 基金管理人、境內首隻 ETF 基金管理人、境內首隻滬港通 ETF 基金管理人、首批內地與香港基金互認基金管理人、首批基本養老保險基金投資管理人資格、首家加入聯合國責任投資原則組織的公募基金公司、首批公募 FOF 基金管理人、首批公募養老目標基金管理人、首批個人養老金基金管理人、境內首批中日互通 ETF 基金管理人、首批商品期貨 ETF 基金管理人、首批公募 MOM 基金管理人、首批納入互聯互通 ETF 基金管理人、首批北交所主題基金管理人以及特定客戶

資產管理人、保險資金投資管理人、公募 REITs 管理人，國內首家承諾“碳中和”具體目標和路徑的公募基金公司，香港子公司是首批 RQFII 基金管理人。華夏基金是業務領域最廣泛的基金管理公司之一。

華夏基金是境內 ETF 基金資產管理規模最大的基金管理公司之一，在 ETF 基金管理方面積累了豐富的經驗，形成了覆蓋大盤藍籌、寬基指數、中小創指數、主題指數、行業指數、Smart Beta 策略、海外市場指數、信用債指數、商品指數等較為完整的產品線。

華夏基金以深入的投資研究為基礎，盡力捕捉市場機會，為投資者謀求良好的回報。根據銀河證券基金研究中心《中國基金業績評價報告》，截至 2022 年 12 月 31 日，華夏基金旗下多隻產品近 1 年同類排名領先（基金排名不作為產品未來表現的保證），其中：

主動權益產品：在 TMT 與信息技術行業偏股型基金(A 類)中華夏互聯網龍頭混合(A 類)排名第 2/22；在低碳環保行業股票型基金(A 類)中華夏節能環保股票(A 類)排名第 2/10；在 TMT 與資訊技術行業股票型基金(A 類)中華夏科技成長股票排名第 4/20；在醫藥醫療健康行業偏股型基金(A 類)中華夏逸享健康混合(A 類)排名第 8/60、華夏樂享健康混合(A 類)排名第 17/60；在消費行業偏股型基金(A 類)中華夏網購精選混合(A 類)排名第 12/61；在標準股票型基金(A 類)中華夏智勝價值成長股票(A 類)排名第 12/307；在靈活配置型基金(基準股票比例 30%-60%)(A 類)中華夏新錦繡混合(A 類)排名第 12/451、華夏新錦升混合(A 類)排名第 18/451、華夏新趨勢混合(A 類)排名第 78/451；在偏股型基金(股票上限 80%)(A 類)中華夏經典混合排名第 18/148；在偏股型基金(股票上限 95%)(A 類)中華夏新興經濟一年持有混合(A 類)排名第 17/211、華夏磐利一年定開混合(A 類)排名第 38/211、華夏藍籌混合(LOF)(A 類)排名第 44/211、華夏磐銳一年定開混合(A 類)排名第 45/211、華夏興華混合(A 類)排名第 49/211；在靈活配置型基金(基準股票比例 60%-100%)(A 類)中華夏圓和混合(A 類)排名第 28/461；在偏債型基金(A 類)中華夏睿磐泰盛混合排名第 30/532、華夏磐泰混合(LOF)(A 類)排名第 43/532；在偏股型基金(股票上下限 60%-95%)(A 類)中華夏價值精選混合排名第 60/1177。

固收與固收+產品：在信用債指數債券型基金(A 類)中華夏亞債中國指數(A 類)排名第 2/14；在普通債券型基金(二級)(A 類)中華夏恒融債券排名第 6/336、華夏穩健增利 4 個月債券(A 類)排名第 16/336；在利率債指數債券型基金(A 類)中華夏中債 1-3 年政金債指數(A 類)排名第 21/107；在普通債券型基金(可投轉債)(A 類)中華夏鼎祿三個月定開債券(A 類)排名第 33/357；在長期純債債券型基金(A 類)中華夏鼎隆債券(A 類)排名第 59/1158、華夏鼎英債券(A 類)排名第 60/1158。

指數與量化產品：在對沖策略絕對收益目標基金(A 類)中華夏安泰對沖策略 3 個月定開混合排名第 1/23；在規模指數股票 ETF 基金中華夏滬港通恒生 ETF 排名第 1/131、華夏中證滬港深 500ETF 排名第 26/131、華夏上證 50ETF 排名第 30/131；在規模指數股票 ETF 聯接基金(A 類)中華夏滬港通

恒生 ETF 聯接(A 類)排名第 1/92、華夏上證 50ETF 聯接(A 類)排名第 25/92；在行業指數股票 ETF 聯接基金(A 類)中華夏中證銀行 ETF 聯接(A 類)排名第 2/28、華夏中證全指房地產 ETF 聯接(A 類)排名第 7/28；在增強規模指數股票型基金(A 類)中華夏中證 500 指數增強(A 類)排名第 2/123、華夏中證 500 指數智選增強(A 類)排名第 4/123、華夏滬深 300 指數增強(A 類)排名第 38/123；在行業指數股票 ETF 基金中華夏中證銀行 ETF 排名第 6/51、華夏中證全指房地產 ETF 排名第 16/51；在主題指數股票 ETF 基金中華夏金融 ETF 發起式排名第 11/257、華夏中證浙江國資創新發展 ETF 排名第 37/257、華夏中證細分食品飲料產業主題 ETF 排名第 40/257、華夏中證央企 ETF 排名第 47/257、華夏中證細分有色金屬產業主題 ETF 排名第 67/257；在主題指數股票 ETF 聯接基金(A 類)中華夏中證浙江國資創新發展 ETF 聯接(A 類)排名第 21/89、華夏中證央企 ETF 聯接(A 類)排名第 27/89。

在《中國證券報》第十九屆中國基金業金牛獎評選中，華夏基金榮獲“被動投資金牛基金公司”，成為業內連續 7 年獲此殊榮的基金公司。在證券時報主辦的第十七屆中國基金業明星基金獎評選活動上，在“年度十大明星基金公司獎”評選中，華夏基金成功獲獎。此外，華夏基金還獲得“三年海外投資明星基金公司獎”。在《上海證券報》主辦的第十九屆“金基金”獎評選活動上，華夏基金將三大金基金獎項收入囊中：公司層面，華夏基金榮獲“金基金·被動投資基金管理公司獎”；產品層面，華夏能源革新股票榮獲“金基金·投資回報基金獎”，華夏滬深 300ETF 榮獲“金基金·指數基金三年期獎”。

在客戶服務方面，2022 年，華夏基金繼續以客戶需求為導向，努力提高客戶使用的便利性和服務體驗：（1）華夏基金直銷上線北京銀行、廣發銀行快捷等支付方式，拓展支付管道的同時交易額度也得到進一步提升，滿足客戶支付需求；（2）華夏基金管家用戶端優化資料上傳、定投收益展示等功能，增加客戶操作便利性；養老專區升級，為個人養老金帳戶的開立、充值及交易提供一站式服務，提升客戶整體操作感受；（3）與蘭州銀行、晉商銀行、成都銀行、九州證券、瑞銀基金銷售等代銷機構合作，拓展更加豐富的客戶理財管道；（4）開展“壓歲錢手賬”、“基金視力表”、“童言童語話理財”、“尋找代言人”、“成為首批 Y 星人”等活動，為客戶提供了多樣化的投資者教育和關懷服務。

4.1.2 基金經理（或基金經理小組）及基金經理助理的簡介

姓名	職務	任本基金的基金經理（助理）期限		證券從業年限	說明
		任職日期	離任日期		
陽琨	本基金的基金經理、公司投資總監、投委會成員	2021-11-02	-	27 年	碩士。曾任寶盈基金基金經理助理，益民基金投資部部門經理，中國對外經濟貿易信託投資有限公司

					財務部部門經理等。2006 年 8 月加入華夏基金管理有限公司。歷任策略研究員、股票投資部副總經理、興和證券投資基金基金經理（2009 年 1 月 1 日至 2012 年 1 月 12 日期間）、興華證券投資基金基金經理（2007 年 6 月 12 日至 2013 年 4 月 11 日期間）、華夏盛世精選混合型證券投資基金基金經理（2009 年 12 月 18 日至 2015 年 9 月 1 日期間）、華夏大盤精選證券投資基金基金經理（2015 年 9 月 1 日至 2017 年 5 月 2 日期間）、華夏大中華企業精選靈活配置混合型證券投資基金（QDII）基金經理（2016 年 1 月 20 日至 2018 年 10 月 11 日期間）、華夏新時代靈活配置混合型證券投資基金（QDII）基金經理（2018 年 5 月 30 日至 2019 年 7 月 15 日期間）等。
季新星	本基金的基金經理	2021-11-02	-	13 年	碩士。曾任申萬菱信基金管理有限公司權益投資部研究員、申萬菱信消費增長混合型證券投資基金基金經理、申萬菱信新動力混合型證券投資基金基金經理。2020 年 7 月加入華夏基金管理有限公司。
祝青	本基金的基金經理助理	2022-10-14	-	7 年	碩士。曾任中國航太產業投資基金投資分析師。2017 年 8 月加入華夏基金管理有限公司。歷任研究員。

注：①上述“任職日期”和“離任日期”為根據公司決定確定的聘任日期和解聘日期。首任基金經理的，其“任職日期”為基金合同生效日。

②證券從業的含義遵從行業協會《證券業從業人員資格管理辦法》的相關規定。

4.1.3 基金經理薪酬機制

本基金管理人旗下基金經理兼任私募資產管理計劃投資經理的，不存在基金經理薪酬激勵與其在管私募資產管理計劃浮動管理費或產品業績表現掛鉤的情況。

4.2 管理人對報告期內本基金運作遵規守信情況的說明

報告期內，本基金管理人嚴格遵守《中華人民共和國證券投資基金法》、《公開募集證券投資基金運作管理辦法》、《證券投資基金管理公司公平交易制度指導意見》、《基金管理公司開展投資、研究活動防控內幕交易指導意見》等法律法規和基金合同，本著誠實信用、勤勉盡責、安全高效的原則管理和運用基金資產，在嚴格控制投資風險的基礎上，為基金份額持有人謀求最大利益，沒有損害基金份額持有人利益的行為。

4.3 管理人對報告期內公平交易情況的專項說明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根據《證券投資基金管理公司公平交易制度指導意見》等法規制定了《華夏基金管理有限公司公平交易制度》。公司通過科學、制衡的投資決策體系，加強交易分配環節的內部控制，並通過工作制度、流程和技術方式保證公平交易原則的實現。同時，通過監察稽核、事後分析和信息披露來保證公平交易過程和結果的監督。

4.3.2 公平交易制度的執行情況

本基金管理人一貫公平對待旗下管理的所有基金和組合，制定並嚴格遵守相應的制度和流程，通過系統和人工等方式在各環節嚴格控制交易公平執行。報告期內，本基金管理人嚴格執行了《證券投資基金管理公司公平交易制度指導意見》和《華夏基金管理有限公司公平交易制度》的規定。

4.3.2.1 增加執行的基金經理公平交易制度執行情況及公平交易管理情況

本基金管理人一貫嚴格執行公平交易原則，對兼任基金經理的交易情況進行持續監測。本年度所有相關組合的交易行為均符合法規、制度和流程要求，未發現違反公平交易原則的情況。本年度同一基金經理管理的不同組合在鄰近交易日的同向和反向交易，交易時機和交易價差均可合理解釋，未發現異常。

本基金管理人根據《基金經理兼任私募資產管理計劃投資經理工作指引（試行）》要求，針對同經理管理多個組合間的收益率差異進行歸因分析，本年度各組合間收益率差異均屬正常情況，主要原因為業績基準不同、投資策略不同，收益率差異可以合理解釋。

4.3.3 異常交易行為的專項說明

報告期內未發現本基金存在異常交易行為。

報告期內，本基金管理人旗下所有投資組合參與的交易所公開競價交易中，同日反向交易成交

較少的單邊交易量超過該證券當日成交量的 5% 的交易共有 113 次，其中 110 次為指數量化投資組合因投資策略需要和其他組合發生的反向交易，其餘 3 次為投資策略需要所致，不同基金經理管理的組合間因投資策略不同而發生的反向交易，有關基金經理已根據公司管理要求提供決策依據。

4.4 管理人對報告期內基金的投資策略和業績表現的說明

4.4.1 報告期內基金投資策略和運作分析

2022 年，包括 A 股市場在內的全球權益市場都經歷了非常顯著的調整，其中，中國 wind 全 A 指數下跌 18.7%，美股納斯達克指數下跌 33.1%，美國標普 500 指數下跌 19.4%。A 股市場調整主要原因有兩方面，一方面是全球通脹高企導致美聯儲全年持續加息，全球流動性收縮；另一方面是中國宏觀經濟和企業整體盈利受到國內疫情反復擾動和房地產產業鏈持續深度調整的不利影響。從行業板塊看，全年除了受益於通脹的上游資源板塊比如煤炭等取得了正收益外，絕大部分行業都經歷了全年的下跌過程。

本基金在 2022 年一季度降低了組合股票持倉，以防禦市場整體下行的風險，全年整體維持了較低的股票倉位，從市場表現看，本基金在大類資產配置的決策是比較成功的。但是由於市場整體的不理想，本基金雖然取得了相對權益市場的超額收益，但仍承受了基金淨值的下跌。

報告期內，本基金堅持自下而上的選股方式，主要投資了消費、地產金融、科技、高端製造各細分板塊中競爭格局良好、壁壘高較高、具有長期成長確定性的優質公司。

4.4.2 報告期內基金的業績表現

截至 2022 年 12 月 31 日，本基金份額淨值為 1.311 元，本報告期份額淨值增長率為-9.56%，同期業績比較基準增長率為 1.50%。

4.5 管理人對宏觀經濟、證券市場及行業走勢的簡要展望

二十大在十月成功召開，為我國經濟未來五年乃至更長時期的發展指明了方向，發展仍是我們黨執政興國的首要任務，二十大明確提出了中國式現代化的發展道路，貫徹新發展理念、堅持高品質發展、構建新發展格局是發展的著力點。12 月份，我國疫情防控政策發生明顯優化調整，疫情防控工作重心從“防感染”轉向“保健康、防重症”，12 月份全國各地疫情高峰先後到來，4 季度國內宏觀經濟和企業整體收入盈利預計會受到明顯影響，也為未來經濟重新啟動奠定了基礎，相應的 A 股消費相關板塊在四季度走出了先跌後漲的行情，預示著市場對未來的消費復蘇有更多期待。國內政策方面，二十大之後，對一些熱點領域的政策導向也逐漸趨向明晰，房地產市場持續深度調整背景下，監管層先後出台了以“金融十六條”等為代表的支持政策，從信貸、公開市場發債、股權融資等維度對房地產市場和企業進行支援，相應的四季度以地產、銀行、地產產業鏈為代表的板塊表現相對較好；隨著對平台經濟等板塊的紅綠燈監管制度逐步成型，對互聯網、教育等板塊的政策也開始

出現緩和，相關板塊在 4 季度也開始出現上漲；

海外經濟方面，我們判斷四季度是通脹壓力最大的時候，隨著西方國家經濟出現調整跡象，我們判斷通脹壓力高峰已經出現，未來一段時間海外的主要矛盾可能會逐步轉移至經濟增長和需求方面。

進入 2023 年，我們對中國經濟和 A 股市場都相對樂觀。我們堅信，長期為投資者貢獻回報的主要來源有兩個方面，一是中國經濟的長期持續穩健增長，二是機構投資者對行業、公司基本面的深入挖掘，以研究創造價值，力求為我們的投資者貢獻長期超額收益。

我們將繼續堅持回報系列基金的風格特徵，在注重淨值波動風險的前提下，努力把握市場機會。我們將主要通過個股選擇創造超額收益，爭取以個股的確定性對抗市場的不確定性，爭取以專業投資為持有人提供理想的回報。

珍惜基金份額持有人的每一分投資和每一份信任，本基金將繼續奉行華夏基金管理有限公司“為信任奉獻回報”的經營理念，規範運作，審慎投資，勤勉盡責地為基金份額持有人謀求長期、穩定的回報。

4.6 管理人內部有關本基金的監察稽核工作情況

報告期內，本基金管理人持續加強合規管理、風險控制和監察稽核工作。在合規管理方面，公司通過合規審核、合規檢查、合規諮詢、合規宣傳與合規培訓等對合規風險進行管理，確保公司合規體系高效運行，合規風險有效控制。公司不斷強化合規制度建設，在投資者適當性管理和員工投資行為合規管理等方面修訂多項管理制度。持續強化合規隊伍專業能力建設，提升合規人員解讀政策法律、預判防控合規風險的能力。公司通過法律法規答題、合規培訓、合規談話等形式，多措並舉厚植合規經營文化。公司嚴格落實信息披露法規要求，依法合規開展信息披露工作。在風險控制方面，公司秉承數位化管理理念，持續完善內部風險管理系統建設，穩步夯實投資風險管理基礎。在嚴格管控基金日常投資運作風險的同時，持續完善風險管理制度建設，提升基金流動性風險、市場風險、合規風險、操作風險等關鍵風險的管控水平，努力保障各項風險管理措施落實到位。在監察稽核方面，公司定期和不定期開展內部稽核及離任審計工作，排查業務風險隱患，促進公司整體業務合規運作、穩健經營。

