華夏回報證券投資基金 2023 年年度報告 2023 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:二〇二四年三月二十八日

華夏回報證券投資基金("本基金")

2023 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利弊或其表現作出保證。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投資者類別。

本基金隻有 H 類別份額可供香港投資者認購。

補充披露部分隻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 2023 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

2024年3月28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 2024 年 3 月 26 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 2023 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	6
	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 淨資產變動表	19
	7.4 報表附注	20
§8	投資組合報告	51
	8.1 期末基金資產組合情況	51
	8.2 報告期末按行業分類的股票投資組合	
	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	52
	8.4 報告期內股票投資組合的重大變動	58
	8.5 期末按債券品種分類的債券投資組合	
	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	
	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	
	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	60
	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	
	8.10 本基金投資股指期貨的投資政策	
	8.11 報告期末本基金投資的國債期貨交易情況說明	
	8.12 投資組合報告附注	61
§9	基金份額持有人信息	61
	9.1 期末基金份額持有人戶數及持有人結構	61
	9.2 期末基金管理人的從業人員持有本基金的情況	
	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	
	0 開放式基金份額變動	
_	1 重大事件披露	
	2 影響投資者決策的其他重要信息	
-	3 備查文件目錄	
814	4 補充按鬉	66

§2 基金簡介

2.1 基金基本情况

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	8,491,684,471.48 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				
15.00.00	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	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。			
尼瓜小小叶	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			
風險收益特徵	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	
2. 白 拉 爾	姓名	李彬	許俊	
信息披露負責人	聯絡電話	400-818-6666	010-66596688	
只貝八	電子郵箱	service@ChinaAMC.com	fxjd_hq@bank-of-china.com	
客戶服務電話	舌	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	法定代表人 張佑君		葛海蛟	

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	www.ChinaAMC.com

網網址	
基金年度報告備置地點	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		北京市東城區東長安街1號東方廣場安永		
	夥)	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	2023年	2022年	2021年
本期已實現收益	-197,599,581.78	-189,310,228.11	2,913,859,266.59
本期利潤	-1,401,324,842.88	-1,303,067,933.76	-2,229,564,213.74
加權平均基金份額 本期利潤	-0.1581	-0.1399	-0.2549
本期加權平均淨值 利潤率	-12.42%	-10.35%	-14.45%
本期基金份額淨值 增長率	-12.20%	-9.56%	-13.53%
3.1.2 期末資料和 指標	2023 年末	2022 年末	2021年末
期末可供分配利潤	-380,977,659.52	-201,530,140.85	125,100,145.20
期末可供分配基金 份額利潤	-0.0449	-0.0221	0.0132
期末基金資產淨值	9,773,888,390.88	11,937,144,389.67	13,840,764,145.02
期末基金份額淨值	1.151	1.311	1.465
3.1.3 累計期末指標	2023 年末	2022 年末	2021年末
基金份額累計淨值 增長率	1,254.57%	1,442.87%	1,605.97%

注: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 要低於所列數字。

- 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	-7.55%	0.65%	0.38%	0.00%	-7.93%	0.65%
過去六個月	-9.73%	0.64%	0.76%	0.00%	-10.49%	0.64%
過去一年	-12.20%	0.60%	1.50%	0.00%	-13.70%	0.60%
過去三年	-31.34%	0.91%	4.50%	0.00%	-35.84%	0.91%
過去五年	38.46%	0.93%	7.50%	0.00%	30.96%	0.93%
自基金合同 生效起至今	1,254.57%	1.00%	46.68%	0.00%	1,207.89%	1.00%

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

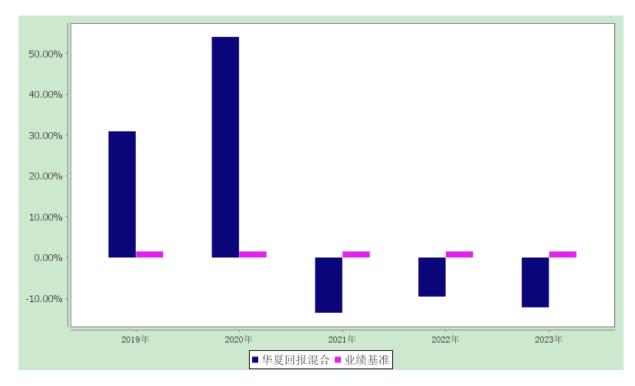
份額累計淨值增長率與業績比較基準收益率歷史走勢對比圖 (2003 年 9 月 5 日至 2023 年 12 月 31 日)



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	-
合計	3.450	1,006,526,739.03	2,021,119,721.54	3,027,646,460.57	-

§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、青島、武漢及瀋陽設有分公司,在香港、深圳、上海、北京設有子公司。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。

華夏基金是境內權益 ETF 管理規模最大的基金管理公司之一,在指數基金管理方面積累了豐富的經驗,形成了覆蓋寬基、港股、行業主題、策略、跨境、商品等較為完整的指數產品線。

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 2023 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:在北交所主題偏股型基金(A 類)中華夏北交所創新中小企業精選兩年定開混合發起式排名第 1/10;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 1/22;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 2/68、華夏消費升級混合(A 類)排名第 11/68、華夏消費龍頭混合(A 類)排名第 13/68、華夏新興消費混合(A 類)排名第 21/68;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 3/10;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 3/145、華夏中證 500 指數增強(A 類)排名第 4/145、華夏中證 1000 指數增強(A 類)排名第 20/145;在 TMT 與信息技術行業偏股型基金(A 類)中華夏數字經濟龍頭混合發起式(A 類)排名第 4/30;在新能源主題股票型基金(A 類)中華夏能源革新股票(A 類)排名第 4/14;在汽車主題行業偏股型基金(A 類)中華夏新能源車龍頭混合發起式(A 類)排名第 4/13;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 4/421、華夏穩增混合排名第 10/421;在偏股型基金(股票上限 95%)(A 類)中華夏新錦繡混合(A 類)排名第 4/216、華夏譽利一年定開混合(A 類)排名第 3/216;在標準股票型基金(A 類)中華夏智勝先鋒股票 (LOF) (A 類)排名第 8/326、華夏智勝價值成長股票(A 類)排名第 15/326。

固收與固收+產品:在普通偏債型基金(股票上限不高於 30%)(A 類)中華夏磐泰混合(LOF)(A 類)排名第 1/349、華夏穩福六個月持有混合(A 類)排名第 17/349、華夏睿磐泰興混合(A 類)排名第 28/349;在長期純債債券型基金(A 類)中華夏鼎成一年定開債券排名第 12/1340、華夏鼎航債券(A 類)排名第 14/1340;在普通債券型基金(二級)(A 類)中華夏穩享增利 6 個月債券(A 類)排名第 13/402、華夏鼎源債券(A 類)排名第 14/402、華夏卓信一年定開債券發起式排名第 25/402、華夏希望債券(A 類)排名第 32/402、華夏鼎泓債券(A 類)排名第 34/402、華夏卓享債券(A 類)排名第 38/402;在中短期純債債券型基金(A 類)中華夏中短債債券(A 類)排名第 34/137。

指數產品:在主題指數股票 ETF 基金中華夏中證動漫遊戲 ETF 排名第 2/343、華夏中證 5G 通

信主題 ETF 排名第 10/343、華夏中證雲計算與大資料主題 ETF 排名第 16/343、華夏中證人工智慧主題 ETF 排名第 20/343、華夏中證金融科技主題 ETF 排名第 24/343、華夏中證智慧汽車主題 ETF 排名第 25/343、華夏中證金融科技主題 ETF 排名第 28/343、華夏中證文娛傳媒 ETF 排名第 31/343、華夏中證機器人 ETF 排名第 39/343;在策略指數股票 ETF 基金中華夏中證智選 500 價值穩健策略 ETF 排名第 6/37、華夏中證智選 1000 價值穩健策略 ETF 排名第 10/37;在行業指數股票 ETF 基金中華夏中證全指證券公司 ETF 排名第 10/66;在規模指數股票 ETF 基金中華夏中證 1000 ETF 排名第 17/146、華夏中證 500 ETF 排名第 26/146;在主題指數股票 ETF 聯接基金(A 類)中華夏中證動漫遊戲 ETF 發起式聯接(A 類)排名第 2/125、華夏中證 5G 通信主題 ETF 聯接(A 類)排名第 6/125、華夏中證人工智慧主題 ETF 聯接(A 類)排名第 9/125、華夏中證今企 ETF 聯接(A 類)排名第 25/125;在行業指數股票 ETF 聯接基金(A 類)中華夏中證全指證券公司 ETF 聯接(A 類)排名第 6/36;在規模指數股票 ETF 聯接基金(A 類)中華夏中證全指證券公司 ETF 聯接(A 類)排名第 11/106、華夏中證 500 ETF 聯接(A 類)排名第 19/106;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 5/16;在利率債指數債券型基金(A 類)中華夏彭博政金債 1-5 年(A 類)排名第 13/115。

在《證券時報》主辦的第十八屆中國基金業"明星基金獎"評選活動上,華夏基金將兩大獎項收入 囊中:公司層面,華夏基金榮獲"三年海外投資明星基金公司";產品層面,華夏滬深 300ETF 榮獲"三 年持續回報指數型明星基金獎"。在《上海證券報》主辦的第二十屆"金基金"獎評選活動上,華夏基 金榮膺三項大獎,公司層面獲得"被動投資基金管理公司獎",產品層面華夏創新前沿股票和華夏行 業景氣混合分別榮獲股票型基金五年期獎和偏股混合型基金五年期獎。

在客戶服務方面,2023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)華夏基金直銷管道優化頁面顯示,升級搜索及查詢功能,讓客戶操作更加便利;(2)華夏基金管家用戶端優化"忘記密碼"功能及定投模組,上線親子帳戶、資產診斷等功能,貼合客戶投資需求,進一步提升使用體驗;(3)與華潤銀行、貴州銀行、武漢農商行等代銷機構合作,拓展更加豐富的客戶理財管道;(4)開展"幫你問了 ChatGPT"、"指數攻防值來啦!"、"華夏基金模擬投基大賽"、"煎熬的磨底期里找機會"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	2021-11-02	2023-05-04	28 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

	成員				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
					加八事发坐並旨任月 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)、華夏成長證券
					投資基金基金經理
					(2021年2月22日至
					2022 年 4 月 11 日期間) 等。
					碩士。曾任泰達宏利基
					金管理有限公司研究
	本基金的基				部研究員,工銀瑞信基金管理有限公司研究
王君正	金經理	2023-05-04	-	15年	並且 壁 有 സ 公 可 听 九
					基金經理等。2022 年
					10 月加入華夏基金管
	++ \ \ \ \ \ \ \ \ \ \ \ \ \ \ \ \ \ \				理有限公司。
季新星	本基金的基金經理	2021-11-02	2023-05-04	14年	碩士·曾任申萬菱信基 金管理有限公司權益
	不处于干				业 5 生 月 K A 円 惟 皿

					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	2023-05-31	8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《證券基金經營機構董事、監事、高級管理人員及從業人員監督管理辦法》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,公司對其進行年度綜合考核, 考核結果作為確定其薪酬激勵的重要參考因素之一。因此,基金經理個人薪酬激勵與其管理的私募 資產管理計劃浮動管理費或產品業績表現不直接掛鉤。

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、流程和技術手段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 255 次,均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。

- 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

2023 年全年 A 股市場下行調整,上證指數下跌 3.7%,wind 全 A 下跌 5.2%,滬深 300 指數下跌 11.4%;

從風格表現看,表現較好的主要集中在兩個風格,一是微盤股,代表性指數 wind 微盤股指數全年上漲 49.9%,二是低估值高分紅個股,代表性指數 wind 低估值指數全年上漲 11.5%;表現較差的主要集中在成長性高和估值中偏高的優質個股,代表性指數茅指數 2023 年全年下跌 14.3%,寧指數全年下跌 25.6%,科創創業 50 指數全年下跌 18.8%,創業板成長指數全年下跌 26.2%。