報告期內，本基金管理人所管理的基金整體運作合法合規。本基金管理人將繼續以風險控制為核心，堅持基金份額持有人利益優先的原則，提高監察稽核工作的科學性和有效性，切實保障基金合規穩健運作。

4.7 管理人對報告期內基金估值程序等事項的說明

根據中國證監會相關規定及基金合同約定，本基金管理人為準確、及時進行基金估值和份額淨

值計價，制定了基金估值和份額淨值計價的業務管理制度，建立了估值委員會，使用可靠的估值業務系統，設有完善的風險監測、控制和報告機制。本基金託管人審閱本基金管理人採用的估值原則及技術，並覆核、審查基金資產淨值和基金份額申購、贖回價格。會計師事務所在估值調整導致基金資產淨值的變化在 0.25%以上時對所採用的相關估值技術、假設及輸入值的適當性發表專業意見。定價服務機構按照商業合同約定提供定價服務。

4.8 管理人對報告期內基金利潤分配情況的說明

根據《公開募集證券投資基金運作管理辦法》及本基金的基金合同等規定，本基金本報告期實施利潤分配 1 次，符合相關法規及基金合同的規定。

4.9 報告期內管理人對本基金持有人數或基金資產淨值預警情形的說明

報告期內，本基金未出現連續二十個工作日基金份額持有人數量不滿二百人或者基金資產淨值低於五千萬元的情形。

§5 託管人報告

5.1 報告期內本基金託管人遵規守信情況聲明

本報告期內，中國銀行股份有限公司（以下稱“本託管人”）在華夏回報證券投資基金（以下稱“本基金”）的託管過程中，嚴格遵守《證券投資基金法》及其他有關法律法規、基金合同和託管協議的有關規定，不存在損害基金份額持有人利益的行為，完全盡職盡責地履行了應盡的義務。

5.2 託管人對報告期內本基金投資運作遵規守信、淨值計算、利潤分配等情況的說明

本報告期內，本託管人根據《證券投資基金法》及其他有關法律法規、基金合同和託管協議的規定，對本基金管理人的投資運作進行了必要的監督，對基金資產淨值的計算、基金份額申購贖回價格的計算以及基金費用開支等方面進行了認真地覆核，未發現本基金管理人存在損害基金份額持有人利益的行為。

5.3 託管人對本年度報告中財務信息等內容的真實、準確和完整發表意見

本報告中的財務指標、淨值表現、收益分配情況、財務會計報告（注：財務會計報告中的“金融工具風險及管理”、“關聯方承銷證券”、“關聯方證券出借”部分未在託管人覆核範圍內）、投資組合報告等資料真實、準確和完整。

§6 審計報告

安永華明（2023）審字第 60739337_A04 號

華夏回報證券投資基金全體基金份額持有人：

6.1 審計意見

我們審計了華夏回報證券投資基金的財務報表，包括 2022 年 12 月 31 日的資產負債表，2022 年度的利潤表、淨資產（基金淨值）變動表以及相關財務報表附注。

我們認為，後附的華夏回報證券投資基金的財務報表在所有重大方面按照企業會計準則的規定編製，公允反映了華夏回報證券投資基金 2022 年 12 月 31 日的財務狀況以及 2022 年度的經營成果和淨值變動情況。

6.2 形成審計意見的基礎

我們按照中國註冊會計師審計準則的規定執行了審計工作。審計報告的“註冊會計師對財務報表審計的責任”部分進一步闡述了我們在這些準則下的責任。按照中國註冊會計師職業道德守則，我們獨立於華夏回報證券投資基金，並履行了職業道德方面的其他責任。我們相信，我們獲取的審計證據是充分、適當的，為發表審計意見提供了基礎。

6.3 其他信息

華夏回報證券投資基金管理層對其他信息負責。其他信息包括年度報告中涵蓋的信息，但不包括財務報表和我們的審計報告。

我們對財務報表發表的審計意見不涵蓋其他信息，我們也不對其他信息發表任何形式的鑑證結論。

結合我們對財務報表的審計，我們的責任是閱讀其他信息，在此過程中，考慮其他信息是否與財務報表或我們在審計過程中了解到的情況存在重大不一致或者似乎存在重大錯報。

基於我們已執行的工作，如果我們確定其他信息存在重大錯報，我們應當報告該事實。在這方面，我們無任何事項需要報告。

6.4 管理層和治理層對財務報表的責任

管理層負責按照企業會計準則的規定編製財務報表，使其實現公允反映，並設計、執行和維護必要的內部控制，以使財務報表不存在由於舞弊或錯誤導致的重大錯報。

在編製財務報表時，管理層負責評估華夏回報證券投資基金的持續經營能力，披露與持續經營相關的事項（如適用），並運用持續經營假設，除非計劃進行清算、終止運營或別無其他現實的選擇。

治理層負責監督華夏回報證券投資基金的財務報告過程。

6.5 註冊會計師對財務報表審計的責任

我們的目標是對財務報表整體是否不存在由於舞弊或錯誤導致的重大錯報獲取合理保證，並出具包含審計意見的審計報告。合理保證是高水平的保證，但並不能保證按照審計準則執行的審計在某一重大錯報存在時總能發現。錯報可能由於舞弊或錯誤導致，如果合理預期錯報單獨或匯總起來可能影響財務報表使用者依據財務報表作出的經濟決策，則通常認為錯報是重大的。

在按照審計準則執行審計工作的過程中，我們運用職業判斷，並保持職業懷疑。同時，我們也執行以下工作：

（1）識別和評估由於舞弊或錯誤導致的財務報表重大錯報風險，設計和實施審計程序以應對這些風險，並獲取充分、適當的審計證據，作為發表審計意見的基礎。由於舞弊可能涉及串通、偽造、故意遺漏、虛假陳述或凌駕於內部控制之上，未能發現由於舞弊導致的重大錯報的風險高於未能發現由於錯誤導致的重大錯報的風險。

（2）了解與審計相關的內部控制，以設計恰當的審計程序，但目的並非對內部控制的有效性發表意見。

（3）評價管理層選用會計政策的恰當性和作出會計估計及相關披露的合理性。

（4）對管理層使用持續經營假設的恰當性得出結論。同時，根據獲取的審計證據，就可能導致對華夏回報證券投資基金持續經營能力產生重大疑慮的事項或情況是否存在重大不確定性得出結論。如果我們得出結論認為存在重大不確定性，審計準則要求我們在審計報告中提請報表使用者注意財務報表中的相關披露；如果披露不充分，我們應當發表非無保留意見。我們的結論基於截至審計報告日可獲得的信息。然而，未來的事項或情況可能導致華夏回報證券投資基金不能持續經營。

（5）評價財務報表的總體列報（包括披露）、結構和內容，並評價財務報表是否公允反映相關交易和事項。

我們與治理層就計劃的審計範圍、時間安排和重大審計發現等事項進行溝通，包括溝通我們在審計中識別出的值得關注的內部控制缺陷。

安永華明會計師事務所（特殊普通合夥）

中國註冊會計師

蔣燕華 王海彥

北京市東城區東長安街 1 號東方廣場安永大樓 17 層

2023 年 3 月 28 日

§7 年度財務報表

7.1 資產負債表

會計主體：華夏回報證券投資基金

報告截止日：2022 年 12 月 31 日

單位：人民幣元

資產	附注號	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
資產：			
銀行存款	7.4.7.1	914,596,828.63	1,832,783,286.85
結算備付金		14,292,497.89	5,273,357.61
存出保證金		1,314,482.54	1,058,893.45
交易性金融資產	7.4.7.2	11,141,143,989.92	11,489,848,081.34
其中：股票投資		7,608,788,411.38	7,312,148,813.18
基金投資		-	-
債券投資		3,532,355,578.54	4,177,699,268.16
資產支持證券投資		-	-
貴金屬投資		-	-
其他投資		-	-
衍生金融資產	7.4.7.3	-	-
買入返售金融資產	7.4.7.4	-	491,421,327.71
應收清算款		-	72,384.29
應收股利		-	-
應收申購款		3,091,912.75	4,901,264.41
遞延所得稅資產		-	-
其他資產	7.4.7.5	-	71,289,794.98
資產總計		12,074,439,711.73	13,896,648,390.64
負債和淨資產	附注號	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
負債：			
短期借款		-	-
交易性金融負債		-	-
衍生金融負債	7.4.7.3	-	-
賣出回購金融資產款		-	-
應付清算款		98,072,475.97	-
應付贖回款		5,726,893.65	15,342,643.97
應付管理人報酬		15,402,839.80	17,940,723.86
應付託管費		2,567,139.93	2,990,120.65
應付銷售服務費		-	-
應付投資顧問費		-	-
應交稅費		84,717.83	78,727.76
應付利潤		-	-
遞延所得稅負債		-	-
其他負債	7.4.7.6	15,441,254.88	19,532,029.38
負債合計		137,295,322.06	55,884,245.62
淨資產：			

實收基金	7.4.7.7	9,103,914,367.54	9,444,816,091.35
未分配利潤	7.4.7.8	2,833,230,022.13	4,395,948,053.67
淨資產合計		11,937,144,389.67	13,840,764,145.02
負債和淨資產總計		12,074,439,711.73	13,896,648,390.64

注：①報告截止日 2022 年 12 月 31 日，基金份額淨值 1.311 元，基金份額總額

9,103,914,367.54 份。

②以下比較資料已根據本年《證券投資基金信息披露 XBRL 範本第 3 號<年度報告和中期報告>》中的資產負債表格式的要求進行列示：2021 年年度報告資產負債表中“應收利息”與“其他資產”項目的“本期末”餘額合併列示在 2022 年年度報告資產負債表中“其他資產”項目的“上年度末”餘額，2021 年年度報告資產負債表中“應付交易費用”、“應付利息”與“其他負債”科目的“本期末”餘額合併列示在 2022 年年度報告資產負債表“其他負債”項目的“上年度末”餘額。

7.2 利潤表

會計主體：華夏回報證券投資基金

本報告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

單位：人民幣元

項 目	附注號	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期間 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
一、營業總收入		-1,082,083,463.87	-1,935,255,217.73
1.利息收入		6,000,485.29	147,491,800.33
其中：存款利息收入	7.4.7.9	4,117,308.56	6,382,010.54
債券利息收入		-	133,796,772.18
資產支持證券利息收入		-	-
買入返售金融資產收入		1,883,176.73	7,313,017.61
證券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投資收益（損失以“-”填列）		23,302,028.07	3,053,036,859.41
其中：股票投資收益	7.4.7.10	-249,449,906.64	2,975,967,986.80
基金投資收益		-	-
債券投資收益	7.4.7.11	140,565,202.28	-282,832.66
資產支持證券投資收益	7.4.7.12	-	-
貴金屬投資收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.13	-	-
股利收益	7.4.7.14	132,186,732.43	77,351,705.27
其他投資收益		-	-
3.公允價值變動收益（損失以“-”號填列）	7.4.7.15	-1,113,757,705.65	-5,143,423,480.33
4.匯兌收益（損失以“-”號填列）		-	-
5.其他收入（損失以“-”號填列）	7.4.7.16	2,371,728.42	7,639,602.86
減：二、營業總支出		220,984,469.89	294,308,996.01
1.管理人報酬		189,158,010.61	231,963,881.65
2.託管費		31,526,335.19	38,660,646.86

3.銷售服務費		-	-
4.投資顧問費		-	-
5.利息支出		-	346,221.65
其中：賣出回購金融資產支出		-	346,221.65
6.信用減值損失	7.4.7.17	-	-
7.稅金及附加		1,630.42	482.87
8.其他費用	7.4.7.18	298,493.67	23,337,762.98
三、利潤總額（虧損總額以“-”號填列）		-1,303,067,933.76	-2,229,564,213.74
減：所得稅費用		-	-
四、淨利潤（淨虧損以“-”號填列）		-1,303,067,933.76	-2,229,564,213.74
五、其他綜合收益的稅後淨額		-	-
六、綜合收益總額		-1,303,067,933.76	-2,229,564,213.74

注：以下比較資料已根據本年《證券投資基金信息披露 XBRL 範本第 3 號<年度報告和中期報告>》中的利潤表格式的要求進行列示：2021 年年度報告利潤表中“交易費用”項目與“其他費用”項目的“本期”金額合併列示在 2022 年年度報告利潤表中“其他費用”項目的“上年度可比期間”金額。

7.3 淨資產（基金淨值）變動表

會計主體：華夏回報證券投資基金

本報告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

單位：人民幣元

項目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日			
	實收基金	其他綜合收益	未分配利潤	淨資產合計
一、上期期末淨資產（基金淨值）	9,444,816,091.35	-	4,395,948,053.67	13,840,764,145.02
二、本期期初淨資產（基金淨值）	9,444,816,091.35	-	4,395,948,053.67	13,840,764,145.02
三、本期增減變動額（減少以“-”號填列）	-340,901,723.81	-	-1,562,718,031.54	-1,903,619,755.35
（一）、綜合收益總額	-	-	-1,303,067,933.76	-1,303,067,933.76
（二）、本期基金份額交易產生的基金淨值變動數（淨值減少以“-”號填列）	-340,901,723.81	-	-118,360,634.01	-459,262,357.82
其中：1.基金申購款	1,001,307,670.86	-	359,717,849.21	1,361,025,520.07
2.基金贖回款	-1,342,209,394.67	-	-478,078,483.22	-1,820,287,877.89

（三）、本期向 基金份額持有人 分配利潤產生的 基金淨值變動 （淨值減少以 “-”號填列）	-	-	-141,289,463.77	-141,289,463.77
四、本期期末淨 資產（基金淨 值）	9,103,914,367.54	-	2,833,230,022.13	11,937,144,389.67
項目	上年度可比期間 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日			
	實收基金	其他綜合收益	未分配利潤	淨資產合計
一、上期期末淨 資產（基金淨 值）	7,957,194,040.08	-	8,348,062,996.12	16,305,257,036.20
二、本期期初淨 資產（基金淨 值）	7,957,194,040.08	-	8,348,062,996.12	16,305,257,036.20
三、本期增減變 動額（減少以 “-”號填列）	1,487,622,051.27	-	-3,952,114,942.45	-2,464,492,891.18
（一）、綜合收 益總額	-	-	-2,229,564,213.74	-2,229,564,213.74
（二）、本期基 金份額交易產生 的基金淨值變動 數（淨值減少以 “-”號填列）	1,487,622,051.27	-	1,163,806,268.09	2,651,428,319.36
其中：1.基金申 購款	4,512,480,740.89	-	3,670,223,130.95	8,182,703,871.84
2.基金贖 回款	-3,024,858,689.62	-	-2,506,416,862.86	-5,531,275,552.48
（三）、本期向 基金份額持有人 分配利潤產生的 基金淨值變動 （淨值減少以 “-”號填列）	-	-	-2,886,356,996.80	-2,886,356,996.80
四、本期期末淨 資產（基金淨 值）	9,444,816,091.35	-	4,395,948,053.67	13,840,764,145.02

報表附注為財務報表的組成部分。

本報告 7.1 至 7.4，財務報表由下列負責人簽署：

基金管理人負責人：楊明輝，主管會計工作負責人：朱威，會計機構負責人：朱威

7.4 報表附注

7.4.1 基金基本情況

華夏回報證券投資基金（以下簡稱“本基金”）經中國證券監督管理委員會（以下簡稱“中國證

監會”)證監基金字[2003]86 號《關於同意華夏回報證券投資基金設立的批覆》核准，由基金發起人華夏基金管理有限公司依照《證券投資基金管理暫行辦法》(於 2004 年 9 月 16 日廢止，由《中華人民共和國證券投資基金法》取代)、《開放式證券投資基金試點辦法》(已廢止)等有關規定和《華夏回報證券投資基金基金契約》(於 2004 年 10 月 15 日改為《華夏回報證券投資基金基金合同》)發起，並於 2003 年 9 月 5 日募集成立。本基金為契約型開放式，存續期限不定，首次設立募集不包括認購資金利息共募集 3,796,885,823.40 元，業經普華永道中天會計師事務所有限公司普華永道驗字(2003)第 112 號驗資報告予以驗證。有關基金設立等文件已按規定向中國證監會備案。本基金的基金管理人為華夏基金管理有限公司，基金託管人為中國銀行股份有限公司。根據基金管理人 2015 年 7 月 2 日刊登的《華夏基金管理有限公司關於修訂華夏回報證券投資基金基金合同的公告》，本基金自 2015 年 7 月 2 日起增加 H 類基金份額類別。

根據《中華人民共和國證券投資基金法》、《華夏回報證券投資基金基金合同》等有關規定，本基金的投資範圍限於具有良好流動性的金融工具，包括國內依法公開發行上市的股票(含存托憑證)、債券、權證、資產支持證券及中國證監會允許基金投資的其他金融工具。其中債券包括國債、金融債、企業(公司)債(包括可轉債)等。

7.4.2 會計報表的編製基礎

本基金的財務報表按照財政部頒布和修訂的《企業會計準則—基本準則》、各項具體會計準則、《資產管理產品相關會計處理規定》及其他相關規定(以下合稱“企業會計準則”)、中國證券投資基金業協會(以下簡稱“中國基金業協會”)頒布的《證券投資基金會計核算業務指引》、中國證監會發布的《證券投資基金信息披露 XBRL 範本第 3 號<年度報告和中期報告>》和中國證監會、中國基金業協會允許的如財務報表附注 7.4.4 所列示的基金行業實務操作的有關規定編製。