從行業表現看,在 AI、半導體等前沿科技的帶動下,科技板塊的 4 個行業通信、傳媒、電腦、電子全年漲幅分別為 25.8%、16.8%、9.0%、7.3%,在所有行業中最好;其次是以石油石化、煤炭、家電、機械設備為代表的低估值高分紅板塊全年漲幅 4.3%、4.1%、3.8%、3.3%,表現次優;表現最差的是以房地產、建築建材、商業貿易、食品飲料為代表的順週期行業,全年分別下跌 24.3%、20.9%、14.9%、12.4%,新能源相關板塊全年下跌 26.4%,跌幅也較大。

從 2023 年全年的市場整體、風格和行業表現看,反映的是對全市場整體盈利預期偏差,對成長

個股作為一個整體未來盈利增長下調的一種展望,所以市場更青睞低估值高分紅個股,以及無業績、無機構持倉的小市值個股。

報告期內,本基金堅持自下而上的選股方式,主要投資了醫藥醫療、消費、地產金融、科技、高端製造各細分板塊中競爭格局良好、壁壘較高、具有長期優勢的優質公司,但回過頭看,其中大部分板塊與宏觀經濟的相關性還是比較強,在經濟預期偏弱的背景下,實際是負超額收益。

4.4.2 報告期內基金的業績表現

截至 2023 年 12 月 31 日,本基金份額淨值為 1.151 元,本報告期份額淨值增長率為-12.20%,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

展望 2024 年及以後更長時間框架,在高品質發展的指引下,我們對中國經濟長期增速穩健增長、轉型升級成功仍然抱有堅定的信心。具體而言,對於科技創新和綠色發展驅動的中國經濟增長,將帶來人工智慧、機器人、生物醫藥、新能源等新興領域的投資機會;中國經濟的穩健增長及老齡化社會的逐步來臨,將帶來醫療和養老服務、物業服務等服務領域,以及更廣泛消費領域的投資機會;在以房地產和銀行、建築建材等為代表的傳統板塊經過過去 2 年多的深度調整後,我們認為行業調整已經進入後半場,競爭格局的出清和改善有望迎來曙光,對於剩者為王的優質企業,我們認為長期也有較好投資機會。

本基金的投資未來仍將堅持落實到有中長期競爭優勢的好公司上,力圖以長期價值穿越短期經濟不確定性和短期市場漲跌迷霧。

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。報告期內,公司不斷加強合規制度建設,結合法律法規和業務實際,在信息披露、洗錢風險管理、關聯交易管理等方面新增和修訂多項管理制度,制度化水平顯著提高。持續開展合規培訓,在全員覆蓋的基礎上,著重加強投資研究和基金銷售等重點業務領域的合規督導培訓,強化員工主動合規意識。積極優化合規管理的機制化和系統化,完善合規考核評價機制、子公司管理機制,大力推進合規管理綜合服務、制度管理、知識搜索等系統化建設,提高合規管理效能。持續做好信息披露業務,通過流程優化、系統優化及強

化培訓持續保障信息披露的完整性、準確性、及時性。持續規範基金銷售業務,通過嚴格審查宣傳推介文件,認真開展投資者適當性管理工作等,確保基金銷售業務依法合規。公司高度重視洗錢風險管理,深入實踐風險為本方法,認真貫徹落實各項反洗錢監管要求,持續加強"風險評估+合規檢查"雙支柱管理框架,深入推進洗錢風險管理數智化轉型,持續提升洗錢風險管理水平。

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,公司按照法規要求,做好日常合規監控,定期及不定期開展內部檢查,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

本基金本報告期未進行利潤分配,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(2024)審字第70035283 A02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 2023 年 12 月 31 日的資產負債表,2023 年 度的利潤表、淨資產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 2023 年 12 月 31 日的財務狀況以及 2023 年度的經營成果和淨資產變動情況。

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 王海彦

北京市東城區東長安街 1 號東方廣場安永大樓 17 層

2024年3月26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: 2023 年 12 月 31 日

資產	附注號	本期末	上年度末	
東座	P137-2376	2023年12月31日	2022年12月31日	
資產:				
貨幣資金	7.4.7.1	822,298,990.60	914,596,828.63	
結算備付金		2,025,719.16	14,292,497.89	
存出保證金		286,587.91	1,314,482.54	
交易性金融資產	7.4.7.2	8,986,145,913.31	11,141,143,989.92	
其中:股票投資		6,934,199,278.46	7,608,788,411.38	
基金投資		-	-	
債券投資		2,051,946,634.85	3,532,355,578.54	
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	-	-	
應收清算款		3,463,607.66	-	
應收股利		-	-	
應收申購款		1,762,766.50	3,091,912.75	
遞延所得稅資產		-	-	
其他資產	7.4.7.5	-	-	

資產總計		9,815,983,585.14	12,074,439,711.73
△ 株☆☆☆☆	77.L.\-\	本期末	上年度末
負債和淨資產	附注號	2023年12月31日	2022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		2,793,103.58	98,072,475.97
應付贖回款		14,570,792.23	5,726,893.65
應付管理人報酬		9,963,510.86	15,402,839.80
應付託管費		1,660,585.14	2,567,139.93
應付銷售服務費		-	-
應付投資顧問費		-	-
應交稅費		80,822.54	84,717.83
應付利潤		-	-
遞延所得稅負債		-	-
其他負債	7.4.7.6	13,026,379.91	15,441,254.88
負債合計		42,095,194.26	137,295,322.06
淨資產:			
實收基金	7.4.7.7	8,491,684,471.48	9,103,914,367.54
未分配利潤	7.4.7.8	1,282,203,919.40	2,833,230,022.13
淨資產合計		9,773,888,390.88	11,937,144,389.67
負債和淨資產總計		9,815,983,585.14	12,074,439,711.73

注:報告截止日 2023 年 12 月 31 日,基金份額淨值 1.151 元,基金份額總額 8,491,684,471.48 份。

7.2 利潤表

會計主體:華夏回報證券投資基金

本報告期: 2023年1月1日至2023年12月31日

		本期	上年度可比期間
項目	附注號	2023年1月1日至	2022年1月1日至
		2023年12月31日	2022年12月31日
一、營業總收入		-1,220,846,593.53	-1,082,083,463.87
1.利息收入		4,083,681.03	6,000,485.29
其中:存款利息收入	7.4.7.9	2,376,668.47	4,117,308.56
債券利息收入		-	-
資產支持證券利息收入		-	-
買入返售金融資產收入		1,707,012.56	1,883,176.73
其他利息收入		-	-
2.投資收益(損失以"-"填列)		-23,196,277.66	23,302,028.07

廿山・肌亜机炎ル芸	7.4.7.10	226 200 551 72	240 440 006 64
其中:股票投資收益	7.4.7.10	-236,200,551.72	-249,449,906.64
基金投資收益	7.4.7.11	-	-
債券投資收益	7.4.7.12	56,506,245.18	140,565,202.28
資產支持證券投資收益	7.4.7.13	-	-
貴金屬投資收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	156,498,028.88	132,186,732.43
其他投資收益		-	-
3.公允價值變動收益(損失以"-"號填列)	7.4.7.17	-1,203,725,261.10	-1,113,757,705.65
4.匯兌收益(損失以"-"號填列)		-	-
5.其他收入(損失以"-"號填列)	7.4.7.18	1,991,264.20	2,371,728.42
減:二、營業總支出		180,478,249.35	220,984,469.89
1.管理人報酬		154,328,430.64	189,158,010.61
2.託管費		25,721,405.09	31,526,335.19
3.銷售服務費		-	-
4.投資顧問費		-	-
5.利息支出		114,140.41	-
其中:賣出回購金融資產支出		114,140.41	-
6.信用減值損失	7.4.7.20	-	-
7.稅金及附加		4,428.86	1,630.42
8.其他費用	7.4.7.21	309,844.35	298,493.67
三、利潤總額(虧損總額以"-"號填		1 401 224 042 00	1 202 077 022 77
列)		-1,401,324,842.88	-1,303,067,933.76
減:所得稅費用		-	-
四、淨利潤(淨虧損以"-"號填列)		-1,401,324,842.88	-1,303,067,933.76
五、其他綜合收益的稅後淨額		-	-
六、綜合收益總額		-1,401,324,842.88	-1,303,067,933.76

7.3 淨資產變動表

會計主體:華夏回報證券投資基金

本報告期: 2023年1月1日至2023年12月31日

項目	本期 2023年1月1日至 2023年12月31日				
	實收基金	未分配利潤	淨資產合計		
一、上期期末淨資產	9,103,914,367.54	2,833,230,022.13	11,937,144,389.67		
二、本期期初淨資產	9,103,914,367.54	2,833,230,022.13	11,937,144,389.67		
三、本期增減變動額 (減少以"-"號填 列)	-612,229,896.06	1,551,026,102.73	-2,163,255,998.79		
(一)、綜合收益總額	-	-	-1,401,324,842.88		

		1,401,324,842.88			
(二)、本期基金份額		, , , ,-			
交易產生的淨資產變					
動數(淨資產減少以	-612,229,896.06	-149,701,259.85	-761,931,155.91		
"-"號填列)					
其中:1.基金申購款	627,148,039.13	179,203,335.89	806,351,375.02		
2.基金贖回款	1,239,377,935.19	-328,904,595.74	-1,568,282,530.93		
(三)、本期向基金份					
額持有人分配利潤產					
生的淨資產變動(淨	-	-	-		
資產減少以"-"號填					
列)					
四、本期期末淨資產	8,491,684,471.48	1,282,203,919.40	9,773,888,390.88		
		上年度可			
項目	2022年1月1日至2022年12月31日				
	實收基金	未分配利潤	淨資產合計		
一、上期期末淨資產	9,444,816,091.35	4,395,948,053.67	13,840,764,145.02		
二、本期期初淨資產	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	-340,901,723.81	1,562,718,031.54	-1,903,619,755.35		
列)		1,302,710,031.34			
(一)、綜合收益總額		-	1 202 067 022 76		
	-	1,303,067,933.76	-1,303,067,933.76		
(二)、本期基金份額					
交易產生的淨資產變	-340,901,723.81	-118,360,634.01	-459,262,357.82		
動數(淨資產減少以	-340,701,723.81	-110,300,034.01	-439,202,337.82		
"-"號填列)					
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					
生的淨資產變動(淨	-	-141,289,463.77	-141,289,463.77		
資產減少以"-"號填					
列)					
四、本期期末淨資產	9,103,914,367.54	2,833,230,022.13	11,937,144,389.67		

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:張佑君,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日起增加日類基金份額類別。

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(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

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。

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

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,並按照機合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。

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,隻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 目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

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。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。

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撰擇現金紅

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》及中國基金業協會中基協字[2022]566 號《關於發布<關於固定收益品種的估值處理標準》的通知》之附件《關於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

本基金本報告期無會計政策變更。

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[2014]81 號 [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內策有關問題的補充通知》、財稅[2017]56 號《關於資管產品增值稅內策有關問題的補充通知》、財稅[2017]56 號《關於資管產品增值稅內策有關問題的補充通知》、財稅[2017]56 號《關於資管產品增值稅內策有關問題的通知》、財稅[2017]90 號《關於相人固定資產進項稅額抵扣等增值稅政策的通知》、財稅[2023]39 號《關於減半徵收證券交易印花稅的公告》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。自 2023 年 8 月 28 日起,證券交易印花稅實施減半徵收。
- (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 貨幣資金

單位:人民幣元

T石口	本期末	上年度末
項目	2023年12月31日	2022年12月31日
活期存款	822,298,990.60	914,596,828.63
等於:本金	822,224,392.72	914,516,025.49
加:應計利息	74,597.88	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	822,298,990.60	914,596,828.63

7.4.7.2 交易性金融資產

	本期末					
項目		2023年12月31日				
	成本	應計利息	公允價值	公允價值變動		
股票	7,975,133,154.82	-	6,934,199,278.46	-1,040,933,876.36		
貴金屬投資-金交所黃金	-	-	-	-		

合約						
生	交所場	7,709,000.00	3,397.37	8,824,712.97	1,112,315.60	
债 券	銀行間市場	2,012,520,429.70	29,271,021.88	2,043,121,921.88	1,330,470.30	
	合計	2,020,229,429.70	29,274,419.25	2,051,946,634.85	2,442,785.90	
資產 券	支持證	-	-	1	1	
基金		-	_	-	-	
其他		-	-	-	-	
合計		9,995,362,584.52	29,274,419.25	8,986,145,913.31	-1,038,491,090.46	
項目		上年度末 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	
	屬投資- 所黃金	-	-	-	-	
生	交所場	1,053,109,322.96	9,207,107.85	1,058,710,499.85	-3,605,930.96	
债 券	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	
資産 券	支持證	-	-	-	-	
基金		_		-		
其他		-	-	-	-	
合計		10,945,872,632.74	30,037,186.54	11,141,143,989.92	165,234,170.64	

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

無。

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

無。

7.4.7.6 其他負債

單位:人民幣元

項目	本期末	上年度末
模 日	2023年12月31日	2022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	36,016.57	21,545.94
應付證券出借違約金	-	-
應付交易費用	12,270,363.34	14,699,708.94
其中:交易所市場	12,248,961.52	14,657,063.90
銀行間市場	21,401.82	42,645.04
應付利息	-	-
預提費用	220,000.00	220,000.00
合計	13,026,379.91	15,441,254.88

7.4.7.7 實收基金

金額單位:人民幣元

	_	人、 廿口			
		本期			
項目	2023 年 1 月 1 日至	至 2023 年 12 月 31 日			
	基金份額(份)	帳面金額			
上年度末	9,103,914,367.54	9,103,914,367.54			
本期申購	627,148,039.13	627,148,039.13			
本期贖回(以"-"號填列)	-1,239,377,935.19	-1,239,377,935.19			
本期末	8,491,684,471.48	8,491,684,471.48			

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	-201,530,140.85	3,034,760,162.98	2,833,230,022.13
本期期初	-201,530,140.85	3,034,760,162.98	2,833,230,022.13
本期利潤	-197,599,581.78	-1,203,725,261.10	-1,401,324,842.88
本期基金份額交易產 生的變動數	18,152,063.11	-167,853,322.96	-149,701,259.85
其中:基金申購款	-16,916,867.16	196,120,203.05	179,203,335.89
基金贖回款	35,068,930.27	-363,973,526.01	-328,904,595.74
本期已分配利潤	-	-	•
本期末	-380,977,659.52	1,663,181,578.92	1,282,203,919.40

7.4.7.9 存款利息收入

巧口	本期	上年度可比期間
項目	2023年1月1日至2023年12	2022年1月1日至2022年12

	月 31 日	月 31 日
活期存款利息收入	2,255,094.12	4,025,539.87
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	105,807.66	75,305.06
其他	15,766.69	16,463.63
合計	2,376,668.47	4,117,308.56

7.4.7.10 股票投資收益

7.4.7.10.1 股票投資收益項目構成

單位:人民幣元

	本期	上年度可比期間
項目	2023年1月1日至2023年12	2022年1月1日至2022年12
	月 31 日	月 31 日
股票投資收益——買賣股票差		
價收入	-236,200,551.72	-249,449,906.64
股票投資收益——贖回差價收		
入	-	-
股票投資收益——申購差價收		
入	-	-
股票投資收益——證券出借差		
價收入	-	-
合計	-236,200,551.72	-249,449,906.64

7.4.7.10.2 股票投資收益——買賣股票差價收入

單位:人民幣元

	本期	上年度可比期間
項目	2023年1月1日至2023年12	2022年1月1日至2022年12月
	月 31 日	31 日
賣出股票成交總額	7,414,173,251.57	6,425,866,477.15
減:賣出股票成本總額	7,629,738,832.82	6,655,571,880.61
減:交易費用	20,634,970.47	19,744,503.18
買賣股票差價收入	-236,200,551.72	-249,449,906.64

7.4.7.11 基金投資收益

無。

7.4.7.12 債券投資收益

7.4.7.12.1 債券投資收益項目構成

		7 7 17 1717
	本期	上年度可比期間
項目	2023年1月1日至2023年12月31	2022年1月1日至2022年12月31
	日	日
債券投資收益——利息收入	62,748,528.71	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	-6,242,283.53	3,907,815.54
債券投資收益——贖回差價收 入	-	-
债券投資收益——申購差價收 入	-	-
合計	56,506,245.18	140,565,202.28

7.4.7.12.2 債券投資收益——買賣債券差價收入

單位:人民幣元

	本期	上年度可比期間
項目	2023年1月1日至2023年12月31	2022年1月1日至2022年12月31
	日	日
賣出債券(債轉股及債券到期	0.200 155 669 04	14.550.221.266.20
兌付) 成交總額	9,209,155,668.04	14,550,231,266.28
減:賣出債券(債轉股及債券到	0.127.219.217.07	14 412 915 044 24
期兌付) 成本總額	9,136,218,316.07	14,412,815,044.34
減:應計利息總額	79,115,045.64	133,391,492.54
減:交易費用	64,589.86	116,913.86
買賣債券差價收入	-6,242,283.53	3,907,815.54

7.4.7.13 資產支持證券投資收益

無。

7.4.7.14 貴金屬投資收益

無。

7.4.7.15 衍生工具收益

7.4.7.15.1 衍生工具收益——買賣權證差價收入

無。

7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投資收益

無。

7.4.7.16 股利收益

	本期	上年度可比期間
項目	2023年1月1日至2023年12月31	2022年1月1日至2022年12月31
	日	日
股票投資產生的股利收益	156,498,028.88	132,186,732.43
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	156,498,028.88	132,186,732.43

7.4.7.17 公允價值變動收益

單位:人民幣元

	本期	上年度可比期間
項目名稱	2023年1月1日至2023年12月31	2022年1月1日至2022年12月31
	日	日
1.交易性金融資產	-1,203,725,261.10	-1,113,757,705.65
——股票投資	-1,213,443,754.60	-1,101,580,064.38
——債券投資	9,718,493.50	-12,177,641.27
——資產支持證券投資	ı	1
——基金投資	1	1
——貴金屬投資	1	1
——其他	1	1
2.衍生工具	ı	1
——權證投資	1	1
3.其他	1	-
減:應稅金融商品公允價值變		
動產生的預估增值稅	1	-
合計	-1,203,725,261.10	-1,113,757,705.65

7.4.7.18 其他收入

單位:人民幣元

1年口	本期	上年度可比期間
項目	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
基金贖回費收入	1,991,264.20	2,371,728.42
合計	1,991,264.20	2,371,728.42

7.4.7.19 持有基金產生的費用

無。

7.4.7.20 信用減值損失

無。

7.4.7.21 其他費用

	本期	上年度可比期間
項目	2023年1月1日至2023年12月31	2022年1月1日至2022年12月31
	日	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	52,644.35	41,293.67

銀行間帳戶維護費	36,000.00	36,000.00
其他	1,200.00	1,200.00
合計	309,844.35	298,493.67

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	
天津海鵬科技諮詢有限公司	基金管理人的股東	
MACKENZIE FINANCIAL CORPORATION	基金管理人的股東	
POWER CORPORATION OF CANADA	基金管理人的股東	
上海華夏財富投資管理有限公司("華夏財富")	基金管理人的子公司	
華夏股權投資基金管理(北京)有限公司	基金管理人的子公司	
China Asset Management (Hong Kong) Limited (中文	甘入签理人的艺八言	
名:華夏基金(香港)有限公司)	基金管理人的子公司	
華夏資本管理有限公司("華夏資本")	基金管理人的子公司	

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

	本期		上年度可比期間	
	2023年1月1日至2023年12月31日		2022年1月1日至2022年12月31日	
關聯方名稱		佔當期股		佔當期股
	成交金額	票成交總	成交金額	票成交總
		額的比例		額的比例
中信證券	6,727,239,034.60	43.93%	3,340,546,564.57	23.36%

7.4.10.1.2 權證交易

7.4.10.1.3 債券交易

金額單位:人民幣元

	本期		上年度可比期間	
	2023年1月1日至2023年12月31日		2022年1月1日至2022年12月31日	
關聯方名稱		佔當期債		佔當期債
	成交金額	券成交總	成交金額	券成交總
		額的比例		額的比例
中信證券	609,069,768.04	48.37%	472,311,316.86	82.51%

7.4.10.1.4 債券回購交易

金額單位:人民幣元

	本期		上年度可比期間	
	2023年1月1日至2023年12月31日		2022年1月1日至2022年12月31日	
關聯方名稱	成交金額	佔當期債		佔當期債
		券回購成	成交金額	券回購成
		交總額的		交總額的
		比例		比例
中信證券	908,258,000.00	100.00%	-	-

7.4.10.1.5 應支付關聯方的佣金

金額單位:人民幣元

	本期				
關聯方名稱·	2023年1月1日至2023年12月31日				
	當期	佔當期佣金	期末應付佣金餘額	佔期末應付佣金	
	佣金	總量的比例		總額的比例	
中信證券	6,271,127.46	48.63%	191,244.55	1.56%	
	上年度可比期間				
 關聯方名稱	2022年1月1日至2022年12月31日				
予	當期	佔當期佣金	期末應付佣金餘額	佔期末應付佣金	
	佣金	總量的比例	别不應门佃並邸碩	總額的比例	
中信證券	3,111,056.26	26.00%	900,477.82	6.14%	

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

	本期	上年度可比期間
項目	2023年1月1日至2023年12	2022年1月1日至2022年12
	月31日	月31日

當期發生的基金應支付的管理費	154,328,430.64	189,158,010.61
其中:應支付銷售機構的客戶維護費	37,804,810.69	45,681,967.64
應支付基金管理人的淨管理費	116,523,619.95	143,476,042.97

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 1.20%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×1.20%/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。
- ④根據 2023 年 7 月 8 日發布的《華夏基金管理有限公司關於調低旗下部分基金費率並修訂基金合同的公告》,自 2023 年 7 月 10 日起管理費率由 1.50% 調整為 1.20%。因此,本基金 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 7 月 9 日止期間的管理費率為 1.50%,2023 年 7 月 10 日至 2023 年 12 月 31 日的管理費率為 1.20%。

7.4.10.2.2 基金託管費

單位:人民幣元

	本期	上年度可比期間
項目	2023年1月1日至2023年12	2022年1月1日至2022年12
	月31日	月31日
當期發生的基金應支付的託管費	25,721,405.09	31,526,335.19

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 0.20%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×0.20%/當年天數。
- ③根據 2023 年 7 月 8 日發布的《華夏基金管理有限公司關於調低旗下部分基金費率並修訂基金合同的公告》,自 2023 年 7 月 10 日起託管費率由 0.25%調整為 0.20%。因此,本基金 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 7 月 9 日止期間的託管費率為 0.25%,2023 年 7 月 10 日至 2023 年 12 月 31 日的託管費率為 0.20%。
- 7.4.10.2.3 銷售服務費

無。

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

	本	期	上年度可比期間			
關聯方名稱	2023年1月1日至	2023年12月31日	2022年1月1日至2022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	822,298,990.60	2,255,094.12	914,596,828.63	4,025,539.87		