本財務報表以持續經營為基礎編製。

7.4.3 遵循企業會計準則及其他有關規定的聲明

本財務報表符合企業會計準則的要求，真實、完整地反映了本基金本報告期末的財務狀況以及本報告期間的經營成果和淨資產變動情況等有關信息。

7.4.4 重要會計政策和會計估計

7.4.4.1 會計年度

本基金會計年度為西曆 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 記帳基本貨幣

本基金的記帳基本貨幣為人民幣。

7.4.4.3 金融資產和金融負債的分類

I. 新金融工具準則(自 2022 年 1 月 1 日起適用)

金融工具，是指形成一方的金融資產並形成其他方的金融負債或權益工具的合同。當本基金成為金融工具合同的一方時，確認相關的金融資產或金融負債。

1、金融資產分類

本基金的金融資產於初始確認時分類為：以攤余成本計量的金融資產、以公允價值計量且其變動計入其他綜合收益的金融資產及以公允價值計量且其變動計入當期損益的金融資產。金融資產的分類取決於本基金管理金融資產的業務模式和金融資產的合同現金流量特徵。本基金現無金融資產分類為以公允價值計量且其變動計入其他綜合收益的金融資產。

(1) 債務工具

本基金持有的債務工具是指從發行方角度分析符合金融負債定義的工具，分別採用以下兩種方式進行計量：

以攤余成本計量：

本基金管理以攤余成本計量的金融資產的業務模式為以收取合同現金流量為目標，且以攤余成本計量的金融資產的合同現金流量特徵與基本借貸安排相一致，即在特定日期產生的現金流量，僅為對本金和以未償付本金金額為基礎的利息的支付。基金持有的以攤余成本計量的金融資產主要為銀行存款、買入返售金融資產和其他各類應收款項等。

以公允價值計量且其變動計入當期損益：

本基金將持有的未劃分為以攤余成本計量的債務工具劃分為以公允價值計量且其變動計入當期損益。基金持有的以公允價值計量且其變動計入當期損益的金融資產主要為債券投資、資產支持證券投資和基金投資，在資產負債表中以交易性金融資產列示。

(2) 權益工具

權益工具是指從發行方角度分析符合權益定義的工具。本基金將對其沒有控制、共同控制和重大影響的權益工具(主要為股票投資)按照公允價值計量且其變動計入當期損益，在資產負債表中列示為交易性金融資產。

2、金融負債的分類

本基金的金融負債於初始確認時分類為：以攤余成本計量的金融負債和以公允價值計量且其變動計入當期損益的金融負債。本基金目前暫無金融負債分類為以公允價值計量且其變動計入當期損益的金融負債。本基金持有的以攤余成本計量的金融負債包括賣出回購金融資產款和其他各類應付款項等。

3、衍生金融工具

本基金將持有的衍生金融工具以公允價值計量且其變動計入當期損益，在資產負債表中列示為衍生金融資產/負債。

II. 原金融工具準則(截至 2021 年 12 月 31 日前適用)

1、金融資產的分類

金融資產於初始確認時分類為：以公允價值計量且其變動計入當期損益的金融資產、應收款項、可供出售金融資產及持有至到期投資。金融資產的分類取決於本基金對金融資產的持有意圖和持有能力。本基金目前暫無金融資產分類為可供出售金融資產及持有至到期投資。

本基金目前持有的股票投資、債券投資、資產支持證券投資和衍生工具分類為以公允價值計量且其變動計入當期損益的金融資產。除衍生工具所產生的金融資產在資產負債表中以衍生金融資產列示外，以公允價值計量且其變動計入當期損益的金融資產在資產負債表中以交易性金融資產列示。

本基金持有的其他金融資產分類為應收款項，包括銀行存款、買入返售金融資產和各類應收款項等。應收款項是指在活躍市場中沒有報價、回收金額固定或可確定的非衍生金融資產。

2、金融負債的分類

金融負債於初始確認時分類為：以公允價值計量且其變動計入當期損益的金融負債及其他金融負債。以公允價值計量且其變動計入當期損益的金融負債包括交易性金融負債及衍生金融負債等。本基金持有的其他金融負債包括賣出回購金融資產款和各類應付款項等。

7.4.4.4 金融資產和金融負債的初始確認、後續計量和終止確認

I. 新金融工具準則(自 2022 年 1 月 1 日起適用)

本基金於成為金融工具合同的一方時確認一項金融資產或金融負債。

劃分為以公允價值計量且其變動計入當期損益的金融資產和金融負債，以及不作為有效套期工具的衍生工具，按照取得時的公允價值作為初始確認金額，相關的交易費用在發生時計入當期損益；對於支付的價款中包含的債券或資產支持證券起息日或上次除息日至購買日止的利息，確認為應計利息，包含在交易性金融資產的帳面價值中。

劃分為以攤余成本計量的金融資產和金融負債，按照取得時的公允價值作為初始確認金額，相關交易費用計入其初始確認金額。

對於以公允價值計量且其變動計入當期損益的金融資產，採用公允價值進行後續計量，其公允價值變動形成的利得或損失計入當期損益。

對於以攤余成本計量的金融資產，採用實際利率法確認利息收入，其終止確認、修改或減值產生的利得或損失，均計入當期損益。

本基金對以攤余成本計量的金融資產，以預期信用損失為基礎，進行減值處理並確認損失準備。

本基金考慮有關過去事項、當前狀況以及對未來經濟狀況的預測等合理且有依據的信息，以發生違約的風險為權重，計算合同應收的現金流量與預期能收到的現金流量之間差額的現值的概率加權金額，確認預期信用損失。

對於不含重大融資成分的應收款項，本基金運用簡化計量方法，按照相當於整個存續期內的預期信用損失金額計量損失準備。除上述採用簡化計量方法以外的金融資產，本基金在每個估值日評估其信用風險自初始確認後是否已經顯著增加，如果信用風險自初始確認後未顯著增加，處於第一階段，本基金按照相當於未來 12 個月內預期信用損失的金額計量損失準備，並按照帳面餘額和實際利率計算利息收入；如果信用風險自初始確認後已顯著增加但尚未發生信用減值的，處於第二階段，本基金按照相當於整個存續期內預期信用損失的金額計量損失準備，並按照帳面餘額和實際利率計算利息收入；如果初始確認後發生信用減值的，處於第三階段，本基金按照相當於整個存續期內預期信用損失的金額計量損失準備，並按照攤余成本和實際利率計算利息收入。

本基金在每個估值日評估相關金融工具的信用風險自初始確認後是否已顯著增加。本基金以單項金融工具或者具有相似信用風險特徵的金融工具組合為基礎，通過比較金融工具在估值日發生違約的風險與在初始確認日發生違約的風險，以確定金融工具預計存續期內發生違約風險的變化情況。當對金融資產預期未來現金流量具有不利影響的一項或多項事件發生時，該金融資產成為已發生信用減值的金融資產。當本基金不再合理預期能夠全部或部分收回金融資產合同現金流量時，本基金直接減記該金融資產的帳面餘額。

金融資產滿足下列條件之一的，予以終止確認：(1) 收取該金融資產現金流量的合同權利終止；(2) 該金融資產已轉移，且本基金將金融資產所有權上幾乎所有的風險和報酬轉移給轉入方；或者(3) 該金融資產已轉移，雖然本基金既沒有轉移也沒有保留金融資產所有權上幾乎所有的風險和報酬，但是放棄了對該金融資產控制。

金融資產終止確認時，其帳面價值與收到的對價的差額，計入當期損益。

當金融負債的現時義務全部或部分已經解除時，終止確認該金融負債或義務已解除的部分。終止確認部分的帳面價值與支付的對價之間的差額，計入當期損益。

II. 原金融工具準則(截至 2021 年 12 月 31 日前適用)

金融資產或金融負債于本基金成為金融工具合同的一方時，於交易日按公允價值在資產負債表內確認。以公允價值計量且其變動計入當期損益的金融資產，取得時發生的相關交易費用計入當期損益；支付的價款中包含已宣告但尚未發放的現金股利、債券或資產支持證券起息日或上次除息日至購買日止的利息，單獨確認為應收項目。應收款項和其他金融負債的相關交易費用計入初始確認金額。

以公允價值計量且其變動計入當期損益的金融資產及金融負債按照公允價值進行後續計量，應收款項和其他金融負債採用實際利率法，以攤余成本進行後續計量。

當收取某項金融資產現金流量的合同權利已終止或該金融資產所有權上幾乎所有的風險和報酬已轉移時，終止確認該金融資產。終止確認的金融資產的成本按移動加權平均法於交易日結轉。

7.4.4.5 金融資產和金融負債的估值原則

本基金持有的金融工具按如下原則確定公允價值並進行估值：

1、存在活躍市場的金融工具按其估值日的市場交易價格確定公允價值；估值日無交易且最近交易日後未發生影響公允價值計量的重大事件的，按最近交易日的市場交易價格確定公允價值。有充足證據表明估值日或最近交易日的市場交易價格不能真實反映公允價值的，應對市場交易價格進行調整，確定公允價值。與上述投資品種相同，但具有不同特徵的，應以相同資產或負債的公允價值為基礎，並在估值技術中考慮不同特徵因素的影響。特徵是指對資產出售或使用的限制等，如果該限制是針對資產持有者的，那麼在估值技術中不應將該限制作為特徵考慮。此外，基金管理人不應考慮因大量持有相關資產或負債所產生的溢價或折價。

2、當金融工具不存在活躍市場，採用在當前情況下適用並且有足夠可利用資料和其他信息支援的估值技術確定公允價值。採用估值技術時，優先使用可觀察輸入值，只有在無法取得相關資產或負債可觀察輸入值或取得不切實可行的情況下，才可以使用不可觀察輸入值。

3、如經濟環境發生重大變化或證券發行人發生影響金融工具價格的重大事件，應對估值進行調整並確定公允價值。

7.4.4.6 金融資產和金融負債的抵銷

本基金持有的資產和承擔的負債基本為金融資產和金融負債。當本基金依法有權抵銷債權債務且交易雙方準備按淨額結算時，金融資產與金融負債按抵銷後的淨額在資產負債表中列示。

7.4.4.7 實收基金

實收基金為對外發行基金份額所募集的總金額在扣除損益平准金分攤部分後的餘額。對於曾經實施份額拆分或折算的基金，由於基金份額拆分或折算引起的實收基金份額變動於基金份額拆分日或基金份額折算日根據拆分前或折算前的基金份額數及確定的拆分或折算比例計算認列。由於申購和贖回引起的實收基金變動分別於基金申購確認日及基金贖回確認日認列。對於已開放轉換業務的基金，上述申購和贖回分別包括基金轉換所引起的轉入基金的實收基金增加和轉出基金的實收基金減少。

7.4.4.8 損益平准金

損益平准金包括已實現平准金和未實現平准金。已實現平准金指在申購或贖回基金份額時，申

購或贖回款項中包含的按累計未分配的已實現損益佔淨資產比例計算的金額。未實現平准金指在申購或贖回基金份額時，申購或贖回款項中包含的按累計未實現損益佔淨資產比例計算的金額。損益平准金於基金申購確認日或基金贖回確認日認列，並於期末全額轉入未分配利潤/（累計虧損）。

7.4.4.9 收入/(損失)的確認和計量

I. 新金融工具準則(自 2022 年 1 月 1 日起適用)

境內基金投資在持有期間應取得的現金紅利於除息日確認為投資收益；境外基金投資在持有期間應取得的基金分紅收益扣除基金交易所在地適用的預繳所得稅後的淨額確認為投資收益。境內股票投資在持有期間應取得的現金股利扣除由上市公司代扣代繳的個人所得稅後的淨額確認為投資收益；境外股票投資在持有期間應取得的現金股利扣除股票交易所在地適用的預繳所得稅後的淨額確認為投資收益。境內債券投資和資產支持證券投資在持有期間應取得的按票面利率(對於貼現債為按發行價計算的利率)或合同利率計算的利息扣除在適用情況下由債券和資產支持證券發行企業代扣代繳的個人所得稅及由基金管理人繳納的增值稅後的淨額確認為投資收益。境外債券投資在持有期間應取得的按票面利率計算的利息扣除在交易所在地適用的預繳所得稅及由基金管理人繳納的增值稅後的淨額確認為投資收益。

以公允價值計量且其變動計入當期損益的金融資產在持有期間的公允價值變動確認為公允價值變動損益；處置時其公允價值與初始確認金額之間的差額扣除相關交易費用及在適用情況下由基金管理人繳納的增值稅後的淨額確認為投資收益，其中包括從公允價值變動損益結轉的公允價值累計變動額。

應收款項在持有期間確認的利息收入按實際利率法計算，實際利率法與直線法差異較小的按直線法近似計算。

II. 原金融工具準則(截至 2021 年 12 月 31 日前適用)

境內基金投資在持有期間應取得的現金紅利於除息日確認為投資收益；境外基金投資在持有期間應取得的基金分紅收益扣除基金交易所在地適用的預繳所得稅後的淨額確認為投資收益。境內股票投資在持有期間應取得的現金股利扣除由上市公司代扣代繳的個人所得稅後的淨額確認為投資收益；境外股票投資在持有期間應取得的現金股利扣除股票交易所在地適用的預繳所得稅後的淨額確認為投資收益。境內債券投資在持有期間應取得的按票面利率計算的利息扣除在適用情況下由債券發行企業代扣代繳的個人所得稅及由基金管理人繳納的增值稅後的淨額確認為利息收入。境外債券投資在持有期間應取得的按票面利率計算的利息扣除在交易所在地適用的預繳所得稅及由基金管理人繳納的增值稅後的淨額確認為利息收入。資產支持證券在持有期間收到的款項，根據資產支持證券的預計收益率或票面利率區分屬於資產支持證券投資本金部分和投資收益部分，將本金部分沖減資產

支持證券投資成本，並將投資收益部分扣除在適用情況下由基金管理人繳納的增值稅後的淨額確認為利息收入。

以公允價值計量且其變動計入當期損益的金融資產在持有期間的公允價值變動確認為公允價值變動損益；處置時其公允價值與初始確認金額之間的差額扣除在適用情況下由基金管理人繳納的增值稅後的淨額確認為投資收益，其中包括從公允價值變動損益結轉的公允價值累計變動額。

應收款項在持有期間確認的利息收入按實際利率法計算，實際利率法與直線法差異較小的按直線法近似計算。

7.4.4.10 費用的確認和計量

針對基金合同約定費率和計算方法的費用，本基金在費用涵蓋期間按合同約定進行確認。

其他以攤余成本計量的金融負債在持有期間確認的利息支出按實際利率法計算，實際利率法與直線法差異較小的按直線法近似計算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份額享有同等分配權。本基金收益以現金形式分配，但基金份額持有人可選擇現金紅利或將現金紅利按分紅權益再投資日的基金份額淨值自動轉為基金份額進行再投資。期末可供分配利潤指期末資產負債表中未分配利潤與未分配利潤中已實現收益的孰低數。

經宣告的擬分配基金收益於分紅除權日從淨資產轉出。

7.4.4.12 其他重要的會計政策和會計估計

根據本基金的估值原則和中國證監會允許的基金行業估值實務操作，本基金確定以下類別股票投資和債券投資的公允價值時採用的估值方法及其關鍵假設如下：

1、對於證券交易所上市的股票，若出現重大事項停牌或交易不活躍(包括漲跌停時的交易不活躍)等情況，本基金根據中國證監會公告[2017]13 號《中國證監會關於證券投資基金估值業務的指導意見》，根據具體情況採用《關於發布中基協(AMAC)基金行業股票估值指數的通知》提供的指數收益法、市盈率法、現金流量折現法等估值技術進行估值。

2、對於在鎖定期內的非公開發行股票、首次公開發行股票時公司股東公開發售股份、通過大宗交易取得的帶限售期的股票等流通受限股票，根據中國基金業協會中基協發[2017]6 號《關於發布〈證券投資基金投資流通受限股票估值指引(試行)〉的通知》之附件《證券投資基金投資流通受限股票估值指引(試行)》進行估值。

3、對於在證券交易所上市或掛牌轉讓的固定收益品種(可轉換債券除外)及在銀行間同業市場交易的固定收益品種，根據中國證監會公告[2017]13 號《中國證監會關於證券投資基金估值業務的指導意見》及《中國證券投資基金業協會估值核算工作小組關於 2015 年 1 季度固定收益品種的估值處

理標準》採用估值技術確定公允價值。本基金持有的證券交易所上市或掛牌轉讓的固定收益品種(可轉換債券除外)，按照中證指數有限公司所獨立提供的估值結果確定公允價值。本基金持有的銀行間同業市場交易的固定收益品種，按照中債金融估值中心有限公司所獨立提供的估值結果確定公允價值。

7.4.5 會計政策和會計估計變更以及差錯更正的說明

7.4.5.1 會計政策變更的說明

根據《企業會計準則第 22 號——金融工具確認和計量》、《企業會計準則第 23 號——金融資產轉移》、《企業會計準則第 24 號——套期會計》、《企業會計準則第 37 號——金融工具列報》(統稱“新金融工具準則”)、《關於進一步貫徹落實新金融工具相關會計準則的通知》、《關於印發《資產管理產品相關會計處理規定》的通知》(財會[2022]14 號)的規定和相關法律法規的要求，本基金自 2022 年 1 月 1 日起執行新金融工具準則。根據銜接規定，對可比期間信息不予調整，首日執行新金融工具準則的累積影響數調整本報告期期初未分配利潤。