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

			本期		
	2	023年1月1日	至 2023 年 12 /	月 31 日	
				基金在	承銷期內買入
關聯方名稱	證券代碼	證券名稱	發行方式	數量(單	4囱入宿
				位:股/張)	總金額
中信證券	688347	華虹公司	新股發行	70,805	3,681,860.00
中信證券	688563	航材股份	新股發行	15,010	1,185,639.90
中信證券	688343	雲天勵飛	新股發行	24,961	1,096,287.12
中信證券	603296	華勤技術	新股發行	5,925	478,740.00
中信證券	688146	中船特氣	新股發行	10,101	365,151.15
中信證券	001286	001286 陝西能源		37,667	361,603.20
中信證券	301559	中集環科	新股發行	13,144	318,347.68
中信證券	301371	敷爾佳	新股發行	5,637	313,868.16
中信證券	688581	安傑思	新股發行	1,629	204,928.20
中信證券	688539	高華科技	新股發行	5,334	203,865.48
中信證券	688522	納睿雷達	新股發行	4,299	200,677.32
中信證券	301439	泓淋電力	新股發行	9,486	189,625.14
中信證券	688523	航太環宇	新股發行	4,717	103,113.62
中信證券	301293	三博腦科	新股發行	3,324	98,390.40
中信證券	301323	新萊福	新股發行	2,277	88,939.62
中信證券	688631	萊斯信息	新股發行	3,357	84,864.96

中信證券	301170	錫南科技	新股發行	2,496	84,864.00
中信證券	301157	華塑科技	新股發行	1,498	84,637.00
中信證券	601133	柏誠股份	新股發行	6,632	77,329.12
中信證券	301261	恒工精密	新股發行	1,973	72,803.70
中信證券	301517	陝西華達	新股發行	1,841	49,467.67
中信證券	603281	江瀚新材	新股發行	863	30,714.17
中信證券	001367	海森藥業	新股發行	549	24,419.52
中信證券	001324	長青科技	新股發行	1,131	21,353.28
中信證券	603162	海通發展	新股發行	523	19,481.75

上年度可比期間

2022年1月1日至2022年12月31日

銷期內買入	基金在海				
4亩人布	數量(單	發行方式	證券名稱	證券代碼	關聯方名稱
總金額	位:股/張)				
2,527,488.00	70,208	新股發行	海光信息	688041	中信證券
1,296,054.00	120,005	新股發行	中國海油	600938	中信證券
1,065,000.00	213,000	新股發行	晶科能源	688223	中信證券
826,672.00	6,832	新股發行	經緯恒潤	688326	中信證券
809,266.20	7,365	新股發行	聯影醫療	688271	中信證券
656,088.96	36,208	新股發行	益方生物	688382	中信證券
655,812.96	8,566	新股發行	大族數控	301200	中信證券
561,479.44	13,082	新股發行	海創藥業	688302	中信證券
465,192.48	5,336	新股發行	華大智造	688114	中信證券
447,604.68	3,972	新股發行	燦瑞科技	688061	中信證券
426,422.50	12,250	新股發行	軍信股份	301109	中信證券
391,212.22	12,677	新股發行	中微半導	688380	中信證券
381,721.13	11,677	新股發行	華大九天	301269	中信證券
380,533.96	9,946	新股發行	傑華特	688141	中信證券
348,700.22	10,769	新股發行	銳捷網絡	301165	中信證券
249,706.24	1,798	新股發行	信德新材	301349	中信證券
241,991.53	4,651	新股發行	華如科技	301302	中信證券
209,516.16	4,192	新股發行	天元寵物	301335	中信證券
198,636.04	20,044	新股發行	有研矽	688432	中信證券
194,459.04	3,254	新股發行	叢麟科技	688370	中信證券
184,948.48	3,776	新股發行	康為世紀	688426	中信證券
178,982.10	9,845	新股發行	易點天下	301171	中信證券
176,061.60	7,695	新股發行	鼎泰高科	301377	中信證券
124,053.30	5,626	新股發行	萊特光電	688150	中信證券
112,757.68	5,201	新股發行	天德鈺	688252	中信證券
107,480.00	2,687	新股發行	泓博醫藥	301230	中信證券
103,025.60	3,040	新股發行	景業智能	688290	中信證券
64,549.86	4,614	新股發行	佰維存儲	688525	中信證券
21,095.36	572	新股發行	天新藥業	603235	中信證券
20,224.60	1,595	新股發行	箭牌家居	001322	中信證券

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

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

本基金本報告期無利潤分配事項。

- 7.4.12 期末 (2023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

7.4.12.1.	1 受限	證券類別	1]: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
688347	華虹公司	2023- 07-27	6個月	新發 流通 受限	52.00	42.06	49,564	2,577,328.00	2,084,661.84	-
688717	艾羅 能源	2023- 12-26	6個月	新發 流通 受限	55.66	55.66	11,303	629,124.98	629,124.98	-
688717	艾羅 能源	2023- 12-26	1個月 內 (含)	新發 流通 受限	55.66	55.66	4,844	269,617.04	269,617.04	-
688563	航材 股份	2023- 07-12	6個月	新發 流通 受限	78.99	60.49	1,501	118,563.99	90,795.49	-
688548	廣鋼氣體	2023- 08-08	6個月	新發 流通 受限	9.87	12.75	4,048	39,953.76	51,612.00	-
603296	華勤技術	2023- 08-01	6個月	新發 流通 受限	80.80	77.75	593	47,914.40	46,105.75	-
301526	國際	2023-	6個月	新發	2.66	4.45	9,723	25,863.18	43,267.35	-

	複材	12-19		流通 受限						
301291	明陽電氣	2023- 06-21	6 個月	新發 流通 受限	38.13	28.36	1,206	45,984.78	34,202.16	-
301348	藍箭 電子	2023- 08-01	6個月	新發 流通 受限	18.08	44.57	613	11,083.04	27,321.41	-
688702	盛科 通信	2023- 09-06	6個月	新發 流通 受限	42.66	48.18	549	23,420.34	26,450.82	-
688582	芯動 聯科	2023- 06-21	6個月	新發 流通 受限	26.74	38.67	648	17,327.52	25,058.16	-
301559	中集環科	2023- 09-26	6個月	新發 流通 受限	24.22	18.24	1,315	31,849.30	23,985.60	-
301486	致尚 科技	2023- 06-30	6個月	新發 流通 受限	57.66	47.25	482	27,792.12	22,774.50	-
301511	德福 科技	2023- 08-08	6 個月	新發 流通 受限	28.00	22.67	982	27,496.00	22,261.94	-
688652	京儀 裝備	2023- 11-22	6 個月	新發 流通 受限	31.95	52.25	416	13,291.20	21,736.00	-
301525	儒競 科技	2023- 08-23	6個月	新發 流通 受限	99.57	81.46	266	26,485.62	21,668.36	-
301498	乖寶 寵物	2023- 08-09	6 個月	新發 流通 受限	39.99	38.81	554	22,154.46	21,500.74	-
301371	敷爾 佳	2023- 07-24	6 個月	新發 流通 受限	55.68	37.58	564	31,403.52	21,195.12	-
301370	國科 恒泰	2023- 07-03	6 個月	新發 流通 受限	13.39	16.01	1,240	16,603.60	19,852.40	-
688627	精智 達	2023- 07-11	6 個月	新發 流通 受限	46.77	87.72	222	10,382.94	19,473.84	-
301488	豪恩 汽電	2023- 06-26	6 個月	新發 流通 受限	39.78	69.09	262	10,422.36	18,101.58	-
301468	博盈	2023-	6 個月	新發	47.58	30.22	598	28,452.84	18,071.56	-

	特焊	07-12		流通 受限						
301381	賽維時代	2023- 07-05	6個月	新強	20.45	29.69	571	11,676.95	16,952.99	-
301172	君逸	2023- 07-19	6個月	新發 流通 受限	31.33	38.16	438	13,722.54	16,714.08	-
301362	民爆 光電	2023- 07-27	6個月	新發 流通 受限	51.05	38.52	420	21,441.00	16,178.40	-
688612	威邁 斯	2023- 07-19	6 個月	新發 流通 受限	47.29	37.97	422	19,956.38	16,023.34	-
601096	宏盛 華源	2023- 12-15	6 個月	新發 流通 受限	1.70	4.06	3,918	6,660.60	15,907.08	-
301393	昊帆 生物	2023- 07-05	6個月	新發 流通 受限	67.68	59.37	260	17,596.80	15,436.20	-
688610	埃科 光電	2023- 07-10	6個月	新發 流通 受限	73.33	51.00	275	20,165.75	14,025.00	-
601083	錦江航運	2023- 11-28	6個月	新發 流通 受限	11.25	11.07	1,263	14,208.75	13,981.41	-
301510	固高 科技	2023- 08-04	6個月	新發 流通 受限	12.00	35.01	396	4,752.00	13,863.96	-
301210	金楊股份	2023- 06-21	6 個月	新發 流通 受限	57.88	45.48	281	16,264.28	12,779.88	-
301566	達利凱普	2023- 12-22	6 個月	新發 流通 受限	8.90	22.14	576	5,126.40	12,752.64	-
301456	盤古智能	2023- 07-06	6 個月	新發 流通 受限	37.96	30.39	407	15,449.72	12,368.73	-
688602	康鵬 科技	2023- 07-13	6 個月	新發 流通 受限	8.66	11.06	1,066	9,231.56	11,789.96	-
688719	愛科 賽博	2023- 09-20	6個月	新發 流通 受限	69.98	60.10	194	13,576.12	11,659.40	-
301550	斯菱	2023-	6 個月	新發	37.56	43.57	260	9,765.60	11,328.20	-

	股份	09-06		流通 受限						
301292	海科新源	2023- 06-29	6個月	新發 流通 受限	19.99	19.35	583	11,654.17	11,281.05	-
301508	中機認檢	2023- 11-23	6個月	新發 流通 受限	16.82	26.68	419	7,047.58	11,178.92	-
688603	天承 科技	2023- 06-30	6個月	新發 流通 受限	55.00	74.14	140	7,700.00	10,379.60	-
301528	多浦 樂	2023- 08-17	6個月	新發 流通 受限	71.80	68.91	148	10,626.40	10,198.68	-
301329	信音 電子	2023- 07-05	6個月	新發 流通 受限	21.00	22.23	458	9,618.00	10,181.34	-
301372	科淨源	2023- 08-03	6個月	新發 流通 受限	45.00	43.59	231	10,395.00	10,069.29	-
301261	恒工 精密	2023- 06-29	6 個月	新發 流通 受限	36.90	50.85	198	7,306.20	10,068.30	-
301202	朗威 股份	2023- 06-28	6 個月	新發 流通 受限	25.82	31.80	306	7,900.92	9,730.80	-
301395	仁信 新材	2023- 06-21	6個月	新發 流通 受限	26.68	18.69	520	13,873.60	9,718.80	-
688716	中研股份	2023- 09-13	6 個月	新發 流通 受限	29.66	36.39	267	7,919.22	9,716.13	-
301413	安培龍	2023- 12-11	6個月	新發 流通 受限	33.25	58.19	164	5,453.00	9,543.16	-
301500	飛南資源	2023- 09-13	6 個月	新發 流通 受限	23.97	20.89	455	10,906.35	9,504.95	-
301418	協昌 科技	2023- 08-10	6 個月	新發 流通 受限	51.88	50.20	189	9,805.32	9,487.80	-
301516	中遠通	2023- 12-01	6 個月	新發 流通 受限	6.87	15.51	604	4,149.48	9,368.04	-
301272	英華	2023-	6 個月	新發	51.39	53.38	173	8,890.47	9,234.74	-