新金融工具準則改變了金融資產的分類和計量方式，將金融工具分類為以攤余成本計量的金融資產、以公允價值計量且其變動計入其他綜合收益的金融資產及以公允價值計量且其變動計入當期損益的金融資產。本基金考慮自身業務模式，以及金融資產的合同現金流特徵進行上述分類。於 2021 年 12 月 31 日及 2022 年 1 月 1 日，本基金均沒有指定為以公允價值計量且其變動計入當期損益的金融資產。

新金融工具準則要求對於以攤余成本計量的金融資產，以預期信用損失為基礎確認損失準備。本基金考慮有關過去事項、當前狀況以及對未來經濟狀況的預測等合理且有依據的信息，以發生違約的風險為權重，計算合同應收的現金流量與預期能收到的現金流量之間差額的現值的概率加權金額，確認預期信用損失。

於 2021 年 12 月 31 日，銀行存款、結算備付金、存出保證金、買入返售金融資產、交易性金融資產、賣出回購金融資產款等對應的應計利息餘額均列示在“應收利息”或“應付利息”科目中。於 2022 年 1 月 1 日，根據新金融工具準則下的計量類別，將上述應計利息分別轉入銀行存款、結算備付金、存出保證金、交易性金融資產、買入返售金融資產、賣出回購金融資產款等科目項下列示，同時以攤余成本法計量的金融資產按照預期信用損失為基準，計提損失準備 0.00 元，對本基金期初未分配利潤無影響。

於 2022 年 1 月 1 日，本財務報表中金融資產和金融負債按照原金融工具準則和新金融工具準則的規定進行分類和計量的結果如下：

原金融工具準則下以攤余成本計量的金融資產為銀行存款、結算備付金、存出保證金、買入返

售金融資產、應收利息、應收證券清算款和應收申購款，金額分別為 1,832,783,286.85 元、5,273,357.61 元、1,058,893.45 元、491,421,327.71 元、71,289,794.98 元、72,384.29 元和 4,901,264.41 元。新金融工具準則下以攤余成本計量的金融資產為銀行存款、結算備付金、存出保證金、買入返售金融資產、其他資產-應收利息、應收清算款和應收申購款，金額分別為 1,832,993,840.58 元、5,275,967.91 元、1,059,417.60 元、491,530,122.94 元、0.00 元、72,384.29 元和 4,901,264.41 元。

原金融工具準則下以公允價值計量且其變動計入當期損益計量的金融資產為交易性金融資產，金額為 11,489,848,081.34 元。新金融工具準則下以公允價值計量且其變動計入當期損益計量的金融資產為交易性金融資產，金額為 11,560,815,392.91 元。

原金融工具準則下以攤余成本計量的金融負債為應付贖回款、應付管理人報酬、應付託管費、應付交易費用和其他負債-其他應付款，金額分別為 15,342,643.97 元、17,940,723.86 元、2,990,120.65 元、18,874,402.37 元和 657,627.01 元。新金融工具準則下以攤余成本計量的金融負債為應付贖回款、應付管理人報酬、應付託管費、其他負債-應付交易費用和其他負債-其他應付款，金額分別為 15,342,643.97 元、17,940,723.86 元、2,990,120.65 元、18,874,402.37 元和 657,627.01 元。

7.4.5.2 會計估計變更的說明

本基金本報告期無會計估計變更。

7.4.5.3 差錯更正的說明

本基金本報告期無重大會計差錯的內容和更正金額。

7.4.6 稅項

根據財稅[2004]78 號《關於證券投資基金稅收政策的通知》、財稅[2005]103 號《關於股權分置試點改革有關稅收政策問題的通知》、財稅[2008]1 號《關於企業所得稅若干優惠政策的通知》、財稅[2012]85 號《關於實施上市公司股息紅利差別化個人所得稅政策有關問題的通知》、財稅[2014]81 號《關於滬港股票市場交易互聯互通機制試點有關稅收政策的通知》、財稅[2015]101 號《關於上市公司股息紅利差別化個人所得稅政策有關問題的通知》、財稅[2015]125 號《財政部、國家稅務總局、證監會關於內地與香港基金互認有關稅收政策的通知》、財稅[2016]36 號《關於全面推開營業稅改征增值稅試點的通知》、財稅[2016]46 號《財政部、國家稅務總局關於進一步明確全面推開營改增試點金融業有關政策的通知》、財稅[2016]70 號《財政部、國家稅務總局關於金融機構同業往來等增值稅政策的補充通知》、財稅[2016]127 號《財政部國家稅務總局證監會關於深港股票市場交易互聯互通機制試點有關稅收政策的通知》、財稅[2016]140 號《關於明確金融房地產開發 教育輔助服務等增值稅政策的通知》、財稅[2017]2 號《關於資管產品增值稅政策有關問題的補充通知》、財稅[2017]56 號《關於資管產品增值稅有關問題的通知》、財稅[2017]90 號《關於租入固定資產進項稅額

抵扣等增值稅政策的通知》及其他相關財稅法規和實務操作，主要稅項列示如下：

- (1) 以發行基金方式募集資金不屬於增值稅徵收範圍，不徵收增值稅。
- (2) 資管產品運營過程中發生的增值稅應稅行為，以資管產品管理人為增值稅納稅人。資管產品管理人運營資管產品過程中發生的增值稅應稅行為，暫適用簡易計稅方法，按照 3% 的徵收率繳納增值稅。
- (3) 基金買賣股票、債券的差價收入免征增值稅，暫不徵收企業所得稅。
- (4) 存款利息收入不徵收增值稅。
- (5) 國債、地方政府債利息收入，金融同業往來利息收入免征增值稅。
- (6) 對基金取得的債券的利息收入及其他收入，暫不徵收企業所得稅。
- (7) 基金作為流通股股東在股權分置改革過程中收到由非流通股股東支付的股份、現金等對價暫免徵收印花稅、企業所得稅和個人所得稅。
- (8) 對基金在境內取得的股票的股息、紅利收入，由上市公司在向基金派發股息、紅利收入時代扣代繳 20% 的個人所得稅，暫不徵收企業所得稅。基金在境內從上市公司分配取得的股息紅利所得，持股期限在 1 個月以內（含 1 個月）的，全額計入應納稅所得額，持股期限在 1 個月以上至 1 年（含 1 年）的，減按 50% 計入應納稅所得額，持股期限超過 1 年的，暫免徵收個人所得稅。對基金通過滬港通/深港通投資香港聯交所上市 H 股取得的股息紅利，H 股公司應向中國證券登記結算有限責任公司（以下簡稱“中國結算”）提出申請，由中國結算向 H 股公司提供內地個人投資者名冊，H 股公司按照 20% 的稅率代扣個人所得稅。基金通過滬港通/深港通投資香港聯交所上市的非 H 股取得的股息紅利，由中國結算按照 20% 的稅率代扣個人所得稅。對香港市場投資者取得的股息、紅利收入按照 10% 的稅率代扣所得稅。
- (9) 基金在境內賣出股票按 0.1% 的稅率繳納股票交易印花稅，買入股票不徵收股票交易印花稅。基金通過滬港通/深港通買賣、繼承、贈與聯交所上市股票，按照香港特別行政區現行稅法規 定繳納印花稅。
- (10) 基金在境外證券交易所進行交易或取得的源自境外證券市場的收益，其涉及的稅收政策，按照相關國家或地區稅收法律和法規執行。
- (11) 本基金分別按實際繳納的增值稅額的 7%、3%、2% 繳納城市維護建設稅、教育費附加和 地方教育費附加。

7.4.7 重要財務報表項目的說明

7.4.7.1 銀行存款

單位：人民幣元

項目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
活期存款	914,596,828.63	1,832,783,286.85
等於：本金	914,516,025.49	1,832,783,286.85
加：應計利息	80,803.14	-
定期存款	-	-
等於：本金	-	-
加：應計利息	-	-
其中：存款期限 1 個月以內	-	-
存款期限 1-3 個月	-	-
存款期限 3 個月以上	-	-
其他存款	-	-
等於：本金	-	-
加：應計利息	-	-
合計	914,596,828.63	1,832,783,286.85

7.4.7.2 交易性金融資產

單位：人民幣元

項目		本期末 2022 年 12 月 31 日			
		成本	應計利息	公允價值	公允價值變動
股票		7,436,278,533.14	-	7,608,788,411.38	172,509,878.24
貴金屬投資- 金交所黃金 合約		-	-	-	-
債券	交易所市場	1,053,109,322.96	9,207,107.85	1,058,710,499.85	-3,605,930.96
	銀行間市場	2,456,484,776.64	20,830,078.69	2,473,645,078.69	-3,669,776.64
	合計	3,509,594,099.60	30,037,186.54	3,532,355,578.54	-7,275,707.60
資產支持證券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合計		10,945,872,632.74	30,037,186.54	11,141,143,989.92	165,234,170.64
項目		上年度末 2021 年 12 月 31 日			
		成本	應計利息	公允價值	公允價值變動
股票		6,038,058,870.56	-	7,312,148,813.18	1,274,089,942.62
貴金屬投資- 金交所黃金 合約		-	-	-	-
債	交易	800.00	-	1,268.16	468.16

券	所 市 場				
	銀 行 間 市 場	4,172,796,534.49	-	4,177,698,000.00	4,901,465.51
	合計	4,172,797,334.49	-	4,177,699,268.16	4,901,933.67
資產支持證券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合計		10,210,856,205.05	-	11,489,848,081.34	1,278,991,876.29

7.4.7.3 衍生金融資產/負債

7.4.7.3.1 衍生金融資產/負債期末餘額

無。

7.4.7.4 買入返售金融資產

7.4.7.4.1 各項買入返售金融資產期末餘額

單位：人民幣元

項目	本期末 2022 年 12 月 31 日	
	帳面餘額	其中：買斷式逆回購
交易所市場	-	-
銀行間市場	-	-
合計	-	-
項目	上年度末 2021 年 12 月 31 日	
	帳面餘額	其中：買斷式逆回購
交易所市場	-	-
銀行間市場	491,421,327.71	-
合計	491,421,327.71	-

7.4.7.4.2 期末買斷式逆回購交易中取得的債券

無。

7.4.7.5 其他資產

單位：人民幣元

項目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
應收利息	-	71,289,794.98
其他應收款	-	-
待攤費用	-	-
合計	-	71,289,794.98

7.4.7.6 其他負債

單位：人民幣元

項目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
應付券商交易單元保證金	500,000.00	500,000.00
應付贖回費	21,545.94	57,627.01
應付證券出借違約金	-	-
應付交易費用	14,699,708.94	18,874,402.37
其中：交易所市場	14,657,063.90	18,847,218.81
銀行間市場	42,645.04	27,183.56
應付利息	-	-
預提費用	220,000.00	100,000.00
合計	15,441,254.88	19,532,029.38

7.4.7.7 實收基金

金額單位：人民幣元

項目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	
	基金份額（份）	帳面金額
上年度末	9,444,816,091.35	9,444,816,091.35
本期申購	1,001,307,670.86	1,001,307,670.86
本期贖回（以“-”號填列）	-1,342,209,394.67	-1,342,209,394.67
本期末	9,103,914,367.54	9,103,914,367.54

7.4.7.8 未分配利潤

單位：人民幣元

項目	已實現部分	未實現部分	未分配利潤合計
上年度末	125,100,145.20	4,270,847,908.47	4,395,948,053.67
本期利潤	-189,310,228.11	-1,113,757,705.65	-1,303,067,933.76
本期基金份額交易產生的變動數	3,969,405.83	-122,330,039.84	-118,360,634.01
其中：基金申購款	-7,877,104.13	367,594,953.34	359,717,849.21
基金贖回款	11,846,509.96	-489,924,993.18	-478,078,483.22
本期已分配利潤	-141,289,463.77	-	-141,289,463.77
本期末	-201,530,140.85	3,034,760,162.98	2,833,230,022.13

7.4.7.9 存款利息收入

單位：人民幣元

項目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期間 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	4,025,539.87	6,263,003.32
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
結算備付金利息收入	75,305.06	103,391.25
其他	16,463.63	15,615.97
合計	4,117,308.56	6,382,010.54

7.4.7.10 股票投資收益

單位：人民幣元

項目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期間 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
賣出股票成交總額	6,425,866,477.15	8,194,057,239.16
減：賣出股票成本總額	6,655,571,880.61	5,218,089,252.36
減：交易費用	19,744,503.18	-
買賣股票差價收入	-249,449,906.64	2,975,967,986.80

7.4.7.11 債券投資收益

7.4.7.11.1 債券投資收益項目構成

單位：人民幣元

項目	本期 2022年1月1日至2022年12月31 日	上年度可比期間 2021年1月1日至2021年12月31 日
債券投資收益——利息收入	136,657,386.74	-
債券投資收益——買賣債券 （債轉股及債券到期兌付）差 價收入	3,907,815.54	-282,832.66
債券投資收益——贖回差價收 入	-	-
債券投資收益——申購差價收 入	-	-
合計	140,565,202.28	-282,832.66

7.4.7.11.2 債券投資收益——買賣債券差價收入

單位：人民幣元

項目	本期 2022年1月1日至2022年12月31 日	上年度可比期間 2021年1月1日至2021年12月31 日
賣出債券（債轉股及債券到期 兌付）成交總額	14,550,231,266.28	7,794,016,821.28
減：賣出債券（債轉股及債券 到期兌付）成本總額	14,412,815,044.34	7,686,375,331.38
減：應計利息總額	133,391,492.54	107,924,322.56
減：交易費用	116,913.86	-
買賣債券差價收入	3,907,815.54	-282,832.66

7.4.7.12 資產支持證券投資收益

無。

7.4.7.13 衍生工具收益

7.4.7.13.1 衍生工具收益——買賣權證差價收入

無。

7.4.7.13.2 衍生工具收益——其他投資收益

無。

7.4.7.14 股利收益

單位：人民幣元

項目	本期 2022年1月1日至2022年12月31 日	上年度可比期間 2021年1月1日至2021年12月31 日
股票投資產生的股利收益	132,186,732.43	77,351,705.27
其中：證券出借權益補償收入	-	-
基金投資產生的股利收益	-	-
合計	132,186,732.43	77,351,705.27

7.4.7.15 公允價值變動收益

單位：人民幣元

項目名稱	本期 2022年1月1日至2022年12月31 日	上年度可比期間 2021年1月1日至2021年12月31 日
1.交易性金融資產	-1,113,757,705.65	-5,143,423,480.33
——股票投資	-1,101,580,064.38	-5,146,634,327.71
——債券投資	-12,177,641.27	3,210,847.38
——資產支持證券投資	-	-
——基金投資	-	-
——貴金屬投資	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	-	-
——權證投資	-	-
3.其他	-	-
減：應稅金融商品公允價值變動產生的預估增值稅	-	-
合計	-1,113,757,705.65	-5,143,423,480.33

7.4.7.16 其他收入

單位：人民幣元

項目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期間 2021年1月1日至2021年12月31日
基金贖回費收入	2,371,728.42	7,639,602.86
合計	2,371,728.42	7,639,602.86

7.4.7.17 信用減值損失

無。

7.4.7.18 其他費用

單位：人民幣元

項目	本期 2022年1月1日至2022年12月31 日	上年度可比期間 2021年1月1日至2021年12月31 日
----	---------------------------------	--------------------------------------

審計費用	100,000.00	100,000.00
信息披露費	120,000.00	120,000.00
證券出借違約金	-	-
銀行費用	41,293.67	53,737.28
銀行間帳戶維護費	36,000.00	36,000.00
其他	1,200.00	23,028,025.70
合計	298,493.67	23,337,762.98

7.4.8 或有事項、資產負債表日後事項的說明

7.4.8.1 或有事項

截至資產負債表日，本基金無或有事項。

7.4.8.2 資產負債表日後事項

截至財務報表批准日，本基金無資產負債表日後事項。

7.4.9 關聯方關係

關聯方名稱	與本基金的關係
華夏基金管理有限公司	基金管理人
中國銀行股份有限公司（“中國銀行”）	基金託管人
中信證券股份有限公司（“中信證券”）	基金管理人的股東
POWER CORPORATION OF CANADA	基金管理人的股東
MACKENZIE FINANCIAL CORPORATION	基金管理人的股東
天津海鵬科技諮詢有限公司	基金管理人的股東

注：①根據華夏基金管理有限公司於 2023 年 1 月 6 日發布的公告，華夏基金管理有限公司股權結構變更為中信證券（出資比例 62.2%）、MACKENZIE FINANCIAL CORPORATION（出資比例 27.8%）、天津海鵬科技諮詢有限公司（出資比例 10%）。

②下述關聯交易均在正常業務範圍內按一般商業條款訂立。

7.4.10 本報告期及上年度可比期間的關聯方交易

7.4.10.1 通過關聯方交易單元進行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金額單位：人民幣元

關聯方名稱	本期 2022年1月1日至2022年12月31日		上年度可比期間 2021年1月1日至2021年12月31日	
	成交金額	佔當期股票成交總額的比例	成交金額	佔當期股票成交總額的比例
中信證券	3,340,546,564.57	23.36%	813,538,226.83	5.17%

7.4.10.1.2 債券交易

金額單位：人民幣元

關聯方名稱	本期 2022年1月1日至2022年12月31日		上年度可比期間 2021年1月1日至2021年12月31日	
	成交金額	佔當期債	成交金額	佔當期債

		券成交總額的比例		券成交總額的比例
中信證券	472,311,316.86	82.51%	338,896.70	5.43%

7.4.10.1.3 債券回購交易

無。

7.4.10.1.4 應支付關聯方的佣金

金額單位：人民幣元

關聯方名稱	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日			
	當期佣金	佔當期佣金總量的比例	期末應付佣金餘額	佔期末應付佣金總額的比例
中信證券	3,111,056.26	26.00%	900,477.82	6.14%
關聯方名稱	上年度可比期間 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日			
	當期佣金	佔當期佣金總量的比例	期末應付佣金餘額	佔期末應付佣金總額的比例
中信證券	757,641.92	5.71%	-	-

注：上述佣金按市場佣金率計算，以扣除由中國證券登記結算有限責任公司收取證管費、經手費和由券商承擔的證券結算風險基金後的淨額列示。

該類佣金協議的服務範圍還包括佣金收取方為本基金提供的證券投資研究成果和市場訊息服務。

7.4.10.2 關聯方報酬

7.4.10.2.1 基金管理費

單位：人民幣元

項目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期間 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
當期發生的基金應支付的管理費	189,158,010.61	231,963,881.65
其中：支付銷售機構的客戶維護費	45,681,967.64	56,629,747.09

注：①支付基金管理人的基金管理人報酬按前一日基金資產淨值 1.50% 的年費率計提，逐日累計至每月月底，按月支付。

② 基金管理人報酬計算公式為：日基金管理人報酬＝前一日基金資產淨值×1.50%/當年天數。

③客戶維護費是指基金管理人與基金銷售機構約定的用以向基金銷售機構支付客戶服務及銷售活動中產生的相關費用，該費用按照代銷機構所代銷基金的份額保有量作為基數進行計算，從基金管理人收取的基金管理費中列支，不屬於從基金資產中列支的費用項目。

7.4.10.2.2 基金託管費

單位：人民幣元

項目	本期	上年度可比期間
----	----	---------

	2022年1月1日至2022年12月31日	2021年1月1日至2021年12月31日
當期發生的基金應支付的託管費	31,526,335.19	38,660,646.86

注：①支付基金託管人的基金託管費按前一日基金資產淨值 0.25% 的年費率計提，逐日累計至每月月底，按月支付。

②基金託管費計算公式為：日基金託管費＝前一日基金資產淨值×0.25%/當年天數。

7.4.10.3 與關聯方進行銀行間同業市場的債券(含回購)交易

無。

7.4.10.4 報告期內轉融通證券出借業務發生重大關聯交易事項的說明

7.4.10.4.1 與關聯方通過約定申報方式進行的適用固定期限費率的證券出借業務的情況

無。

7.4.10.4.2 與關聯方通過約定申報方式進行的適用市場化期限費率的證券出借業務的情況

無。

7.4.10.5 各關聯方投資本基金的情況

7.4.10.5.1 報告期內基金管理人運用固有資金投資本基金的情況

無。

7.4.10.5.2 報告期末除基金管理人之外的其他關聯方投資本基金的情況

無。

7.4.10.6 由關聯方保管的銀行存款餘額及當期產生的利息收入

單位：人民幣元

關聯方名稱	本期 2022年1月1日至2022年12月31日		上年度可比期間 2021年1月1日至2021年12月31日	
	期末餘額	當期利息收入	期末餘額	當期利息收入
中國銀行活期存款	914,596,828.63	4,025,539.87	1,832,783,286.85	6,263,003.32

注：本基金的活期銀行存款由基金託管人中國銀行保管，按銀行同業利率或約定利率計息。

7.4.10.7 本基金在承銷期內參與關聯方承銷證券的情況

金額單位：人民幣元

本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日					
關聯方名稱	證券代碼	證券名稱	發行方式	基金在承銷期內買入	
				數量（單位：股/張）	總金額
中信證券	688041	海光信息	新股發行	70,208	2,527,488.00
中信證券	600938	中國海油	新股發行	120,005	1,296,054.00
中信證券	688223	晶科能源	新股發行	213,000	1,065,000.00
中信證券	688326	經緯恒潤	新股發行	6,832	826,672.00

中信證券	688271	聯影醫療	新股發行	7,365	809,266.20
中信證券	688382	益方生物	新股發行	36,208	656,088.96
中信證券	301200	大族數控	新股發行	8,566	655,812.96
中信證券	688302	海創藥業	新股發行	13,082	561,479.44
中信證券	688114	華大智造	新股發行	5,336	465,192.48
中信證券	688061	燦瑞科技	新股發行	3,972	447,604.68
中信證券	301109	軍信股份	新股發行	12,250	426,422.50
中信證券	688380	中微半導	新股發行	12,677	391,212.22
中信證券	301269	華大九天	新股發行	11,677	381,721.13
中信證券	688141	傑華特	新股發行	9,946	380,533.96
中信證券	301165	銳捷網絡	新股發行	10,769	348,700.22
中信證券	301349	信德新材	新股發行	1,798	249,706.24
中信證券	301302	華如科技	新股發行	4,651	241,991.53
中信證券	301335	天元寵物	新股發行	4,192	209,516.16
中信證券	688432	有研矽	新股發行	20,044	198,636.04
中信證券	688370	叢麟科技	新股發行	3,254	194,459.04
中信證券	688426	康為世紀	新股發行	3,776	184,948.48
中信證券	301171	易點天下	新股發行	9,845	178,982.10
中信證券	301377	鼎泰高科	新股發行	7,695	176,061.60
中信證券	688150	萊特光電	新股發行	5,626	124,053.30
中信證券	688252	天德鈺	新股發行	5,201	112,757.68
中信證券	301230	泓博醫藥	新股發行	2,687	107,480.00
中信證券	688290	景業智能	新股發行	3,040	103,025.60
中信證券	688525	佰維存儲	新股發行	4,614	64,549.86
中信證券	603235	天新藥業	新股發行	572	21,095.36
中信證券	001322	箭牌家居	新股發行	1,595	20,224.60
中信證券	001330	博納影業	新股發行	3,564	17,926.92
中信證券	603132	金徽股份	新股發行	1,342	14,493.60
中信證券	001339	智微智能	新股發行	812	13,690.32
中信證券	603191	望變電氣	新股發行	1,149	13,627.14
中信證券	603209	興通股份	新股發行	595	12,804.40
中信證券	603151	邦基科技	新股發行	535	9,603.25
中信證券	001266	宏英智慧	新股發行	247	9,536.67
中信證券	603215	比依股份	新股發行	575	7,187.50
中信證券	603051	鹿山新材	新股發行	272	7,014.88
上年度可比期間 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日					
關聯方名稱	證券代碼	證券名稱	發行方式	基金在承銷期內買入	
				數量（單位：股/張）	總金額
中信證券	688235	百濟神州	新股發行	19,217	3,701,194.20
中信證券	688819	天能股份	新股發行	28,382	1,186,083.78
中信證券	688739	成大生物	新股發行	9,882	1,087,020.00
中信證券	688187	時代電氣	新股發行	33,865	1,062,683.70
中信證券	688176	亞虹醫藥	新股發行	37,990	873,010.20
中信證券	688192	迪哲醫藥	新股發行	8,926	469,329.08
中信證券	688211	中科微至	新股發行	4,501	405,990.20
中信證券	688660	電氣風電	新股發行	51,238	278,734.72
中信證券	688798	艾為電子	新股發行	3,592	275,075.36
中信證券	688779	長遠鋰科	新股發行	43,086	243,435.90

中信證券	601728	中國電信	新股發行	31,000	140,430.00
中信證券	601825	滬農商行	新股發行	15,480	137,772.00
中信證券	688670	金迪克	新股發行	2,310	127,465.80
中信證券	688276	百克生物	新股發行	3,486	126,716.10
中信證券	600905	三峽能源	新股發行	33,000	87,450.00
中信證券	688212	澳華內鏡	新股發行	3,496	78,660.00
中信證券	688776	國光電氣	新股發行	1,447	74,433.68
中信證券	688575	亞輝龍	新股發行	3,435	50,838.00
中信證券	300982	蘇文電能	新股發行	3,170	50,181.10
中信證券	600955	維遠股份	新股發行	1,694	50,074.64
中信證券	300993	玉馬遮陽	新股發行	4,097	49,573.70
中信證券	688315	諾禾致源	新股發行	3,711	47,352.36
中信證券	300997	歡樂家	新股發行	9,279	45,838.26
中信證券	688607	康眾醫療	新股發行	1,890	43,866.90
中信證券	300930	屹通新材	新股發行	3,220	42,214.20
中信證券	301028	東亞機械	新股發行	7,329	38,916.99
中信證券	301049	超越科技	新股發行	1,954	37,790.36
中信證券	688509	正元地信	新股發行	15,433	30,403.01
中信證券	603529	愛瑪科技	新股發行	1,019	28,389.34
中信證券	688690	納微科技	新股發行	3,477	28,059.39
中信證券	603071	物產環能	新股發行	1,627	25,088.34
中信證券	301055	張小泉	新股發行	3,541	24,432.90
中信證券	300966	共同藥業	新股發行	2,858	23,549.92
中信證券	688565	力源科技	新股發行	2,464	23,136.96
中信證券	605555	德昌股份	新股發行	655	21,189.25
中信證券	301059	金三江	新股發行	2,581	20,880.29
中信證券	600935	華塑股份	新股發行	4,811	18,955.34
中信證券	301053	遠信工業	新股發行	1,544	18,327.28
中信證券	301062	上海艾錄	新股發行	5,225	17,294.75
中信證券	688226	威騰電氣	新股發行	2,693	17,289.06
中信證券	600916	中國黃金	新股發行	3,371	16,821.29
中信證券	688305	科德數控	新股發行	1,496	16,500.88
中信證券	688071	華依科技	新股發行	1,101	15,116.73
中信證券	605566	福萊萸特	新股發行	435	14,011.35
中信證券	605060	聯德股份	新股發行	883	13,765.97
中信證券	605599	萊百股份	新股發行	980	9,800.00
中信證券	605488	福萊新材	新股發行	416	8,498.88
中信證券	605138	盛泰集團	新股發行	723	7,208.31
中信證券	001208	華菱線纜	新股發行	1,754	6,437.18
中信證券	605020	永和股份	新股發行	850	5,890.50
中信證券	003040	楚天龍	新股發行	1,101	5,086.62
中信證券	001219	青島食品	新股發行	272	4,678.40
中信證券	601279	英利汽車	新股發行	2,004	4,148.28

7.4.10.8 其他關聯交易事項的說明

7.4.10.8.1 其他關聯交易事項的說明

無。

7.4.11 利潤分配情況

單位：人民幣元

序號	權益登記日	除息日		每 10 份基金份額分紅數	現金形式發放總額	再投資形式發放總額	利潤分配合計	備註
		場內	場外					
1	2022-01-13	-	2022-01-13	0.150	46,528,460.13	94,761,003.64	141,289,463.77	-
合計				0.150	46,528,460.13	94,761,003.64	141,289,463.77	-

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

7.4.12.1 因認購新發/增發證券而於期末持有的流通受限證券

金額單位：人民幣元

7.4.12.1.1 受限證券類別：股票										
證券代碼	證券名稱	成功認購日	受限期	流通受限類型	認購價格	期末估值單價	數量(單位：股)	期末成本總額	期末估值總額	備註
002436	興森科技	2022-09-05	6 個月	非公開發行流通受限	9.92	9.31	8,064,516	79,999,998.72	75,080,643.96	-
000893	亞鉀國際	2022-08-16	6 個月	非公開發行流通受限	31.65	26.58	1,579,779	50,000,005.35	41,990,525.82	-
688506	百利天恒	2022-12-28	1 個月內(含)	新發流通受限	24.70	24.70	15,622	385,863.40	385,863.40	-
688061	燦	2022-	6 個月	新	112.69	87.17	3,972	447,604.68	346,239.24	-

	瑞科技	10-11		發流通受限						
688380	中微半導	2022-07-29	6 個月	新發流通受限	30.86	26.44	12,677	391,212.22	335,179.88	-
688351	微電生理	2022-08-23	6 個月	新發流通受限	16.51	24.76	10,946	180,718.46	271,022.96	-
688084	晶品特裝	2022-12-01	6 個月	新發流通受限	60.98	74.73	1,875	114,337.50	140,118.75	-
301269	華大九天	2022-07-21	6 個月	新發流通受限	32.69	87.94	1,168	38,181.92	102,713.92	-
688203	海正生材	2022-08-09	6 個月	新發流通受限	16.68	15.09	5,761	96,093.48	86,933.49	-
688416	恒燦股份	2022-08-22	6 個月	新發流通受限	65.11	37.01	2,147	139,791.17	79,460.47	-
301267	華廈眼科	2022-10-26	6 個月	新發流通受限	50.88	66.20	1,006	51,185.28	66,597.20	-
688292	浩瀚深度	2022-08-09	6 個月	新發流通	16.56	14.67	4,503	74,569.68	66,059.01	-

				受 限						
301095	廣 立 微	2022- 07-28	6 個月	新 發 流 通 受 限	58.00	86.49	740	42,920.00	64,002.60	-
301308	江 波 龍	2022- 07-27	6 個月	新 發 流 通 受 限	55.67	56.72	819	45,593.73	46,453.68	-
301327	華 寶 新 能	2022- 09-08	6 個月	新 發 流 通 受 限	237.50	176.97	242	57,475.00	42,826.74	-
301165	銳 捷 網 絡	2022- 11-14	6 個月	新 發 流 通 受 限	32.38	31.61	1,077	34,873.26	34,043.97	-
301356	天 振 股 份	2022- 11-03	6 個月	新 發 流 通 受 限	63.00	43.33	614	38,682.00	26,604.62	-
301195	北 路 智 控	2022- 07-25	6 個月	新 發 流 通 受 限	71.17	73.04	330	23,486.10	24,103.20	-
301330	熵 基 科 技	2022- 08-10	6 個月	新 發 流 通 受 限	43.32	31.31	694	30,064.08	21,729.14	-
301152	天 力 鋰 能	2022- 08-19	6 個月	新 發 流 通 受 限	57.00	46.64	433	24,681.00	20,195.12	-
301391	卡	2022-	6 個月	新	96.00	80.97	247	23,712.00	19,999.59	-

	萊特	11-24		發 流 通 受 限						
301349	信 德 新 材	2022- 08-30	6 個月	新 發 流 通 受 限	138.88	103.52	180	24,998.40	18,633.60	-
301171	易 點 天 下	2022- 08-10	6 個月	新 發 流 通 受 限	18.18	17.72	985	17,907.30	17,454.20	-
301363	美 好 醫 療	2022- 09-28	6 個月	新 發 流 通 受 限	30.66	37.85	445	13,643.70	16,843.25	-
301115	建 科 股 份	2022- 08-23	6 個月	新 發 流 通 受 限	42.05	24.04	685	28,804.25	16,467.40	-
301223	中 榮 股 份	2022- 10-13	6 個月	新 發 流 通 受 限	26.28	18.13	815	21,418.20	14,775.95	-
301328	維 峰 電 子	2022- 08-30	6 個月	新 發 流 通 受 限	78.80	76.96	191	15,050.80	14,699.36	-
301121	紫 建 電 子	2022- 08-01	6 個月	新 發 流 通 受 限	61.07	49.77	290	17,710.30	14,433.30	-
301139	元 道 通 信	2022- 06-30	6 個月	新 發 流 通	38.46	25.31	566	21,768.36	14,325.46	-

				受 限						
301335	天元 寵物	2022- 11-11	6 個月	新 發 流 通 受 限	49.98	33.82	420	20,991.60	14,204.40	-
301377	鼎泰 高科	2022- 11-11	6 個月	新 發 流 通 受 限	22.88	17.63	770	17,617.60	13,575.10	-
301230	泓博 醫藥	2022- 10-21	6 個月	新 發 流 通 受 限	40.00	48.32	269	10,760.00	12,998.08	-
301396	宏景 科技	2022- 11-04	6 個月	新 發 流 通 受 限	40.13	31.90	396	15,891.48	12,632.40	-
301338	凱格 精機	2022- 08-08	6 個月	新 發 流 通 受 限	46.33	48.99	257	11,906.81	12,590.43	-
301280	珠城 科技	2022- 12-19	6 個月	新 發 流 通 受 限	67.40	44.80	279	18,804.60	12,499.20	-
301365	矩陣 股份	2022- 11-14	6 個月	新 發 流 通 受 限	34.72	23.87	516	17,915.52	12,316.92	-
301366	一博 科技	2022- 09-19	6 個月	新 發 流 通 受 限	65.35	45.09	268	17,513.80	12,084.12	-
301283	聚	2022-	6 個月	新	52.69	51.41	235	12,382.15	12,081.35	-

	膠股份	08-26		發流通受限						
301277	新天地	2022-11-09	6 個月	新發流通受限	27.00	25.78	439	11,853.00	11,317.42	-
301379	天山電子	2022-10-19	6 個月	新發流通受限	31.51	24.63	449	14,147.99	11,058.87	-
301306	西測測試	2022-07-19	6 個月	新發流通受限	43.23	42.29	255	11,023.65	10,783.95	-
301273	瑞晨環保	2022-10-11	6 個月	新發流通受限	37.89	37.79	277	10,495.53	10,467.83	-
301265	華新環保	2022-12-08	6 個月	新發流通受限	13.28	11.40	819	10,876.32	9,336.60	-
301176	逸豪新材	2022-09-21	6 個月	新發流通受限	23.88	16.89	544	12,990.72	9,188.16	-
301318	維海德	2022-08-03	6 個月	新發流通受限	64.68	41.74	206	13,324.08	8,598.44	-
301326	捷邦科技	2022-09-09	6 個月	新發流通	51.72	36.62	227	11,740.44	8,312.74	-