	特	07-06		流通 受限						
301469	恒達新材	2023- 08-10	6 個月	新發流通受限	36.58	33.09	275	10,059.50	9,099.75	-
301519	舜禹 股份	2023- 07-19	6個月	新發 流通 受限	20.93	20.21	442	9,251.06	8,932.82	-
301518	長華 化學	2023- 07-26	6個月	新發 流通 受限	25.75	23.01	385	9,913.75	8,858.85	-
301568	思泰克	2023- 11-21	6 個月	新發 流通 受限	23.23	35.58	246	5,714.58	8,752.68	-
688638	譽辰 智能	2023- 07-04	6 個月	新發 流通 受限	83.90	59.68	141	11,829.90	8,414.88	-
301459	豐茂 股份	2023- 12-06	6 個月	新發 流通 受限	31.90	39.84	208	6,635.20	8,286.72	-
688720	艾森 股份	2023- 11-29	6 個月	新發 流通 受限	28.03	49.84	165	4,624.95	8,223.60	-
301489	思泉 新材	2023- 10-16	6 個月	新發 流通 受限	41.66	64.11	128	5,332.48	8,206.08	-
688651	盛邦 安全	2023- 07-19	6 個月	新發 流通 受限	39.90	46.05	178	7,102.20	8,196.90	-
301517	陝西 華達	2023- 10-09	6 個月	新發 流通 受限	26.87	43.69	185	4,970.95	8,082.65	-
301578	辰奕 智能	2023- 12-21	6 個月	新發 流通 受限	48.94	68.32	118	5,774.92	8,061.76	-
301548	崇德 科技	2023- 09-11	6 個月	新發 流通 受限	66.80	58.99	136	9,084.80	8,022.64	-
688657	浩辰 軟件	2023- 09-25	6 個月	新發 流通 受限	103.40	78.23	101	10,443.40	7,901.23	-
688671	碧興 物聯	2023- 08-02	6個月	新發 流通 受限	36.12	34.30	226	8,163.12	7,751.80	-
688693	鍇威	2023-	6 個月	新發	40.83	43.41	178	7,267.74	7,726.98	-

	特	08-10		流通						
603275	眾辰 科技	2023- 08-16	6個月	受限 新發 流通 受限	49.97	39.70	193	9,644.21	7,662.10	-
301533	威馬農機	2023- 08-07	6個月	新發 流通 受限	29.50	33.16	225	6,637.50	7,461.00	-
603062	麥加 芯彩	2023- 10-31	6個月	新發 流通 受限	58.08	57.81	126	7,318.08	7,284.06	-
301555	惠柏 新材	2023- 10-24	6個月	新發 流通 受限	22.88	32.44	224	5,125.12	7,266.56	-
301505	蘇州 規劃	2023- 07-12	6 個月	新發 流通 受限	26.35	35.81	194	5,111.90	6,947.14	-
301529	福賽 科技	2023- 08-31	6 個月	新發 流通 受限	36.60	37.88	182	6,661.20	6,894.16	-
301515	港通 醫療	2023- 07-13	6個月	新發 流通 受限	31.16	28.27	230	7,166.80	6,502.10	-
688648	中郵科技	2023- 11-06	6個月	新發 流通 受限	15.18	21.43	303	4,599.54	6,493.29	-
001378	德冠 新材	2023- 10-23	6個月	新發 流通 受限	31.68	31.27	205	6,494.40	6,410.35	-
603004	鼎龍 科技	2023- 12-20	6個月	新發 流通 受限	16.80	31.19	195	3,276.00	6,082.05	-
603119	浙江祭泰	2023- 07-21	6個月	新發 流通 受限	15.32	23.87	226	3,462.32	5,394.62	-
001306	夏廈精密	2023- 11-09	6個月	新發 流通 受限	53.63	75.36	64	3,432.32	4,823.04	-
603075	熱威 股份	2023- 09-01	6 個月	新發 流通 受限	23.10	23.31	182	4,204.20	4,242.42	-
001358	興欣 新材	2023- 12-14	6 個月	新發 流通 受限	41.00	44.16	87	3,567.00	3,841.92	-
001239	永達	2023-	6 個月	新發	12.05	19.92	189	2,277.45	3,764.88	-

	股份	12-04		流通						
				受限						
603231	索寶蛋白	2023- 12-06	6個月	新發 流通 受限	21.29	21.53	161	3,427.69	3,466.33	-
603273	天元 智能	2023- 10-16	6個月	新發 流通 受限	9.50	18.97	178	1,691.00	3,376.66	-
603276	恒興新材	2023- 09-18	6個月	新發 流通 受限	25.73	24.88	134	3,447.82	3,333.92	-
603373	安邦護衛	2023- 12-13	6個月	新發 流通 受限	19.10	34.75	88	1,680.80	3,058.00	-

注:①根據中國證監會《上市公司證券發行註冊管理辦法》,基金參與上市公司向特定物件發 行股票所獲得的股票,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設定限售期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	1年以內	1-5年	5年以上	合計
2023年12月31日	1 牛以内	1-3 +	3 平以上	
貨幣資金	822,298,990.60	-	•	822,298,990.60
結算備付金	2,025,719.16	-	-	2,025,719.16
結算保證金	286,587.91	-	•	286,587.91
債券投資	1,867,845,487.31	184,101,147.54	•	2,051,946,634.85
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	1年以內	1-5年	5年以上	合計
2022年12月31日	1 牛丛内	1-3 +	3 牛以上	ロ市
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	-	-	-	-

注:①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。

②根據《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>》修訂版調整,2022 年年度報告中"銀行存款",本年度調整為"貨幣資金"。

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				
	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)			
分析		本期末	上年度末		
77/1/1		2023年12月31日	2022年12月31日		
	利率下降 25 個基點	2,231,699.14	9,759,463.75		
	利率上升25個基點	-2,225,199.71	-9,698,673.39		

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

	本期末		上年度末		
	2023年12月	31 日	2022年12月31日		
項目		佔基金		佔基金	
· 有日	公允價值	資產淨	公允價值	資產淨	
	(公儿)則阻	值比例	公儿俱阻	值比例	
		(%)		(%)	
交易性金融資產-股票投資	6,934,199,278.46	70.95	7,608,788,411.38	63.74	
交易性金融資產—基金投資	-	1	i	1	
交易性金融資產-債券投資	8,824,712.97	0.09	1,242.98	0.00	
交易性金融資產-貴金屬投資	-	-	-	-	
衍生金融資產-權證投資	-	1	•	1	
其他	-	-		-	
合計	6,943,023,991.43	71.04	7,608,789,654.36	63.74	

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
----	-------------------------

	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)			
分析		本期末 2023年12月31日	上年度末 2022 年 12 月 31 日		
	-5%	-351,850,466.14	-345,295,918.22		
	+5%	351,850,466.14	345,295,918.22		

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	上年度末
	2023年12月31日	2022年12月31日
第一層次	6,938,946,946.18	7,489,159,881.01
第二層次	2,044,020,663.90	3,532,740,198.96
第三層次	3,178,303.23	119,243,909.95
合計	8,986,145,913.31	11,141,143,989.92

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

	本期				
古古	2023年1月1日至2023年12月31日				
項目	交易性金	合計			
	債券投資	股票投資			

	T				
期初餘額	-	119,243,909.95	119,243,909.95		
當期購買	-	-	-		
當期出售/結算	-	-	-		
轉入第三層次	-	5,472,070.55	5,472,070.55		
轉出第三層次	-	141,728,065.42	141,728,065.42		
當期利得或損失總額	-	20,190,388.15	20,190,388.15		
其中:計入損益的利		20 100 200 15	20 100 200 15		
得或損失	-	20,190,388.15	20,190,388.15		
計入其他綜合					
收益的利得或損失	-	-	-		
(若有)					
期末餘額	-	3,178,303.23	3,178,303.23		
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	-	-434,127.22	-434,127.22		
損失的變動——公允					
價值變動損益					
		上年度可比期間			
	2022年1月1日至2022年12月31日				
項目	交易性金融資產				
	債券投資	股票投資	合計		
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	_	-	2,321,033.31		
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	-	-13,077,727.03	-13,077,727.03		
得或損失	-	-13,077,727.63	-13,077,727.63		
計入其他綜合					
山本 山本 山本 山本 山本 山本 山本 山本					
(若有)	-	-	-		
期末餘額		110 2/2 000 05	119,243,909.95		
期末仍持有的第三層	-	119,243,909.95	117,243,707.73		
一个个动态这些工术的		1			
次金融資產計入本期		12.077.727.62	12 077 707 62		
損益的未實現利得或	-	-13,077,727.63	-13,077,727.63		
	-	-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

	值	術	名稱	範圍/加權平 均值	與公允價值之 間的關係
限售股票	3,178,303.23	平均價格亞式 期權模型	預期年化波動 率	0.1462-2.1988	負相關
				不可觀察輸入值	
項目	上年度末公允 價值	採用的估值技術	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 2023 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

序號	項目	金額	佔基金總資產的比例 (%)
1	權益投資	6,934,199,278.46	70.64
	其中:股票	6,934,199,278.46	70.64
2	基金投資	-	-
3	固定收益投資	2,051,946,634.85	20.90
	其中:債券	2,051,946,634.85	20.90
	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	824,324,709.76	8.40

8	其他各項資產	5,512,962.07	0.06
9	合計	9,815,983,585.14	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	-	-
В	採礦業	994,481.81	0.01
С	製造業	4,629,314,715.44	47.36
D	電力、熱力、燃氣及水生產和供應業	16,157,638.00	0.17
Е	建築業	343,054,491.00	3.51
F	批發和零售業	64,904,667.89	0.66
G	交通運輸、倉儲和郵政業	13,981.41	0.00
Н	住宿和餐飲業	-	-
I	信息傳輸、軟件和信息技術服務業	176,190,496.81	1.80
J	金融業	645,790,719.32	6.61
K	房地產業	860,577,996.50	8.80
L	租賃和商務服務業	597,257.00	0.01
M	科學研究和技術服務業	95,547,481.10	0.98
N	水利、環境和公共設施管理業	41,523.76	0.00
О	居民服務、修理和其他服務業	-	-
P	教育	-	-
Q	衛生和社會工作	100,074,624.42	1.02
R	文化、體育和娛樂業	939,204.00	0.01
S	綜合	-	-
	合計	6,934,199,278.46	70.95

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

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	544,364	939,572,264.00	9.61
2	600048	保利發展	76,492,041	757,271,205.90	7.75
3	300750	寧德時代	3,087,020	503,986,885.20	5.16
4	601668	中國建築	71,321,100	343,054,491.00	3.51
5	600276	恒瑞醫藥	5,931,434	268,278,759.82	2.74
6	600926	杭州銀行	26,037,278	260,633,152.78	2.67
7	600862	中航高科	9,633,331	213,378,281.65	2.18
8	300760	邁瑞醫療	496,472	144,274,763.20	1.48
9	600919	江蘇銀行	21,280,800	142,368,552.00	1.46
10	300059	東方財富	8,389,525	117,788,931.00	1.21
11	300034	鋼研高納	5,681,240	115,613,234.00	1.18

12	603369	今世緣	2,352,411	114,680,036.25	1.17
13	002142	寧波銀行	5,699,614	114,619,237.54	1.17
14	600522	中天科技	8,905,640	111,231,443.60	1.14
15	688012	中微公司	721,427	110,811,187.20	1.13
16	000596	古井貢酒	467,754	108,893,131.20	1.11
17	000999	華潤三九	2,157,331	107,284,070.63	1.10
18	002179	中航光電	2,470,755	96,359,445.00	0.99
19	002025	航太電器	2,003,351	96,200,915.02	0.98
20	603259	藥明康得	1,299,779	94,571,920.04	0.97
21	300628	億聯網絡	2,973,684	87,872,362.20	0.90
22	002572	索菲亞	5,487,200	87,520,840.00	0.90
23	002371	北方華創	336,714	82,733,996.94	0.85
24	603816	顧家家居	2,349,972	82,249,020.00	0.84
25	600557	康緣藥業	3,784,200	77,651,784.00	0.79
26	603105	芯能科技	6,674,564	77,291,451.12	0.79
27	000738	航發控制	3,706,959	73,768,484.10	0.75
28	000568	瀘州老窖	333,600	59,854,512.00	0.61
29	001979	招商蛇口	6,279,320	59,841,919.60	0.61
30	600085	同仁堂	1,096,501	58,882,103.70	0.60
31	002594	比亞迪	296,380	58,683,240.00	0.60
32	300724	捷佳偉創	692,439	51,247,410.39	0.52
33	688235	百濟神州	350,311	48,707,241.44	0.50
34	002436	興森科技	3,193,458	47,039,636.34	0.48
35	000516	國際醫學	5,769,500	46,790,645.00	0.48
36	300015	愛爾眼科	2,876,006	45,498,414.92	0.47
37	300073	當升科技	1,189,517	45,439,549.40	0.46
38	600570	恒生電子	1,474,100	42,395,116.00	0.43
39	603833	歐派家居	607,044	42,256,332.84	0.43
40	300661	聖邦股份	470,526	41,881,519.26	0.43
41	600129	太極集團	807,798	37,530,295.08	0.38
42	600007	中國國貿	1,896,700	36,758,046.00	0.38
43	600893	航發動力	930,600	34,785,828.00	0.36
44	002821	凱萊英	297,234	34,508,867.40	0.35
45	603927	中科軟	1,147,963	34,415,930.74	0.35
46	300274	陽光電源	338,770	29,672,864.30	0.30
47	603848	好太太	1,720,000	26,625,600.00	0.27
48	688023	安恒信息	239,383	26,545,180.87	0.27
49	300395	菲利華	700,117	25,596,277.52	0.26
50	603939	益豐藥房	607,880	24,339,515.20	0.25
51	603801	志邦家居	1,445,720	24,244,724.40	0.25
52	300014	億緯鋰能	563,800	23,792,360.00	0.24
53	002415	海康威視	677,200	23,512,384.00	0.24
54	688120	華海清科	125,193	23,498,726.10	0.24
55	600941	中國移動	229,595	22,840,110.60	0.23
L	1	1			

_					
56	603180	金牌廚櫃	863,190	21,657,437.10	0.22
57	002422	科倫藥業	730,300	21,215,215.00	0.22
58	000963	華東醫藥	497,600	20,630,496.00	0.21
59	300604	長川科技	517,100	19,644,629.00	0.20
60	002262	恩華藥業	687,400	18,642,288.00	0.19
61	603290	斯達半導	102,351	18,525,531.00	0.19
62	688579	山大地緯	1,347,653	17,115,193.10	0.18
63	600905	三峽能源	3,697,400	16,157,638.00	0.17
64	002271	東方雨虹	826,810	15,874,752.00	0.16
65	002475	立訊精密	450,161	15,508,046.45	0.16
66	002603	以嶺藥業	670,315	15,464,167.05	0.16
67	002920	德賽西威	118,300	15,321,033.00	0.16
68	002230	科大訊飛	308,400	14,303,592.00	0.15
69	688266	澤璟製藥	240,950	12,755,893.00	0.13
70	603486	科沃斯	303,000	12,556,320.00	0.13
71	603198	迎駕貢酒	184,600	12,237,134.00	0.13
72	600887	伊利股份	456,300	12,206,025.00	0.12
73	688082	盛美上海	116,816	12,196,758.56	0.12
74	688331	榮昌生物	195,746	12,147,996.76	0.12
75	688617	惠泰醫療	31,038	12,058,263.00	0.12
76	000858	五糧液	82,300	11,547,513.00	0.12
77	600153	建發股份	1,139,800	10,976,274.00	0.11
78	002653	海思科	460,100	10,651,315.00	0.11
79	688176	亞虹醫藥	922,835	9,948,161.30	0.10
80	601939	建設銀行	1,477,600	9,619,176.00	0.10
81	300558	貝達藥業	184,921	9,532,677.55	0.10
82	600602	雲賽智聯	814,700	9,426,079.00	0.10
83	600809	山西汾酒	35,800	8,260,134.00	0.08
84	603233	大參林	318,727	7,936,302.30	0.08
85	301239	普瑞眼科	79,400	6,828,400.00	0.07
86	600771	廣譽遠	250,700	6,766,393.00	0.07
87	688351	微電生理	253,789	6,509,687.85	0.07
88	688382	益方生物	415,909	6,296,862.26	0.06
89	600563	法拉電子	63,500	5,880,100.00	0.06
90	000661	長春高新	39,800	5,802,840.00	0.06
91	688336	三生國健	248,176	5,586,441.76	0.06
92	603606	東方電纜	126,000	5,386,500.00	0.06
93	688200	華峰測控	40,063	4,919,736.40	0.05
94	603456	九洲藥業	179,700	4,350,537.00	0.04
95	300454	深信服	49,400	3,571,126.00	0.04
96	603998	方盛製藥	325,200	3,564,192.00	0.04
97	688111	金山辦公	10,414	3,292,906.80	0.03
98	002244	濱江集團	446,800	3,248,236.00	0.03
99	688428	諾誠健華	278,627	3,204,210.50	0.03
	ı			- /	i

) A) - 185			
100	300832	新產業	38,800	3,034,160.00	0.03
101	603501	韋爾股份	28,300	3,019,893.00	0.03
102	688520	神州細胞	40,198	2,165,466.26	0.02
103	688161	威高骨科	50,583	2,096,665.35	0.02
104	688347	華虹公司	49,564	2,084,661.84	0.02
105	001914	招商積餘	164,200	1,963,832.00	0.02
106	002531	天順風能	168,600	1,955,760.00	0.02
107	688180	君實生物	46,419	1,941,706.77	0.02
108	300765	新諾威	50,000	1,831,000.00	0.02
109	688256	寒武紀	11,663	1,574,038.48	0.02
110	688339	億華通	29,051	1,328,792.74	0.01
111	002050	三花智控	35,648	1,048,051.20	0.01
112	300782	卓勝微	7,200	1,015,200.00	0.01
113	600188	兗礦能源	50,201	994,481.81	0.01
114	600976	健民集團	15,100	985,275.00	0.01
115	300990	同飛股份	22,100	983,671.00	0.01
116	603506	南都物業	89,300	970,691.00	0.01
117	600079	人福醫藥	38,600	959,596.00	0.01
118	688238	和元生物	106,500	957,435.00	0.01
119	300413	芒果超媒	37,270	939,204.00	0.01
120	002790	瑞爾特	86,300	900,972.00	0.01
121	688717	艾羅能源	16,147	898,742.02	0.01
122	301267	華廈眼科	26,550	851,989.50	0.01
123	688503	聚和材料	14,720	788,992.00	0.01
124	600702	捨得酒業	8,100	783,270.00	0.01
125	000977	浪潮信息	23,200	770,240.00	0.01
126	601318	中國平安	18,900	761,670.00	0.01
127	002738	中礦資源	20,300	757,393.00	0.01
128	002756	永興材料	13,900	725,719.00	0.01
129	603039	泛微網絡	13,600	637,840.00	0.01
130	002812	恩捷股份	11,210	636,952.20	0.01
131	601888	中國中免	7,100	594,199.00	0.01
132	603589	口子窖	12,902	584,460.60	0.01
133	002865	鈞達股份	7,480	579,550.40	0.01
134	301050	雷電微力	8,400	489,384.00	0.01
135	002850	科達利	5,344	451,354.24	0.00
136	600325	華發股份	60,200	434,042.00	0.00
137	002709	天賜材料	14,740	369,679.20	0.00
138	600566	濟川藥業	11,500	361,445.00	0.00
139	002409	雅克科技	6,200	345,526.00	0.00
140	301360	榮旗科技	2,540	237,744.00	0.00
141	002304	洋河股份	1,583	173,971.70	0.00
142	605099	共創草坪	7,500	151,350.00	0.00
	-	賽輪輪胎	,	117,500.00	0.00

144	600161	天壇生物	2 770	11(022 2(0.00
144	603650		3,779	116,922.26	0.00
		形程新材	3,300	109,890.00	
146	002901	大博醫療	2,700	109,593.00	0.00
147	002044	美年健康	17,500	105,175.00	0.00
148	688236	春立醫療	3,742	98,414.60	0.00
149	002648	衛星化學	6,600	97,350.00	0.00
150	603345	安井食品	900	94,149.00	0.00
151	688085	三友醫療	4,748	92,586.00	0.00
152	688563	航材股份	1,501	90,795.49	0.00
153	600266	城建發展	18,600	90,024.00	0.00
154	603806	福斯特	3,500	84,945.00	0.00
155	688548	廣鋼氣體	4,048	51,612.00	0.00
156	600211	西藏藥業	1,000	48,800.00	0.00
157	603296	華勤技術	593	46,105.75	0.00
158	001301	尚太科技	1,200	43,944.00	0.00
159	301526	國際複材	9,723	43,267.35	0.00
160	688506	百利天恒	253	35,394.70	0.00
161	301291	明陽電氣	1,206	34,202.16	0.00
162	001311	多利科技	649	32,131.99	0.00
163	688121	卓然股份	1,399	28,301.77	0.00
164	301348	藍箭電子	613	27,321.41	0.00
165	688702	盛科通信	549	26,450.82	0.00
166	688582	芯動聯科	648	25,058.16	0.00
167	301559	中集環科	1,315	23,985.60	0.00
168	301486	致尚科技	482	22,774.50	0.00
169	301511	德福科技	982	22,261.94	0.00
170	688652	京儀裝備	416	21,736.00	0.00
171	301525	儒競科技	266	21,668.36	0.00
172	301498	乖寶寵物	554	21,500.74	0.00
173	301371	敷爾佳	564	21,195.12	0.00
174	301303	真蘭儀錶	1,058	20,832.02	0.00
175	301370	國科恒泰	1,240	19,852.40	0.00
176	688627	精智達	222	19,473.84	0.00
177	603278	大業股份	1,500	18,900.00	0.00
178	301488	豪恩汽電	262	18,101.58	0.00
179	301468	博盈特焊	598	18,071.56	0.00
180	688016	心脈醫療	88	17,127.44	0.00
181	301381	賽維時代	571	16,952.99	0.00
182	301172	君逸數碼	438	16,714.08	0.00
183	301362	民爆光電	420	16,178.40	0.00
184	688612	威邁斯	422	16,023.34	0.00
185	601096	宏盛華源	3,918	15,907.08	0.00
186	301393	昊帆生物	260	15,436.20	0.00
187	688031	星環科技	217	14,120.19	0.00
10/	000031	生农1丁1人	21/	17,140.19	0.00

188	688610	埃科光電	275	14,025.00	0.00
189	601083	錦江航運	1,263	13,981.41	0.00
190	301510	固高科技	396	13,863.96	0.00
191	301310	朗坤環境	753	13,591.65	0.00
192	301303	金楊股份	281	12,779.88	0.00
193	301566	達利凱普	576	12,752.64	0.00
194	301456	盤古智能	407	12,368.73	0.00
195	688602	康鵬科技	1,066	11,789.96	0.00
196	688719	愛科賽博	194	11,659.40	0.00
197	301550	斯菱股份	260	11,328.20	0.00
198	301292	海科新源	583	11,281.05	0.00
199	301508	中機認檢	419	11,178.92	0.00
200	688603	天承科技	140	10,379.60	0.00
201	000333	美的集團	187	10,215.81	0.00
202	301429	森泰股份	499	10,199.56	0.00
203	301528	多浦樂	148	10,198.68	0.00
204	301329	信音電子	458	10,181.34	0.00
205	301323	科淨源	231	10,069.29	0.00
206	301261	恒工精密	198	10,068.30	0.00
207	301201	朗威股份	306	9,730.80	0.00
208	301202	仁信新材	520	9,718.80	0.00
209	688716	中研股份	267	9,716.13	0.00
210	301413	安培龍	164	9,543.16	0.00
211	301500	飛南資源	455	9,504.95	0.00
212	301418	協昌科技	189	9,487.80	0.00
213	301516	中遠通	604	9,368.04	0.00
214	301272	英華特	173	9,234.74	0.00
215	301469	恒達新材	275	9,099.75	0.00
216	301519	舜禹股份	442	8,932.82	0.00
217	000888	峨眉山 A	1,000	8,930.00	0.00
218	301518	長華化學	385	8,858.85	0.00
219	301568	思泰克	246	8,752.68	0.00
220	688638	譽辰智能	141	8,414.88	0.00
221	301459	豐茂股份	208	8,286.72	0.00
222	688720	艾森股份	165	8,223.60	0.00
223	301489	思泉新材	128	8,206.08	0.00
224	688651	盛邦安全	178	8,196.90	0.00
225	301517	陝西華達	185	8,082.65	0.00
226	301578	辰奕智能	118	8,061.76	0.00
227	301548	崇德科技	136	8,022.64	0.00
228	688657	浩辰軟件	101	7,901.23	0.00
229	688671	碧興物聯	226	7,751.80	0.00
230	688693	鍇威特	178	7,726.98	0.00
231	603275	眾辰科技	193	7,662.10	0.00