				受限						
301398	星源卓鎂	2022-12-08	6 個月	新發流通受限	34.40	28.94	255	8,772.00	7,379.70	-
301313	凡拓數創	2022-09-22	6 個月	新發流通受限	25.25	29.14	247	6,236.75	7,197.58	-
301276	嘉曼服飾	2022-09-01	6 個月	新發流通受限	40.66	22.61	303	12,319.98	6,850.83	-
301388	欣靈電氣	2022-10-26	6 個月	新發流通受限	25.88	21.60	292	7,556.96	6,307.20	-
301368	豐立智能	2022-12-07	6 個月	新發流通受限	22.33	18.52	337	7,525.21	6,241.24	-
301319	唯特偶	2022-09-22	6 個月	新發流通受限	47.75	53.27	115	5,491.25	6,126.05	-
301270	漢儀股份	2022-08-19	6 個月	新發流通受限	25.68	28.37	210	5,392.80	5,957.70	-
301309	萬得凱	2022-09-08	6 個月	新發流通受限	39.00	24.46	228	8,892.00	5,576.88	-
301316	慧	2022-	6 個月	新	7.60	14.32	359	2,728.40	5,140.88	-

	博雲通	09-29		發 流 通 受 限						
--	-----	-------	--	-----------------------	--	--	--	--	--	--

注：①本基金通過大宗交易方式受讓的原上市公司大股東減持或者特定股東減持的股份，在受讓後 6 個月內，不得轉讓所受讓的股份。本基金所認購非公開發行股份，自發行結束之日起 6 個月內不得轉讓。

②基金還可作為特定投資者，認購首次公開發行股票時公司股東公開發售股份，所認購的股份自發行結束之日起 12 個月內不得轉讓。

③根據《上海證券交易所科創板股票公開發行自律委員會促進科創板初期企業平穩發行行業宣導建議》，本基金獲配的科創板股票如經抽籤方式確定需要鎖定的，鎖定期限為自發行人股票上市之日起 6 個月。根據《上海證券交易所科創板上市公司股東以向特定機構投資者詢價轉讓和配售方式減持股份實施細則》，基金通過詢價轉讓受讓的股份，在受讓後 6 個月內不得轉讓。

④根據《深圳證券交易所創業板首次公開發行證券發行與承銷業務實施細則》，發行人和主承銷商可以採用搖號限售方式或比例限售方式，安排基金通過網下發行獲配的部分創業板股票設置不低於 6 個月的限售期。

⑤基金可使用以基金名義開設的股票帳戶，選擇網上或者網下一種方式進行新股申購。其中基金參與網下申購獲得的新股或作為戰略投資者參與配售獲得的新股，在新股上市後的約定期限內不能自由轉讓；基金參與網上申購獲配的新股，從新股獲配日至新股上市日之間不能自由轉讓。

7.4.12.2 期末持有的暫時停牌等流通受限股票

無。

7.4.12.3 期末債券正回購交易中作為抵押的債券

7.4.12.3.1 銀行間市場債券正回購

無。

7.4.12.3.2 交易所市場債券正回購

無。

7.4.12.4 期末參與轉融通證券出借業務的證券

無。

7.4.13 金融工具風險及管理

7.4.13.1 風險管理政策和組織架構

本基金的風險管理政策是使基金投資風險可測、可控、可承擔。本基金管理人建立了由風險管

理委員會、督察長、法律部、合規部、稽核部、風險管理部和相關業務部門構成的多層次風險管理架構體系。風險管理團隊在識別、衡量投資風險後，通過正式報告的方式，將分析結果及時傳達給基金經理、投資總監、投資決策委員會和風險管理委員會，協助制定風險控制決策，實現風險管理目標。

本基金管理人主要通過定性分析和定量分析的方法，估測各種金融工具風險可能產生的損失。本基金管理人從定性分析的角度出發，判斷風險損失的嚴重性；從定量分析的角度出發，根據本基金的投資目標，結合基金資產所運用的金融工具特徵，通過特定的風險量化指標、模型和日常的量化報告，參考壓力測試結果，確定風險損失的限度和相應置信程度，及時對各種風險進行監督、檢查和評估，並制定相應決策，將風險控制在預期可承受的範圍內。

7.4.13.2 信用風險

信用風險是指由於基金所投資債券的發行人出現違約、拒絕支付到期本息，債券發行人信用評級降低導致債券價格下降，或基金在交易過程中發生交收違約，而造成基金資產損失的可能性。

本基金管理人通過信用分析團隊建立了內部評級體系和交易對手庫，對發行人及債券投資進行內部評級，對交易對手的資信狀況進行充分評估、設定授信額度，以控制可能出現的信用風險。

7.4.13.3 流動性風險

流動性風險是在市場或持有資產流動性不足的情況下，基金管理人可能無法迅速、低成本低地調整基金投資組合，從而對基金收益造成不利影響。

本基金管理人通過限制投資集中度來管理投資品種變現的流動性風險。除在“7.4.12 期末本基金持有的流通受限證券”中列示的部分基金資產流通暫時受限制的情況外，本基金所投資的證券均能及時變現。

7.4.13.3.1 報告期內本基金組合資產的流動性風險分析

在日常運作中，本基金的流動性安排能夠與基金合同約定的申購贖回安排以及投資者的申購贖回規律相匹配。

在資產方面，本基金主要投資於基金合同約定的具有良好流動性的金融工具。基金管理人持續監測本基金持有資產的市場交易量、交易集中度等涉及資產流動性水平的風險指標，並定期開展壓力測試，詳細評估在不同的壓力情景下資產變現情況的變化。

在負債方面，基金管理人持續監測本基金開放期內投資者歷史申贖、投資者類型和結構變化等資料，審慎評估不同市場環境可能帶來的投資者潛在贖回需求，當市場環境或投資者結構發生變化時，及時調整組合資產結構及比例，預留充足現金頭寸，保持基金資產可變現規模和期限與負債贖回規模和期限的匹配。

如遭遇極端市場情形或投資者非預期巨額贖回情形，基金管理人將採用本基金合同約定的贖回申請處理方式及其他各類流動性風險管理工具，控制極端情況下的潛在流動性風險。

7.4.13.4 市場風險

市場風險是指由於市場變化或波動所引起的資產損失的可能性，本基金管理人通過監測組合敏感性指標來衡量市場風險。

7.4.13.4.1 利率風險

利率風險是指利率變動引起組合中資產特別是債券投資的市場價格變動，從而影響基金投資收益的風險。

本基金管理人定期對組合中債券投資部分面臨的利率風險進行監控，並通過調整投資組合的久期等方法對上述利率風險進行管理。

7.4.13.4.1.1 利率風險敞口

單位：人民幣元

本期末 2022 年 12 月 31 日	1 年以內	1-5 年	5 年以上	合計
銀行存款	914,596,828.63	-	-	914,596,828.63
結算備付金	14,292,497.89	-	-	14,292,497.89
結算保證金	1,314,482.54	-	-	1,314,482.54
債券投資	2,221,257,186.76	1,311,098,391.78	-	3,532,355,578.54
資產支持證券	-	-	-	-
買入返售金融資產	-	-	-	-
應收直銷申購款	-	-	-	-
賣出回購金融資產款	-	-	-	-
上年度末 2021 年 12 月 31 日	1 年以內	1-5 年	5 年以上	合計
銀行存款	1,832,783,286.85	-	-	1,832,783,286.85
結算備付金	5,273,357.61	-	-	5,273,357.61
結算保證金	1,058,893.45	-	-	1,058,893.45
債券投資	1,668,746,268.16	2,508,953,000.00	-	4,177,699,268.16
資產支持證券	-	-	-	-
買入返售金融資產	491,421,327.71	-	-	491,421,327.71
應收直銷申購款	-	-	-	-
賣出回購金融資產款	-	-	-	-

注：本表所示為本基金生息資產及負債的公允價值，並按照合約規定的利率重新定價日或到期日孰早者予以分類。

7.4.13.4.1.2 利率風險的敏感性分析

假設	除市場利率以外的其他市場變數保持不變	
分析	相關風險變數的變動	對資產負債表日基金資產淨值的影響金額（單位：人民幣元）

	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
利率下降 25 個基點	9,759,463.75	13,393,320.92
利率上升 25 個基點	-9,698,673.39	-13,288,298.04

7.4.13.4.2 外匯風險

外匯風險是指金融工具的公允價值或未來現金流量因外匯匯率變動而發生波動的風險。本基金持有的金融工具以人民幣計價，因此無重大外匯風險。

7.4.13.4.3 其他價格風險

其他價格風險為除市場利率和外匯匯率以外的市場因素（單個證券發行主體自身經營情況或證券市場整體波動）發生變動時導致基金資產發生損失的風險。

本基金通過投資組合的分散化降低市場價格風險。此外，本基金管理人對本基金所持有的證券價格實施監控，定期運用多種定量方法進行風險度量和分析，以對風險進行跟蹤和控制。

7.4.13.4.3.1 其他價格風險敞口

金額單位：人民幣元

項目	本期末 2022 年 12 月 31 日		上年度末 2021 年 12 月 31 日	
	公允價值	佔基金 資產淨 值比例 (%)	公允價值	佔基金 資產淨 值比例 (%)
交易性金融資產—股票投資	7,608,788,411.38	63.74	7,312,148,813.18	52.83
交易性金融資產—基金投資	-	-	-	-
交易性金融資產—債券投資	1,242.98	0.00	1,268.16	0.00
交易性金融資產—貴金屬投資	-	-	-	-
衍生金融資產—權證投資	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合計	7,608,789,654.36	63.74	7,312,150,081.34	52.83

注：①本表中交易性金融資產-債券投資科目僅包含可轉換公司債券和可交換公司債券等。

②由於四捨五入的原因，分項之和與合計項之間可能存在尾數差異。

7.4.13.4.3.2 其他價格風險的敏感性分析

假設	除滬深 300 指數以外的其他市場變數保持不變		
分析	相關風險變數的變動	對資產負債表日基金資產淨值的 影響金額（單位：人民幣元）	
		本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
	-5%	-345,295,918.22	-405,193,896.85
	+5%	345,295,918.22	405,193,896.85

7.4.14 公允價值

7.4.14.1 金融工具公允價值計量的方法

公允價值計量結果所屬的層次，由對公允價值計量整體而言具有重要意義的輸入值所屬的最低

層次決定：

第一層次：相同資產或負債在活躍市場上未經調整的報價；

第二層次：除第一層次輸入值外相關資產或負債直接或間接可觀察的輸入值；

第三層次：相關資產或負債的不可觀察輸入值。

7.4.14.2 持續的以公允價值計量的金融工具

7.4.14.2.1 各層次金融工具的公允價值

單位：人民幣元

公允價值計量結果所屬的層次	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一層次	7,489,159,881.01	7,304,210,935.31
第二層次	3,532,740,198.96	4,185,637,146.03
第三層次	119,243,909.95	-
合計	11,141,143,989.92	11,489,848,081.34

7.4.14.2.2 公允價值所屬層次間的重大變動

對於公開市場交易的證券等投資，若出現交易不活躍（包括重大事項停牌、境內證券漲跌停等導致的交易不活躍）和非公開發行等情況，本基金不會於交易不活躍期間及限售期間將相關投資的公允價值列入第一層次，並根據估值調整中採用的對公允價值計量整體而言具有重要意義的輸入值所屬的最低層次，確定相關投資的公允價值應屬第二層次或第三層次。本基金政策以導致各層次之間轉換的事項發生日作為確定金融工具公允價值層次之間轉換的時點。

7.4.14.2.3 第三層次公允價值餘額及變動情況

7.4.14.2.3.1 第三層次公允價值餘額及變動情況

單位：人民幣元

項目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		
	交易性金融資產		合計
	債券投資	股票投資	
期初餘額	-	-	-
當期購買	-	130,000,004.07	130,000,004.07
當期出售/結算	-	-	-
轉入第三層次	-	2,321,633.51	2,321,633.51
轉出第三層次	-	-	-
當期利得或損失總額	-	-13,077,727.63	-13,077,727.63
其中：計入損益的利得或損失	-	-13,077,727.63	-13,077,727.63
計入其他綜合收益的利得或損失（若有）	-	-	-
期末餘額	-	119,243,909.95	119,243,909.95

期末仍持有的第三層次金融資產計入本期損益的未實現利得或損失的變動——公允價值變動損益	-	-13,077,727.63	-13,077,727.63
--	---	----------------	----------------

7.4.14.2.3.2 使用重要不可觀察輸入值的第三層次公允價值計量的情況

單位：人民幣元

項目	本期末公允價值	採用的估值技術	不可觀察輸入值		
			名稱	範圍/加權平均值	與公允價值之間的關係
限售股票	119,243,909.95	平均價格亞式期權模型	預期年化波動率	0.1891-2.4756	負相關

7.4.14.3 非持續的以公允價值計量的金融工具的說明

截至 2022 年 12 月 31 日止，本基金未持有非持續的以公允價值計量的金融資產。

7.4.14.4 不以公允價值計量的金融工具的相關說明

本基金持有的不以公允價值計量的金融工具為以攤余成本計量的金融資產和金融負債，這些金融工具因其剩餘期限較短，其帳面價值與公允價值差異很小。

7.4.15 有助於理解和分析會計報表需要說明的其他事項

截至資產負債表日本基金無需要說明的其他重要事項。

§8 投資組合報告

8.1 期末基金資產組合情況

金額單位：人民幣元

序號	項目	金額	佔基金總資產的比例 (%)
1	權益投資	7,608,788,411.38	63.02
	其中：股票	7,608,788,411.38	63.02
2	基金投資	-	-
3	固定收益投資	3,532,355,578.54	29.25
	其中：債券	3,532,355,578.54	29.25
	資產支持證券	-	-
4	貴金屬投資	-	-
5	金融衍生品投資	-	-
6	買入返售金融資產	-	-
	其中：買斷式回購的買入返售金融資產	-	-
7	銀行存款和結算備付金合計	928,889,326.52	7.69
8	其他各項資產	4,406,395.29	0.04
9	合計	12,074,439,711.73	100.00

8.2 報告期末按行業分類的股票投資組合

8.2.1 報告期末按行業分類的境內股票投資組合

代碼	行業類別	公允價值（元）	佔基金資產淨值比例（%）
A	農、林、牧、漁業	-	-
B	採礦業	77,409,618.28	0.65
C	製造業	4,069,727,102.92	34.09
D	電力、熱力、燃氣及水生產和供應業	20,890,310.00	0.18
E	建築業	110,061,213.00	0.92
F	批發和零售業	84,729,805.80	0.71
G	交通運輸、倉儲和郵政業	329,951,327.13	2.76
H	住宿和餐飲業	-	-
I	信息傳輸、軟件和信息技術服務業	495,397,445.95	4.15
J	金融業	845,118,345.43	7.08
K	房地產業	1,310,195,049.95	10.98
L	租賃和商務服務業	66,300,380.34	0.56
M	科學研究和技術服務業	131,204,607.35	1.10
N	水利、環境和公共設施管理業	-	-
O	居民服務、修理和其他服務業	-	-
P	教育	-	-
Q	衛生和社會工作	67,803,205.23	0.57
R	文化、體育和娛樂業	-	-
S	綜合	-	-
	合計	7,608,788,411.38	63.74

8.3 期末按公允價值佔基金資產淨值比例大小排序的所有股票投資明細

金額單位：人民幣元

序號	股票代碼	股票名稱	數量(股)	公允價值	佔基金資產淨值比例(%)
1	600519	貴州茅台	556,464	961,013,328.00	8.05
2	600048	保利發展	47,144,641	713,298,418.33	5.98
3	600941	中國移動	7,026,026	475,451,179.42	3.98
4	300750	寧德時代	1,084,971	426,849,290.82	3.58
5	600009	上海機場	5,717,403	329,951,327.13	2.76
6	002304	洋河股份	1,727,079	277,196,179.50	2.32
7	600383	金地集團	22,094,807	226,029,875.61	1.89
8	600926	杭州銀行	16,221,846	212,181,745.68	1.78
9	300059	東方財富	8,518,520	165,259,288.00	1.38
10	300034	鋼研高納	3,219,500	147,581,880.00	1.24
11	002025	航太電器	2,050,351	135,835,753.75	1.14
12	603259	藥明康德	1,619,161	131,152,041.00	1.10
13	601318	中國平安	2,767,217	130,059,199.00	1.09
14	600862	中航高科	5,572,796	124,217,622.84	1.04
15	601155	新城控股	6,031,301	123,641,670.50	1.04
16	300760	邁瑞醫療	375,171	118,542,780.87	0.99
17	600893	航發動力	2,764,464	116,881,537.92	0.98
18	601668	中國建築	20,269,100	110,061,213.00	0.92
19	002013	中航機電	10,814,479	108,685,513.95	0.91