232	301533	威馬農機	225	7,461.00	0.00
233	603062	麥加芯彩	126	7,284.06	0.00
234	301555	惠柏新材	224	7,266.56	0.00
235	301505	蘇州規劃	194	6,947.14	0.00
236	301529	福賽科技	182	6,894.16	0.00
237	301515	港通醫療	230	6,502.10	0.00
238	688648	中郵科技	303	6,493.29	0.00
239	001378	德冠新材	205	6,410.35	0.00
240	603004	鼎龍科技	195	6,082.05	0.00
241	603119	浙江榮泰	226	5,394.62	0.00
242	001306	夏廈精密	64	4,823.04	0.00
243	600885	宏發股份	157	4,339.48	0.00
244	603075	熱威股份	182	4,242.42	0.00
245	001358	興欣新材	87	3,841.92	0.00
246	001239	永達股份	189	3,764.88	0.00
247	688352	頎中科技	242	3,729.22	0.00
248	603231	索寶蛋白	161	3,466.33	0.00
249	603273	天元智能	178	3,376.66	0.00
250	603276	恒興新材	134	3,333.92	0.00
251	603373	安邦護衛	88	3,058.00	0.00
252	603712	七一二	64	2,016.64	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

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	422,482,643.93	3.54
2	601668	中國建築	354,157,408.19	2.97
3	600276	恒瑞醫藥	322,100,772.65	2.70
4	300750	寧德時代	281,213,554.37	2.36
5	600919	江蘇銀行	234,577,110.28	1.97
6	002142	寧波銀行	229,065,111.69	1.92
7	300628	億聯網絡	213,951,140.03	1.79
8	603259	藥明康得	173,398,331.40	1.45
9	000999	華潤三九	166,083,974.68	1.39
10	600862	中航高科	164,280,373.07	1.38
11	600522	中天科技	156,626,372.83	1.31
12	001979	招商蛇口	153,488,849.68	1.29
13	603369	今世緣	144,741,974.40	1.21
14	600926	杭州銀行	144,342,299.42	1.21
15	603589	口子窖	142,580,968.84	1.19

16	601838	成都銀行	140,119,626.50	1.17
17	600129	太極集團	134,893,383.30	1.13
18	000596	古井貢酒	134,701,487.78	1.13
19	603105	芯能科技	118,181,455.67	0.99
20	600372	中航機載	116,580,083.62	0.98

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	600941	中國移動	672,315,557.74	5.63
2	600009	上海機場	304,066,305.38	2.55
3	002304	洋河股份	301,757,274.24	2.53
4	600383	金地集團	213,862,996.48	1.79
5	601838	成都銀行	183,983,192.31	1.54
6	603259	藥明康得	178,410,581.44	1.49
7	300628	億聯網絡	178,102,582.89	1.49
8	001979	招商蛇口	171,458,849.72	1.44
9	601318	中國平安	170,074,380.87	1.42
10	600298	安琪酵母	136,762,064.56	1.15
11	002142	寧波銀行	125,316,755.40	1.05
12	600893	航發動力	119,069,695.44	1.00
13	000999	華潤三九	118,824,041.16	1.00
14	601166	興業銀行	117,404,118.23	0.98
15	002013	中航機電(退市)	116,580,083.62	0.98
16	600372	中航機載	112,789,524.50	0.94
17	600129	太極集團	112,250,778.78	0.94
18	300450	先導智能	111,170,045.67	0.93
19	603589	口子窖	110,135,279.34	0.92
20	601601	中國太保	106,398,845.20	0.89

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	8,168,593,454.50
賣出股票收入(成交)總額	7,414,173,251.57

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	-	-
2	央行票據	-	-
3	金融債券	2,009,379,279.26	20.56
	其中:政策性金融債	2,009,379,279.26	20.56
4	企業債券	1	-
5	企業短期融資券	16,165,140.98	0.17
6	中期票據	17,577,501.64	0.18
7	可轉債(可交換債)	8,824,712.97	0.09
8	同業存單	1	-
9	其他	ı	-
10	合計	2,051,946,634.85	20.99

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

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	230206	23 國開 06	11,600,000	1,175,009,639.34	12.02
2	230401	23 農發 01	3,900,000	398,126,210.96	4.07
3	220322	22 進出 22	2,500,000	252,142,281.42	2.58
4	2202002QF	22 國開綠 債 02 清發	1,800,000	184,101,147.54	1.88
5	102100018	21 深圳地 鐵 MTN001	170,000	17,577,501.64	0.18

- 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 報告期內,本基金投資決策程序符合相關法律法規的要求,未發現本基金投資的前十名證券的 發行主體本期出現被監管部門立案調查,或在報告編製日前一年內受到公開譴責、處罰的情形。
- 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	286,587.91
2	應收清算款	3,463,607.66
3	應收股利	-
4	應收利息	-
5	應收申購款	1,762,766.50
6	其他應收款	-
7	待攤費用	-
8	其他	-
9	合計	5,512,962.07

8.12.4 期末持有的處於轉股期的可轉換債券明細

金額單位:人民幣元

序號	債券代碼	債券名稱	公允價值	佔基金資產淨值比例 (%)
1	113655	歐 22 轉債	1,052.83	0.00

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的說明

本基金本報告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

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 戶均持有的	持有人結構
--------------	-------

(戶)	基金份額	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
907,481	9,357.42	37,634,100.17	0.44%	8,454,050,371.31	99.56%

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	3,577,580.26	0.04%	

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	>100

§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	9,103,914,367.54
本報告期基金總申購份額	627,148,039.13
減:本報告期基金總贖回份額	1,239,377,935.19
本報告期基金拆分變動份額	-
本報告期期末基金份額總額	8,491,684,471.48

§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,張佑君先生擔任本基金管理人董事長,楊明輝先生離任本基金管理人董事長。

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

本報告期未發生影響基金管理人經營或基金運營業務的訴訟。

本報告期無涉及基金財產、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 21 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,本基金託管人的託管業務部門及其相關高級管理人員無受稽查或處罰等情況。

- 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况

金額單位:人民幣元

	交易	股票交易		應支付該券商的佣金		
券商名稱	單元		佔當期股		佔當期佣	備註
分间石件	製量	成交金額	票成交總	佣金	金總量的	用正
	数里		額的比例		比例	
中信證券	4	6,727,239,034.60	43.93%	6,271,127.46	48.63%	-
長江證券	2	2,560,044,085.16	16.72%	1,967,781.71	15.26%	-
興業證券	2	1,578,636,280.30	10.31%	1,158,872.35	8.99%	-
德邦證券	1	1,543,671,557.11	10.08%	1,128,889.63	8.75%	-
海通證券	2	707,419,856.92	4.62%	661,401.38	5.13%	-
中天證券	1	654,518,207.46	4.27%	481,979.09	3.74%	-
國都證券	1	492,013,769.73	3.21%	364,364.30	2.83%	-
西南證券	2	414,954,230.04	2.71%	386,446.78	3.00%	-
川財證券	1	350,913,549.09	2.29%	261,746.76	2.03%	-
西部證券	1	285,382,702.55	1.86%	212,865.45	1.65%	-

- 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平: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信息和服務。
- 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,本基金還選擇了財通證券、東方證券、廣發證券、國泰君安證券、國投證券、恒泰證券、瑞銀證券、申萬巨集源、申萬巨集源證券、信達證券、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本報告期內,本基金租用的券商交易單元未發生變更。
- 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

	債券交易	易	債券回購	交易	權證多	で 易	基金	交易
券商名稱	成交金額	佔當期 債券成 交總額 的比例	成交金額	佔當期 債券成額 上例 比例	成交金額	佔期證 交額 比 當權 成總的 例	成交金額	佔當期基金成交總額的比例
中信證券	609,069,768.04	48.37%	908,258,000.00	100.00%	-	-	-	-
長江證券	449,889,579.81	35.73%	ı	1	1	-	1	1
興業證券	100,000,000.00	7.94%	ı	1	1	-	1	1
德邦證券	-	-	ı	1	1	-	1	1
海通證券	100,079,420.00	7.95%	ı	1	1	-	1	1
中天證券	-	-	1	ı	1	-	1	-
國都證券	190,908.74	0.02%	-	-	-	-	ı	-
西南證券	-	-	-	-	-	-	-	-
川財證券	-	-	-	-	1	-	ı	-
西部證券	-	-	-	-	-	-	-	-

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	華夏基金管理有限公司公告	中國證監會指定報刊及 網站	2023-01-06
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	2023-01-19
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	2023-02-24
4	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	2023-03-03

	聯方承銷證券的公告	網站	
_	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 02 11
5	聯方承銷證券的公告	網站	2023-03-11
	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 02 22
6	聯方承銷證券的公告	網站	2023-03-23
7	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	2023-03-30
/	聯方承銷證券的公告	網站	2023-03-30
8	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	2023-04-01
0	聯方承銷證券的公告	網站	2023-04-01
9	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	2023-04-13
	聯方承銷證券的公告	網站	2023 01 13
10	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	2023-04-15
	聯方承銷證券的公告	網站	
11	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	2023-04-27
	聯方承銷證券的公告	網站	
12	華夏基金管理有限公司關於調整華夏回報證	中國證監會指定報刊及	2023-05-06
	券投資基金基金經理的公告 基票基本 然 理	網站	
13	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	2023-05-13
	聯方承銷證券的公告 若喜せる管理を関う国際が無てせる地交際	網站	
14	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	2023-05-27
	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	
15	聯方承銷證券的公告	網站	2023-05-31
	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	
16	聯方承銷證券的公告	網站	2023-06-21
	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	
17	聯方承銷證券的公告	網站	2023-07-01
	華夏基金管理有限公司關於調低旗下部分基	中國證監會指定報刊及	
18	金費率並修訂基金合同的公告	網站	2023-07-08
10	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 14
19	聯方承銷證券的公告	網站	2023-07-14
20	華夏基金管理有限公司關於設立武漢分公司	中國證監會指定報刊及	2023-07-20
20	的公告	網站	2023-07-20
21	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	2023-07-26
21	聯方承銷證券的公告	網站	2023-07-20
22	華夏基金管理有限公司關於設立瀋陽分公司	中國證監會指定報刊及	2023-07-26
	的公告	網站	
23	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	2023-07-29
	聯方承銷證券的公告	網站	
24	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	2023-08-03
	聯方承銷證券的公告	網站	
25	華夏基金管理有限公司公告	中國證監會指定報刊及	2023-09-22
2.5	<u> </u>	網站	2022 00 27
26	華夏基金管理有限公司關於杭州分公司營業	中國證監會指定報刊及	2023-09-27