20	300450	先導智能	2,389,275	96,168,318.75	0.81
21	600325	華發股份	9,583,687	86,828,204.22	0.73
22	600887	伊利股份	2,789,500	86,474,500.00	0.72
23	002371	北方華創	383,514	86,405,704.20	0.72
24	601166	興業銀行	4,790,900	84,271,931.00	0.71
25	001979	招商蛇口	6,581,900	83,129,397.00	0.70
26	603712	七一二	2,352,864	82,162,010.88	0.69
27	688012	中微公司	836,435	81,978,994.35	0.69
28	002142	寧波銀行	2,507,700	81,374,865.00	0.68
29	002179	中航光電	1,384,785	79,985,181.60	0.67
30	300628	億聯網絡	1,280,930	77,611,548.70	0.65
31	300661	聖邦股份	438,675	75,715,305.00	0.63
32	002436	興森科技	8,064,516	75,080,643.96	0.63
33	000002	萬科 A	3,931,402	71,551,516.40	0.60
34	300015	愛爾眼科	2,180,129	67,736,608.03	0.57
35	600563	法拉電子	414,400	66,254,272.00	0.56
36	600188	兗礦能源	1,941,336	65,190,062.88	0.55
37	601838	成都銀行	4,137,404	63,302,281.20	0.53
38	688016	心脈醫療	327,592	61,927,991.68	0.52
39	600153	建發股份	4,505,300	61,497,345.00	0.52
40	000776	廣發證券	3,842,279	59,516,901.71	0.50
41	603659	璞泰來	1,118,779	58,053,442.31	0.49
42	601888	中國中免	244,278	52,771,376.34	0.44
43	688617	惠泰醫療	170,895	52,452,802.35	0.44
44	600298	安琪酵母	1,101,652	49,816,703.44	0.42
45	300395	菲利華	898,788	49,433,340.00	0.41
46	601601	中國太保	2,004,410	49,148,133.20	0.41
47	000999	華潤三九	1,033,244	48,366,151.64	0.41
48	600438	通威股份	1,215,107	46,878,828.06	0.39
49	000893	亞鉀國際	1,579,779	41,990,525.82	0.35
50	002415	海康威視	1,167,500	40,488,900.00	0.34
51	600276	恒瑞醫藥	904,720	34,858,861.60	0.29
52	688351	微電生理	1,061,849	28,088,425.37	0.24
53	002049	紫光國微	208,388	27,469,706.16	0.23
54	002850	科達利	229,244	27,236,479.64	0.23
55	301050	雷電微力	321,500	24,810,155.00	0.21
56	600522	中天科技	1,493,500	24,120,025.00	0.20
57	002812	恩捷股份	175,210	23,003,320.90	0.19
58	002709	天賜材料	520,900	22,846,674.00	0.19
59	002594	比亞迪	87,000	22,356,390.00	0.19
60	600085	同仁堂	500,044	22,341,965.92	0.19
61	002821	凱萊英	146,740	21,717,520.00	0.18
62	600905	三峽能源	3,697,400	20,890,310.00	0.18
63	002271	東方雨虹	570,000	19,134,900.00	0.16
64	603456	九洲藥業	390,800	16,581,644.00	0.14
65	002791	堅朗五金	151,100	15,706,845.00	0.13
66	002027	分眾傳媒	2,025,300	13,529,004.00	0.11
67	688083	中望軟件	67,397	13,114,108.26	0.11
68	603986	兆易創新	123,000	12,603,810.00	0.11
69	603979	金誠信	477,140	12,219,555.40	0.10

70	603606	東方電纜	175,700	11,917,731.00	0.10
71	603233	大參林	300,688	11,907,244.80	0.10
72	603806	福斯特	178,700	11,872,828.00	0.10
73	603939	益豐藥房	177,400	11,325,216.00	0.09
74	300833	浩洋股份	94,400	7,914,496.00	0.07
75	603486	科沃斯	73,300	5,346,502.00	0.04
76	603290	斯達半導	16,100	5,301,730.00	0.04
77	688052	納芯微	15,647	4,969,487.20	0.04
78	688235	百濟神州	36,564	4,842,901.80	0.04
79	000961	中南建設	1,976,831	4,329,259.89	0.04
80	603236	移遠通信	30,300	3,054,846.00	0.03
81	688508	芯朋微	22,288	1,444,485.28	0.01
82	600007	中國國貿	87,600	1,386,708.00	0.01
83	600456	寶鈦股份	14,267	582,949.62	0.00
84	688506	百利天恒	15,622	385,863.40	0.00
85	688061	燦瑞科技	3,972	346,239.24	0.00
86	688380	中微半導	12,677	335,179.88	0.00
87	688084	晶品特裝	1,875	140,118.75	0.00
88	301269	華大九天	1,168	102,713.92	0.00
89	688246	嘉和美康	3,364	98,598.84	0.00
90	688203	海正生材	5,761	86,933.49	0.00
91	688416	恒燦股份	2,147	79,460.47	0.00
92	001301	尚太科技	1,164	68,722.56	0.00
93	301267	華廈眼科	1,006	66,597.20	0.00
94	688292	浩瀚深度	4,503	66,059.01	0.00
95	301095	廣立微	740	64,002.60	0.00
96	301308	江波龍	819	46,453.68	0.00
97	301327	華寶新能	242	42,826.74	0.00
98	301165	銳捷網絡	1,077	34,043.97	0.00
99	301356	天振股份	614	26,604.62	0.00
100	301195	北路智控	330	24,103.20	0.00
101	301330	熵基科技	694	21,729.14	0.00
102	301152	天力鋰能	433	20,195.12	0.00
103	301391	卡萊特	247	19,999.59	0.00
104	301349	信德新材	180	18,633.60	0.00
105	603833	歐派家居	144	17,500.32	0.00
106	301171	易點天下	985	17,454.20	0.00
107	301363	美好醫療	445	16,843.25	0.00
108	301115	建科股份	685	16,467.40	0.00
109	600600	青島啤酒	152	16,340.00	0.00
110	301223	中榮股份	815	14,775.95	0.00
111	301328	維峰電子	191	14,699.36	0.00
112	301121	紫建電子	290	14,433.30	0.00
113	301139	元道通信	566	14,325.46	0.00
114	301335	天元寵物	420	14,204.40	0.00
115	301377	鼎泰高科	770	13,575.10	0.00
116	301230	泓博醫藥	269	12,998.08	0.00
117	301396	宏景科技	396	12,632.40	0.00
118	301338	凱格精機	257	12,590.43	0.00
119	301280	珠城科技	279	12,499.20	0.00

120	301365	矩陣股份	516	12,316.92	0.00
121	301366	一博科技	268	12,084.12	0.00
122	301283	聚膠股份	235	12,081.35	0.00
123	301277	新天地	439	11,317.42	0.00
124	301379	天山電子	449	11,058.87	0.00
125	301306	西測測試	255	10,783.95	0.00
126	301273	瑞晨環保	277	10,467.83	0.00
127	000333	美的集團	187	9,686.60	0.00
128	301265	華新環保	819	9,336.60	0.00
129	301176	逸豪新材	544	9,188.16	0.00
130	301318	維海德	206	8,598.44	0.00
131	301326	捷邦科技	227	8,312.74	0.00
132	301398	星源卓鎂	255	7,379.70	0.00
133	301313	凡拓數創	247	7,197.58	0.00
134	301276	嘉曼服飾	303	6,850.83	0.00
135	301388	欣靈電氣	292	6,307.20	0.00
136	301368	豐立智能	337	6,241.24	0.00
137	301319	唯特偶	115	6,126.05	0.00
138	301270	漢儀股份	210	5,957.70	0.00
139	301309	萬得凱	228	5,576.88	0.00
140	600885	宏發股份	157	5,245.37	0.00
141	301316	慧博雲通	359	5,140.88	0.00
142	601336	新華保險	133	4,000.64	0.00
143	002050	三花智控	48	1,018.56	0.00

8.4 報告期內股票投資組合的重大變動

8.4.1 累計買入金額超出期初基金資產淨值 2%或前 20 名的股票明細

金額單位：人民幣元

序號	股票代碼	股票名稱	本期累計買入金額	佔期初基金資產淨值比例 (%)
1	600048	保利發展	738,645,631.95	5.34
2	600941	中國移動	562,391,039.11	4.06
3	600383	金地集團	420,174,980.32	3.04
4	600009	上海機場	317,396,611.51	2.29
5	300059	東方財富	285,467,695.09	2.06
6	300750	寧德時代	274,519,118.16	1.98
7	601318	中國平安	268,658,650.24	1.94
8	600926	杭州銀行	204,398,799.44	1.48
9	600456	寶鈦股份	189,980,974.03	1.37
10	603259	藥明康得	154,162,737.50	1.11
11	002025	航太電器	138,715,003.47	1.00
12	300450	先導智能	130,489,448.36	0.94
13	600741	華域汽車	130,164,480.99	0.94
14	002013	中航機電	128,886,334.18	0.93
15	600325	華發股份	127,276,581.86	0.92
16	002371	北方華創	127,246,977.09	0.92
17	600893	航發動力	126,773,653.08	0.92
18	600862	中航高科	126,163,445.33	0.91

19	300034	鋼研高納	126,128,006.87	0.91
20	600887	伊利股份	124,826,716.53	0.90

注：“買入金額”按買入成交金額（成交單價乘以成交數量）填列，不考慮相關交易費用。

8.4.2 累計賣出金額超出期初基金資產淨值 2%或前 20 名的股票明細

金額單位：人民幣元

序號	股票代碼	股票名稱	本期累計賣出金額	佔期初基金資產淨值比例 (%)
1	002304	洋河股份	708,319,215.95	5.12
2	601888	中國中免	685,791,925.04	4.95
3	300122	智飛生物	556,696,544.77	4.02
4	300015	愛爾眼科	479,215,248.53	3.46
5	600600	青島啤酒	369,906,930.71	2.67
6	600438	通威股份	230,085,889.28	1.66
7	603613	國聯股份	196,864,146.50	1.42
8	600570	恒生電子	191,547,015.04	1.38
9	000858	五糧液	163,658,355.94	1.18
10	600519	貴州茅台	150,294,760.00	1.09
11	600456	寶鈦股份	149,101,230.19	1.08
12	300059	東方財富	143,737,091.63	1.04
13	600406	國電南瑞	141,486,833.73	1.02
14	600941	中國移動	137,862,898.29	1.00
15	600383	金地集團	131,166,124.08	0.95
16	601318	中國平安	118,793,066.59	0.86
17	600801	華新水泥	97,770,966.87	0.71
18	600585	海螺水泥	96,029,503.27	0.69
19	600741	華域汽車	95,545,440.81	0.69
20	300151	昌紅科技	85,267,109.70	0.62

注：“賣出金額”按賣出成交金額（成交單價乘以成交數量）填列，不考慮相關交易費用。

8.4.3 買入股票的成本總額及賣出股票的收入總額

單位：人民幣元

買入股票成本（成交）總額	8,053,791,543.19
賣出股票收入（成交）總額	6,425,866,477.15

注：“買入股票成本”、“賣出股票收入”均按買賣成交金額（成交單價乘以成交數量）填列，不考慮相關交易費用。

8.5 期末按債券品種分類的債券投資組合

金額單位：人民幣元

序號	債券品種	公允價值	佔基金資產淨值比例 (%)
1	國家債券	1,511,813,924.61	12.66
2	央行票據	-	-
3	金融債券	2,020,540,410.95	16.93

	其中：政策性金融債	1,671,373,104.10	14.00
4	企業債券	-	-
5	企業短期融資券	-	-
6	中期票據	-	-
7	可轉債（可交換債）	1,242.98	0.00
8	同業存單	-	-
9	其他	-	-
10	合計	3,532,355,578.54	29.59

8.6 期末按公允價值佔基金資產淨值比例大小排序的前五名債券投資明細

金額單位：人民幣元

序號	債券代碼	債券名稱	數量(張)	公允價值	佔基金資產淨值比例 (%)
1	019679	22 國債 14	10,515,000	1,058,709,256.87	8.87
2	210218	21 國開 18	4,700,000	474,471,824.66	3.97
3	210015	21 附息國 債 15	4,000,000	403,339,945.21	3.38
4	220322	22 進出 22	2,500,000	251,273,082.19	2.10
5	2220080	22 廈門國 際銀行	2,500,000	248,704,041.10	2.08

8.7 期末按公允價值佔基金資產淨值比例大小排序的所有資產支持證券投資明細

本基金本報告期末未持有資產支持證券。

8.8 報告期末按公允價值佔基金資產淨值比例大小排序的前五名貴金屬投資明細

本基金本報告期末未持有貴金屬。

8.9 期末按公允價值佔基金資產淨值比例大小排序的前五名權證投資明細

本基金本報告期末未持有權證。

8.10 本基金投資股指期貨的投資政策

本基金本報告期末無股指期貨投資。

8.11 報告期末本基金投資的國債期貨交易情況說明

8.11.1 本期國債期貨投資政策

本基金本報告期末無國債期貨投資。

8.11.2 本期國債期貨投資評價

本基金本報告期末無國債期貨投資。

8.12 投資組合報告附注

8.12.1 本基金投資的前十名證券的發行主體中，中國進出口銀行、國家開發銀行出現在報告編制日前一年內受到監管部門公開譴責、處罰的情況。本基金對上述主體發行的相關證券的投資決策程序符合相關法律法規及基金合同的要求。

8.12.2 基金投資的前十名股票未超出基金合同規定的備選股票庫。

8.12.3 期末其他各項資產構成

單位：人民幣元

序號	名稱	金額
1	存出保證金	1,314,482.54
2	應收清算款	-
3	應收股利	-
4	應收利息	-
5	應收申購款	3,091,912.75
6	其他應收款	-
7	待攤費用	-
8	其他	-
9	合計	4,406,395.29

8.12.4 期末持有的處於轉股期的可轉換債券明細

本基金本報告期末未持有處於轉股期的可轉換債券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情況的說明

本基金本報告期末前十名股票中不存在流通受限情況。

8.12.6 投資組合報告附注的其他文字描述部分

由於四捨五入的原因，分項之和與合計項之間可能存在尾數差異。

§9 基金份額持有人信息

9.1 期末基金份額持有人戶數及持有人結構

份額單位：份

持有人戶數 (戶)	戶均持有的 基金份額	持有人結構			
		機構投資者		個人投資者	
		持有份額	佔總份額比例	持有份額	佔總份額比例
995,221	9,147.63	42,146,741.46	0.46%	9,061,767,626.08	99.54%

9.2 期末基金管理人的從業人員持有本基金的情況

項目	持有份額總數（份）	佔基金總份額比例
基金管理人所有從業人員持有 本基金	1,770,305.79	0.02%

9.3 期末基金管理人的從業人員持有本開放式基金份額總量區間的情況

項目	持有基金份額總量的數量區間（萬份）
本公司高級管理人員、基金投資和研究部門負責人持有本開放式基金	10~50
本基金基金經理持有本開放式基金	0

§10 開放式基金份額變動

單位：份

基金合同生效日（2003 年 9 月 5 日）基金份額總額	3,796,885,823.40
本報告期期初基金份額總額	9,444,816,091.35
本報告期基金總申購份額	1,001,307,670.86
減：本報告期基金總贖回份額	1,342,209,394.67
本報告期基金拆分變動份額	-
本報告期期末基金份額總額	9,103,914,367.54

§11 重大事件披露

11.1 基金份額持有人大會決議

本報告期內，本基金無基金份額持有人大會決議。

11.2 基金管理人、基金託管人的專門基金託管部門的重大人事變動

本報告期內，桂勇先生擔任華夏基金管理有限公司首席信息官，李一梅女士不再兼任。華夏基金管理有限公司已根據法律法規的規定完成財務負責人孫立強先生的有關備案工作。

本報告期內，本基金託管人的專門基金託管部門未發生重大人事變動。

11.3 涉及基金管理人、基金財產、基金託管業務的訴訟

本報告期無涉及本基金管理人、基金財產、基金託管業務的訴訟事項。

11.4 基金投資策略的改變

本基金本報告期投資策略未發生改變。

11.5 為基金進行審計的會計師事務所情況

本基金本報告期應支付給安永華明會計師事務所（特殊普通合夥）的報酬為 100,000 元人民幣。截至本報告期末，該事務所已向本基金提供 20 年的審計服務。

11.6 管理人、託管人及其高級管理人員受稽查或處罰等情況

11.6.1 管理人及其高級管理人員受稽查或處罰等情況

本基金管理人及其高級管理人員在本報告期內無受稽查或處罰等情況。

11.6.2 託管人及其高級管理人員受稽查或處罰等情況

本報告期內，基金託管人及其高級管理人員未受監管部門稽查或處罰。

11.7 基金租用證券公司交易單元的有關情況

11.7.1 基金租用證券公司交易單元進行股票投資及佣金支付情況

金額單位：人民幣元

券商名稱	交易單元數量	股票交易		應支付該券商的佣金		備註
		成交金額	佔當期股票成交總額的比例	佣金	佔當期佣金總量的比例	
長江證券	2	3,645,489,742.54	25.50%	3,395,058.85	28.37%	-
中信證券	2	3,340,546,564.57	23.36%	3,111,056.26	26.00%	-
國都證券	1	2,370,393,544.76	16.58%	1,733,472.25	14.49%	-
川財證券	1	1,436,807,118.34	10.05%	1,050,749.49	8.78%	-
信達證券	1	1,359,605,612.84	9.51%	994,279.64	8.31%	-
興業證券	2	661,785,858.32	4.63%	483,966.94	4.04%	-
廣發證券	2	517,620,417.77	3.62%	482,068.89	4.03%	-
中天證券	1	472,668,587.91	3.31%	345,662.97	2.89%	-
瑞銀證券	1	441,259,330.47	3.09%	322,692.13	2.70%	-
西南證券	2	47,777,575.04	0.33%	44,495.72	0.37%	-
海通證券	2	2,548,348.54	0.02%	2,373.31	0.02%	-
國泰君安證券	1	946,409.95	0.01%	881.39	0.01%	-