	場所變更的公告	網站	
27	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 00 28
27	聯方承銷證券的公告	網站	2023-09-28
20	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 10 11
28	聯方承銷證券的公告	網站	2023-10-11
20	華夏基金管理有限公司關於設立華夏股權投	中國證監會指定報刊及	2022 10 12
29	資基金管理(北京)有限公司的公告	網站	2023-10-12

§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	544.264	020 572 264 00
	544,364	939,572,264.00
保利發展 寧德時代	76,492,041	757,271,205.90
	3,087,020	503,986,885.20
中國建築	71,321,100	343,054,491.00
恒瑞醫藥	5,931,434	268,278,759.82
杭州銀行	26,037,278	260,633,152.78
中航高科	9,633,331	213,378,281.65
邁瑞醫療	496,472	144,274,763.20
江蘇銀行	21,280,800	142,368,552.00
東方財富	8,389,525	117,788,931.00
鋼研高納	5,681,240	115,613,234.00
今世緣	2,352,411	114,680,036.25
寧波銀行	5,699,614	114,619,237.54
中天科技	8,905,640	111,231,443.60
中微公司	721,427	110,811,187.20
古井貢酒	467,754	108,893,131.20
華潤三九	2,157,331	107,284,070.63
中航光電	2,470,755	96,359,445.00
航太電器	2,003,351	96,200,915.02
藥明康得	1,299,779	94,571,920.04
億聯網絡	2,973,684	87,872,362.20
索菲亞	5,487,200	87,520,840.00
北方華創	336,714	82,733,996.94
顧家家居	2,349,972	82,249,020.00
康緣藥業	3,784,200	77,651,784.00
芯能科技	6,674,564	77,291,451.12
航發控制	3,706,959	73,768,484.10
瀘州老窖	333,600	59,854,512.00
招商蛇口	6,279,320	59,841,919.60
同仁堂	1,096,501	58,882,103.70
比亞迪	296,380	58,683,240.00
捷佳偉創	692,439	51,247,410.39
百濟神州	350,311	48,707,241.44
興森科技	3,193,458	47,039,636.34
國際醫學	5,769,500	46,790,645.00
愛爾眼科	2,876,006	45,498,414.92
當升科技	1,189,517	45,439,549.40
恒生電子	1,474,100	42,395,116.00
 歐派家居	607,044	42,256,332.84
聖邦股份	470,526	41,881,519.26
太極集團	807,798	37,530,295.08
中國國貿	1,896,700	36,758,046.00
航發動力	930,600	34,785,828.00
凱萊英	297,234	34,508,867.40

中科軟	1,147,963	34,415,930.74
陽光電源	338,770	29,672,864.30
好太太	1,720,000	26,625,600.00
安恒信息	239,383	26,545,180.87
新利 華	700,117	25,596,277.52
まれず 益豊藥房	607,880	24,339,515.20
		24,244,724.40
	1,445,720	23,792,360.00
億緯鋰能	563,800	
海康威視	677,200	23,512,384.00
華海清科	125,193	23,498,726.10
中國移動	229,595	22,840,110.60
金牌廚櫃	863,190	21,657,437.10
科倫藥業	730,300	21,215,215.00
華東醫藥	497,600	20,630,496.00
長川科技	517,100	19,644,629.00
恩華藥業	687,400	18,642,288.00
斯達半導	102,351	18,525,531.00
山大地緯	1,347,653	17,115,193.10
三峽能源	3,697,400	16,157,638.00
東方雨虹	826,810	15,874,752.00
立訊精密	450,161	15,508,046.45
以嶺藥業	670,315	15,464,167.05
德賽西威	118,300	15,321,033.00
科大訊飛	308,400	14,303,592.00
澤璟製藥	240,950	12,755,893.00
科沃斯	303,000	12,556,320.00
迎駕貢酒	184,600	12,237,134.00
伊利股份	456,300	12,206,025.00
盛美上海	116,816	12,196,758.56
榮昌生物	195,746	12,147,996.76
惠泰醫療	31,038	12,058,263.00
五糧液	82,300	11,547,513.00
建發股份	1,139,800	10,976,274.00
海思科	460,100	10,651,315.00
亞虹醫藥	922,835	9,948,161.30
建設銀行	1,477,600	9,619,176.00
貝達藥業	184,921	9,532,677.55
雲賽智聯	814,700	9,426,079.00
山西汾酒	35,800	8,260,134.00
大參林	318,727	7,936,302.30
普瑞眼科	79,400	6,828,400.00
廣譽遠	250,700	6,766,393.00
微電生理	253,789	6,509,687.85
益方生物	415,909	6,296,862.26

法拉電子	63,500	5,880,100.00
長春高新	39,800	5,802,840.00
三生國健	248,176	5,586,441.76
東方電纜	126,000	5,386,500.00
華峰測控	40,063	4,919,736.40
九洲藥業	179,700	4,350,537.00
深信服	49,400	3,571,126.00
方盛製藥	325,200	3,564,192.00
金山辦公	10,414	3,292,906.80
濱江集團	446,800	3,248,236.00
諾誠健華	278,627	3,204,210.50
新產業	38,800	3,034,160.00
韋爾股份	28,300	3,019,893.00
神州細胞	40,198	2,165,466.26
威高骨科	50,583	2,096,665.35
華虹公司	49,564	2,084,661.84
招商積餘	164,200	1,963,832.00
天順風能	168,600	1,955,760.00
君實生物	46,419	1,941,706.77
新諾威	50,000	1,831,000.00
寒武紀	11,663	1,574,038.48
億華通	29,051	1,328,792.74
三花智控	35,648	1,048,051.20
卓勝微	7,200	1,015,200.00
克礦能源	50,201	994,481.81
健民集團	15,100	985,275.00
同飛股份	22,100	983,671.00
南都物業	89,300	970,691.00
人福醫藥	38,600	959,596.00
和元生物	106,500	957,435.00
芒果超媒	37,270	939,204.00
瑞爾特	86,300	900,972.00
艾羅能源	16,147	898,742.02
華廈眼科	26,550	851,989.50
聚和材料	14,720	788,992.00
捨得酒業	8,100	783,270.00
浪潮信息	23,200	770,240.00
中國平安	18,900	761,670.00
中礦資源	20,300	757,393.00
永興材料	13,900	725,719.00
泛微網絡	13,600	637,840.00
恩捷股份	11,210	636,952.20
中國中免	7,100	594,199.00
口子窖	12,902	584,460.60

约法机八	7.490	570 550 40
<u> </u>	7,480	579,550.40
雷電微力	8,400	489,384.00
科達利	5,344	451,354.24
華發股份	60,200	434,042.00
天賜材料	14,740	369,679.20
濟川藥業	11,500	361,445.00
雅克科技	6,200	345,526.00
榮旗科技	2,540	237,744.00
洋河股份	1,583	173,971.70
共創草坪	7,500	151,350.00
賽輪輪胎	10,000	117,500.00
天壇生物	3,779	116,922.26
彤程新材	3,300	109,890.00
大博醫療	2,700	109,593.00
美年健康	17,500	105,175.00
春立醫療	3,742	98,414.60
衛星化學	6,600	97,350.00
安井食品	900	94,149.00
三友醫療	4,748	92,586.00
航材股份	1,501	90,795.49
城建發展	18,600	90,024.00
福斯特	3,500	84,945.00
廣鋼氣體	4,048	51,612.00
西藏藥業	1,000	48,800.00
華勤技術	593	46,105.75
尚太科技	1,200	43,944.00
國際複材	9,723	43,267.35
百利天恒	253	35,394.70
明陽電氣	1,206	34,202.16
多利科技	649	32,131.99
卓然股份	1,399	28,301.77
藍箭電子	613	27,321.41
盛科通信	549	26,450.82
	648	25,058.16
中集環科	1,315	23,985.60
致尚科技	482	22,774.50
德福科技	982	22,261.94
京儀裝備	416	21,736.00
儒競科技	266	21,668.36
乖寶寵物	554	21,500.74
敷爾佳	564	21,195.12
真蘭儀錶	1,058	20,832.02
國科恒泰	1,240	19,852.40
精智達	222	19,473.84

1. 平口 1/7	1.500	10.000.00
大業股份	1,500	18,900.00
豪恩汽電	262	18,101.58
博盈特焊	598	18,071.56
心脈醫療	88	17,127.44
賽維時代	571	16,952.99
君逸數碼	438	16,714.08
民爆光電	420	16,178.40
威邁斯	422	16,023.34
宏盛華源	3,918	15,907.08
昊帆生物	260	15,436.20
星環科技	217	14,120.19
埃科光電	275	14,025.00
錦江航運	1,263	13,981.41
固高科技	396	13,863.96
朗坤環境	753	13,591.65
金楊股份	281	12,779.88
達利凱普	576	12,752.64
盤古智能	407	12,368.73
康鵬科技	1,066	11,789.96
愛科賽博	194	11,659.40
斯菱股份	260	11,328.20
海科新源	583	11,281.05
中機認檢	419	11,178.92
天承科技	140	10,379.60
美的集團	187	10,215.81
森泰股份	499	10,199.56
多浦樂	148	10,198.68
信音電子	458	10,181.34
科淨源	231	10,069.29
恒工精密	198	10,068.30
朗威股份	306	9,730.80
仁信新材	520	9,718.80
中研股份	267	9,716.13
安培龍	164	9,543.16
飛南資源	455	9,504.95
協昌科技	189	9,487.80
中遠通	604	9,368.04
英華特	173	9,234.74
恒達新材	275	9,099.75
舜禹股份	442	8,932.82
峨眉山 A	1,000	8,930.00
長華化學	385	8,858.85
思泰克	246	8,752.68
響辰智能	141	8,414.88

豐茂股份	208	8,286.72
艾森股份	165	8,223.60
思泉新材	128	8,206.08
盛邦安全	178	8,196.90
陝西華達	185	8,082.65
辰奕智能	118	8,061.76
崇德科技	136	8,022.64
浩辰軟件	101	7,901.23
碧興物聯	226	7,751.80
	178	7,726.98
眾辰科技	193	7,662.10
威馬農機	225	7,461.00
麥加芯彩	126	7,284.06
惠柏新材	224	7,266.56
蘇州規劃	194	6,947.14
福賽科技	182	6,894.16
港通醫療	230	6,502.10
中郵科技	303	6,493.29
	205	6,410.35
鼎龍科技	195	6,082.05
浙江榮泰	226	5,394.62
夏廈精密	64	4,823.04
宏發股份	157	4,339.48
熱威股份	182	4,242.42
興欣新材	87	3,841.92
永達股份	189	3,764.88
頎中科技	242	3,729.22
索寶蛋白	161	3,466.33
天元智能	178	3,376.66
恒興新材	134	3,333.92
安邦護衛	88	3,058.00
七一二	64	2,016.64
合計	338,843,536	6,934,199,278.46
(2)債券投資		
上市投資		
中國(100%)		
23 國開 06	11,600,000	1,175,009,639.34
23 農發 01	3,900,000	398,126,210.96
22 進出 22	2,500,000	252,142,281.42
22 國開綠債 02 清發	1,800,000	184,101,147.54
21 深圳地鐵 MTN001	170,000	17,577,501.64
23 浙交投 SCP008	160,000	16,165,140.98
芯能轉債	77,080	8,823,660.14
L Control of the Cont	· · · · · · · · · · · · · · · · · · ·	

歐 22 轉債	10	1,052.83
合計	20,207,090	2,051,946,634.85
(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		8,986,145,913.31
銀行存款和結算備付金		824,324,709.76
其他各項資產		5,512,962.07
合計		9,815,983,585.14

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	佔基金資產淨值的比例
		例 (%)	(%)
		2023年12月31日	2022年12月31日
1	股票	70.95	63.74
2	債券	20.99	29.59
3	資產支持證券	-	-
4	買入返售金融資產	-	-

華夏基金管理有限公司

二〇二四年三月二十八日