注：①為了貫徹中國證監會的有關規定，我公司制定了選擇券商的標準，即：

i 經營行為規範。

ii 公司財務狀況良好。

iii 有良好的內控制度，在業內有良好的聲譽。

iv 有較強的全方位金融服務能力和水準：能及時、全面、定期提供品質較高的宏觀、行業、公司和證券市場研究報告，並能根據基金投資的特殊要求，提供專門的研究報告；能積極為公司投資業務的開展，投資信息的交流以及其他方面業務的開展提供良好的服務和支援。

v 建立了廣泛的信息網絡，能及時提供準確的信息資訊和服務。

②券商專用交易單元選擇程序：

i 本基金管理人根據上述標準進行評估並確定選用的券商。

ii 本基金管理人與被選擇的券商簽訂交易單元租用協議/證券經紀服務協議。

③除本表列示外，本基金還選擇了安信證券、財通證券、德邦證券、東方證券、恒泰證券、申萬宏源證券、西部證券、銀河證券、招商證券、中國銀河證券、中泰證券、中信建投證券、中銀國際證券的交易單元作為本基金交易單元，本報告期無股票交易及應付佣金。

④在上述租用的券商交易單元中，中信證券的部分交易單元為本基金本期剔除的交易單元，本期沒有新增的券商交易單元。

11.7.2 基金租用證券公司交易單元進行其他證券投資的情況

金額單位：人民幣元

券商名稱	債券交易		債券回購交易		權證交易		基金交易	
	成交金額	佔當期債券成交總額	成交金額	佔當期債券回	成交金額	佔當期權證成	成交金額	佔當期基金成

		的比例		購成 交總 額的 比例		交總 額的 比例		交總 額的 比例
長江證券	100,150,000.00	17.49%	-	-	-	-	-	-
中信證券	472,311,316.86	82.51%	-	-	-	-	-	-
國都證券	1,188.36	0.00%	-	-	-	-	-	-
川財證券	-	-	-	-	-	-	-	-
信達證券	-	-	-	-	-	-	-	-
興業證券	-	-	-	-	-	-	-	-
廣發證券	-	-	-	-	-	-	-	-
中天證券	-	-	-	-	-	-	-	-
瑞銀證券	-	-	-	-	-	-	-	-
西南證券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通證券	-	-	-	-	-	-	-	-
國泰君安證 券	-	-	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序號	公告事項	法定披露方式	法定披露日期
1	華夏回報證券投資基金第 112 次分紅公告	中國證監會指定報刊及網站	2022-01-11
2	華夏基金管理有限公司關於旗下基金投資關聯方承銷證券的公告	中國證監會指定報刊及網站	2022-01-21
3	華夏基金管理有限公司關於旗下基金投資關聯方承銷證券的公告	中國證監會指定報刊及網站	2022-02-12
4	華夏基金管理有限公司關於旗下基金投資關聯方承銷證券的公告	中國證監會指定報刊及網站	2022-02-17
5	華夏基金管理有限公司關於旗下基金投資關聯方承銷證券的公告	中國證監會指定報刊及網站	2022-02-19
6	華夏基金管理有限公司關於旗下基金投資關聯方承銷證券的公告	中國證監會指定報刊及網站	2022-02-23
7	華夏基金管理有限公司關於旗下基金投資關聯方承銷證券的公告	中國證監會指定報刊及網站	2022-03-12
8	華夏基金管理有限公司關於旗下基金投資關聯方承銷證券的公告	中國證監會指定報刊及網站	2022-03-19
9	華夏基金管理有限公司關於旗下基金投資關聯方承銷證券的公告	中國證監會指定報刊及網站	2022-04-02
10	華夏基金管理有限公司關於旗下基金投資關聯方承銷證券的公告	中國證監會指定報刊及網站	2022-04-08
11	華夏基金管理有限公司關於旗下基金投資關聯方承銷證券的公告	中國證監會指定報刊及網站	2022-04-13
12	華夏基金管理有限公司關於旗下基金投資關聯方承銷證券的公告	中國證監會指定報刊及網站	2022-04-16
13	華夏基金管理有限公司關於旗下基金投資關聯方承銷證券的公告	中國證監會指定報刊及網站	2022-06-18
14	華夏基金管理有限公司公告	中國證監會指定報刊及網站	2022-06-24
15	華夏基金管理有限公司公告	中國證監會指定報刊及網站	2022-06-25
16	華夏基金管理有限公司關於旗下基金投資關	中國證監會指定報刊及	2022-07-07

	聯方承銷證券的公告	網站	
17	華夏基金管理有限公司關於旗下基金投資關聯方承銷證券的公告	中國證監會指定報刊及網站	2022-07-20
18	華夏基金管理有限公司關於旗下基金投資關聯方承銷證券的公告	中國證監會指定報刊及網站	2022-07-23
19	華夏基金管理有限公司關於旗下基金投資關聯方承銷證券的公告	中國證監會指定報刊及網站	2022-07-30
20	華夏基金管理有限公司關於旗下基金投資關聯方承銷證券的公告	中國證監會指定報刊及網站	2022-08-06
21	華夏基金管理有限公司關於旗下基金投資關聯方承銷證券的公告	中國證監會指定報刊及網站	2022-08-10
22	華夏基金管理有限公司關於旗下基金投資關聯方承銷證券的公告	中國證監會指定報刊及網站	2022-08-12
23	華夏基金管理有限公司關於旗下基金投資關聯方承銷證券的公告	中國證監會指定報刊及網站	2022-08-13
24	華夏基金管理有限公司關於旗下基金投資非公開發行股票的公告	中國證監會指定報刊及網站	2022-08-18
25	華夏基金管理有限公司關於旗下基金投資關聯方承銷證券的公告	中國證監會指定報刊及網站	2022-08-19
26	華夏基金管理有限公司關於旗下基金投資關聯方承銷證券的公告	中國證監會指定報刊及網站	2022-09-01
27	華夏基金管理有限公司關於旗下基金投資關聯方承銷證券的公告	中國證監會指定報刊及網站	2022-09-03
28	華夏基金管理有限公司關於旗下基金投資非公開發行股票的公告	中國證監會指定報刊及網站	2022-09-07
29	華夏基金管理有限公司關於旗下基金投資關聯方承銷證券的公告	中國證監會指定報刊及網站	2022-09-22
30	華夏基金管理有限公司關於旗下基金投資關聯方承銷證券的公告	中國證監會指定報刊及網站	2022-10-14
31	華夏基金管理有限公司關於旗下基金投資關聯方承銷證券的公告	中國證監會指定報刊及網站	2022-10-20
32	華夏基金管理有限公司關於旗下基金投資關聯方承銷證券的公告	中國證監會指定報刊及網站	2022-10-22
33	華夏基金管理有限公司關於旗下基金投資關聯方承銷證券的公告	中國證監會指定報刊及網站	2022-11-05
34	華夏基金管理有限公司關於旗下基金投資關聯方承銷證券的公告	中國證監會指定報刊及網站	2022-11-12
35	華夏基金管理有限公司關於旗下基金投資關聯方承銷證券的公告	中國證監會指定報刊及網站	2022-11-16
36	華夏基金管理有限公司關於旗下基金投資關聯方承銷證券的公告	中國證監會指定報刊及網站	2022-11-26
37	華夏基金管理有限公司關於旗下基金投資關聯方承銷證券的公告	中國證監會指定報刊及網站	2022-11-30
38	華夏基金管理有限公司關於旗下基金投資關聯方承銷證券的公告	中國證監會指定報刊及網站	2022-12-16
39	華夏基金管理有限公司關於旗下基金投資非公開發行股票的公告	中國證監會指定報刊及網站	2022-12-17
40	華夏基金管理有限公司關於旗下基金投資關聯方承銷證券的公告	中國證監會指定報刊及網站	2022-12-20
41	華夏基金管理有限公司關於旗下基金投資關	中國證監會指定報刊及	2022-12-23

	聯方承銷證券的公告	網站	
42	華夏基金管理有限公司關於旗下基金投資關聯方承銷證券的公告	中國證監會指定報刊及網站	2022-12-24

§12 影響投資者決策的其他重要信息

12.1 報告期內單一投資者持有基金份額比例達到或超過 20%的情況

本基金本報告期內未出現單一投資者持有基金份額比例達到或超過20%的情況。

§13 備查文件目錄

13.1 備查文件目錄

- 1、中國證監會核准基金募集的文件；
- 2、《華夏回報證券投資基金基金合同》；
- 3、《華夏回報證券投資基金託管協議》；
- 4、法律意見書；
- 5、基金管理人業務資格批件、營業執照；
- 6、基金託管人業務資格批件、營業執照。

13.2 存放地點

備查文件存放於基金管理人和/或基金託管人的住所。

13.3 查閱方式

投資者可到基金管理人和/或基金託管人的住所免費查閱備查文件。在支付工本費後，投資者可在合理時間內取得備查文件的複製件或複印本。

§14 補充披露

補充披露1：期末基金資產組合情況

名稱	數量（股）	公允價值（人民幣元）
(1)股票投資		
上市投資		
中國(100%)		
貴州茅台	556,464	961,013,328.00
保利發展	47,144,641	713,298,418.33

中國移動	7,026,026	475,451,179.42
寧德時代	1,084,971	426,849,290.82
上海機場	5,717,403	329,951,327.13
洋河股份	1,727,079	277,196,179.50
金地集團	22,094,807	226,029,875.61
杭州銀行	16,221,846	212,181,745.68
東方財富	8,518,520	165,259,288.00
鋼研高納	3,219,500	147,581,880.00
航太電器	2,050,351	135,835,753.75
藥明康得	1,619,161	131,152,041.00
中國平安	2,767,217	130,059,199.00
中航高科	5,572,796	124,217,622.84
新城控股	6,031,301	123,641,670.50
邁瑞醫療	375,171	118,542,780.87
航發動力	2,764,464	116,881,537.92
中國建築	20,269,100	110,061,213.00
中航機電	10,814,479	108,685,513.95
先導智能	2,389,275	96,168,318.75
華發股份	9,583,687	86,828,204.22
伊利股份	2,789,500	86,474,500.00
北方華創	383,514	86,405,704.20
興業銀行	4,790,900	84,271,931.00
招商蛇口	6,581,900	83,129,397.00
七一二	2,352,864	82,162,010.88
中微公司	836,435	81,978,994.35
寧波銀行	2,507,700	81,374,865.00
中航光電	1,384,785	79,985,181.60
億聯網絡	1,280,930	77,611,548.70
聖邦股份	438,675	75,715,305.00
興森科技	8,064,516	75,080,643.96
萬科 A	3,931,402	71,551,516.40
愛爾眼科	2,180,129	67,736,608.03
法拉電子	414,400	66,254,272.00
兗礦能源	1,941,336	65,190,062.88
成都銀行	4,137,404	63,302,281.20
心脈醫療	327,592	61,927,991.68
建發股份	4,505,300	61,497,345.00
廣發證券	3,842,279	59,516,901.71
璞泰來	1,118,779	58,053,442.31
中國中免	244,278	52,771,376.34
惠泰醫療	170,895	52,452,802.35
安琪酵母	1,101,652	49,816,703.44
菲利華	898,788	49,433,340.00
中國太保	2,004,410	49,148,133.20
華潤三九	1,033,244	48,366,151.64

通威股份	1,215,107	46,878,828.06
亞鉀國際	1,579,779	41,990,525.82
海康威視	1,167,500	40,488,900.00
恒瑞醫藥	904,720	34,858,861.60
微電生理	1,061,849	28,088,425.37
紫光國微	208,388	27,469,706.16
科達利	229,244	27,236,479.64
雷電微力	321,500	24,810,155.00
中天科技	1,493,500	24,120,025.00
恩捷股份	175,210	23,003,320.90
天賜材料	520,900	22,846,674.00
比亞迪	87,000	22,356,390.00
同仁堂	500,044	22,341,965.92
凱萊英	146,740	21,717,520.00
三峽能源	3,697,400	20,890,310.00
東方雨虹	570,000	19,134,900.00
九洲藥業	390,800	16,581,644.00
堅朗五金	151,100	15,706,845.00
分眾傳媒	2,025,300	13,529,004.00
中望軟件	67,397	13,114,108.26
兆易創新	123,000	12,603,810.00
金誠信	477,140	12,219,555.40
東方電纜	175,700	11,917,731.00
大參林	300,688	11,907,244.80
福斯特	178,700	11,872,828.00
益豐藥房	177,400	11,325,216.00
浩洋股份	94,400	7,914,496.00
科沃斯	73,300	5,346,502.00
斯達半導	16,100	5,301,730.00
納芯微	15,647	4,969,487.20
百濟神州	36,564	4,842,901.80
中南建設	1,976,831	4,329,259.89
移遠通信	30,300	3,054,846.00
芯朋微	22,288	1,444,485.28
中國國貿	87,600	1,386,708.00
寶鈦股份	14,267	582,949.62
百利天恒	15,622	385,863.40
燦瑞科技	3,972	346,239.24
中微半導	12,677	335,179.88
晶品特裝	1,875	140,118.75
華大九天	1,168	102,713.92
嘉和美康	3,364	98,598.84
海正生材	5,761	86,933.49
恒燦股份	2,147	79,460.47
尚太科技	1,164	68,722.56

華廈眼科	1,006	66,597.20
浩瀚深度	4,503	66,059.01
廣立微	740	64,002.60
江波龍	819	46,453.68
華寶新能	242	42,826.74
銳捷網絡	1,077	34,043.97
天振股份	614	26,604.62
北路智控	330	24,103.20
熵基科技	694	21,729.14
天力鋰能	433	20,195.12
卡萊特	247	19,999.59
信德新材	180	18,633.60
歐派家居	144	17,500.32
易點天下	985	17,454.20
美好醫療	445	16,843.25
建科股份	685	16,467.40
青島啤酒	152	16,340.00
中榮股份	815	14,775.95
維峰電子	191	14,699.36
紫建電子	290	14,433.30
元道通信	566	14,325.46
天元寵物	420	14,204.40
鼎泰高科	770	13,575.10
泓博醫藥	269	12,998.08
宏景科技	396	12,632.40
凱格精機	257	12,590.43
珠城科技	279	12,499.20
矩陣股份	516	12,316.92
一博科技	268	12,084.12
聚膠股份	235	12,081.35
新天地	439	11,317.42
天山電子	449	11,058.87
西測測試	255	10,783.95
瑞晨環保	277	10,467.83
美的集團	187	9,686.60
華新環保	819	9,336.60
逸豪新材	544	9,188.16
維海德	206	8,598.44
捷邦科技	227	8,312.74
星源卓鎂	255	7,379.70
凡拓數創	247	7,197.58
嘉曼服飾	303	6,850.83
欣靈電氣	292	6,307.20
豐立智能	337	6,241.24
唯特偶	115	6,126.05

漢儀股份	210	5,957.70
萬得凱	228	5,576.88
宏發股份	157	5,245.37
慧博雲通	359	5,140.88
新華保險	133	4,000.64
三花智控	48	1,018.56
合計	257,197,674	7,608,788,411.38
(2)債券投資		
上市投資		
中國(100%)		
22 國債 14	10,515,000	1,058,709,256.87
21 國開 18	4,700,000	474,471,824.66
21 附息國債 15	4,000,000	403,339,945.21
22 進出 22	2,500,000	251,273,082.19
22 廈門國際銀行	2,500,000	248,704,041.10
22 農發 04	2,000,000	201,821,369.86
22 國開綠債 02 清發	1,800,000	183,552,410.96
21 進出 22	1,500,000	151,441,273.97
21 進出 12	1,400,000	143,752,421.92
22 國開 06	1,000,000	101,048,054.79
22 交行綠債 02	1,000,000	100,463,265.75
22 國開清發 01	800,000	80,110,136.99
17 農發 04	500,000	52,633,767.12
22 貼現國債 53	500,000	49,764,722.53
18 國開 04	300,000	31,268,761.64
歐 22 轉債	10	1,242.98
合計	35,015,010	3,532,355,578.54
(3)資產支持證券投資		
上市投資		
中國(-)		
合計	0	0.00
(4)買入返售金融資產		
銀行間同業市場買入返售金融資產		
交易所市場買入返售金融資產		
合計		0.00
總投資資產		
銀行存款和結算備付金		928,889,326.52
其他各項資產		4,406,395.29
合計		12,074,439,711.73

補充披露2：投資組合變動表

序號	證券類別	佔基金資產淨值的比例 (%)	佔基金資產淨值的比例 (%)
		2022 年 12 月 31 日	2021 年 12 月 31 日
1	股票	63.74	52.83
2	債券	29.59	30.18
3	資產支持證券	-	-
4	買入返售金融資產	-	3.55

華夏基金管理有限公司

二〇二三年三月三十日