

# 華夏回報證券投資基金

## 2021 年中期報告

### 2021 年 6 月 30 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

報告送出日期：二〇二一年八月三十日

華夏回報證券投資基金(“本基金”)

2021 年半年度報告

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。

在半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。

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 2021 年半年度報告一併閱覽。

華夏基金(香港)有限公司

香港代表

二〇二一年八月三十日

## §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。本中期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 2021 年 8 月 27 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。

本報告中財務資料未經審計。

本報告期自 2021 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目錄

§1 重要提示及目錄.....	1
§2 基金簡介.....	3
§3 主要財務指標和基金淨值表現.....	4
3.1 主要會計資料和財務指標.....	4
3.2 基金淨值表現.....	4
§4 管理人報告.....	5
§5 託管人報告.....	10
§6 中期報告財務會計報告（未經審計）.....	11
6.1 資產負債表.....	11
6.2 利潤表.....	12
6.3 所有者權益（基金淨值）變動表.....	13
6.4 報表附注.....	14
§7 投資組合報告.....	37
7.1 期末基金資產組合情況.....	37
7.2 報告期末按行業分類的股票投資組合.....	37
7.3 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.....	38
7.4 報告期內股票投資組合的重大變動.....	42
7.5 期末按債券品種分類的債券投資組合.....	43
7.6 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.....	44
7.7 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.....	44
7.8 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.....	44
7.9 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.....	44
7.10 報告期末本基金投資的股指期貨交易情況說明.....	44
7.11 報告期末本基金投資的國債期貨交易情況說明.....	44
7.12 投資組合報告附注.....	44
§8 基金份額持有人信息.....	45
§9 開放式基金份額變動.....	46
§10 重大事件披露.....	46
§11 影響投資者決策的其他重要信息.....	50
§12 備查文件目錄.....	50
§13 補充披露.....	51

## §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	8,495,156,518.98 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
	聯絡電話	400-818-6666	010-66594319
	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》
----------------	--------

刊登基金中期報告正文的管理人互聯網網址	www.ChinaAMC.com
基金中期報告備置地地點	基金管理人和基金託管人的住所

## 2.5 其他相關資料

項目	名稱	辦公地址
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 主要財務指標和基金淨值表現

### 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	報告期（2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日）
本期已實現收益	1,015,818,198.50
本期利潤	284,557,135.50
加權平均基金份額本期利潤	0.0348
本期加權平均淨值利潤率	1.76%
本期基金份額淨值增長率	1.70%
3.1.2 期末資料和指標	報告期末(2021年6月30日)
期末可供分配利潤	112,993,860.42
期末可供分配基金份額利潤	0.0133
期末基金資產淨值	16,678,017,143.84
期末基金份額淨值	1.963
3.1.3 累計期末指標	報告期末(2021年6月30日)
基金份額累計淨值增長率	1,906.41%

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
過去一個月	-2.64%	1.06%	0.12%	0.00%	-2.76%	1.06%
過去三個月	7.92%	1.12%	0.37%	0.00%	7.55%	1.12%
過去六個月	1.70%	1.45%	0.74%	0.00%	0.96%	1.45%

過去一年	35.22%	1.25%	1.50%	0.00%	33.72%	1.25%
過去三年	68.87%	1.12%	4.50%	0.00%	64.37%	1.12%
自基金合同生效起至今	1,906.41%	1.02%	42.92%	0.00%	1,863.49%	1.02%

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 2021 年 6 月 30 日)



## §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、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，以及特定客戶資產管理人、保險資金投資管理人，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，目前旗下管理上證 50ETF(510050)、300ETF 基金(510330)、MSCIA 股 ETF(512990)、500ETF 基金(512500)、中小 100(159902)、雙創基金(159783)、創業板 HX(159957)、科創 50ETF(588000)、中證 1000(159845)、央企改革 ETF(512950)、四川國改(159962)、浙江國資 ETF(515760)、戰略新興 ETF(512770)、5GETF(515050)、人工智慧 AIETF(515070)、晶片 ETF(159995)、新能源車 ETF(515030)、智能車(159888)、高端裝備 ETF(516320)、大灣區(159983)、滬港深 ETF(517170)、消費 ETF 基金(510630)、金融地產 ETF(510650)、醫藥衛生 ETF(510660)、食品飲料 ETF(515170)、券商 ETF 基金(515010)、銀行 ETF 華夏(515020)、房地產 ETF 基金(515060)、大資料 50ETF(516000)、生物科技 ETF(516500)、新能源 80ETF(516850)、遊戲 ETF(159869)、有色 50ETF(516650)、創藍籌(159966)、創成長(159967)、恒生 ETF(513660)、恒生 ETF(159920)、恒生科技指數 ETF(513180)、恒生互聯網 ETF(513330)、H 股 50(159850)、日經 ETF(513520)、納斯達克 ETF(513300)、中期信用 ETF(511280)、豆粕 ETF(159985)、黃金 ETF(518850)，初步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 2021 年 6 月 30 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 QDII 混合基金（A 類）中華夏新時代混合（QDII）排序第 1/36、華夏移動互聯混合（QDII）排序第 4/36；在其他行業股票型基金（A 類）中華夏能源革新股票排序第 2/36；在消費行業偏股型基金（股票上下限 60%-95%）（A 類）中華夏新興消費混合（A 類）排序第 2/21；在標準股票型基金（A 類）中華夏潛龍精選股票排序第 37/226；在絕對收益目標基金（A 類）中華夏回報混合（A 類）排序第 25/139、華夏回報二號混合排序第 27/139；在靈活配置型基金（股票上下限 0-95%+基準股票比例 30%60%）（A 類）中華夏軍工安全混合排序第 39/491；在靈活配置型基金（股票上下限 0-95%+基準股票比例 30%-60%）（A 類）中華夏高端製造混合排序第 15/491、華夏穩盛混合排序第 54/491；在偏股型基金（股票上下限 60%-95%）（A 類）中華夏行業景氣混合排序第 9/566、華夏行業龍頭混合排序第 36/566；在偏股型基金（股票上限 80%）（A 類）中華夏經典混合排序第 11/128；在偏股型基金（股票上限 95%）（A 類）中華夏興和混合排序第 11/168、華夏興華混合（A 類）排序第 32/168、華夏大盤精選混合（A 類）排序第 40/168；在偏債型基金（A 類）中華夏睿磐泰茂混合



(A 類)排序第 44/149。FOF 類產品中，在養老目標風險 FOF（權益資產 0-30%）(A 類) 中華夏穩健養老一年持有混合 (FOF) 排序第 4/20；在 QDII 混合基金 (A 類) 中華夏全球聚享 (QDII) (A 類) 排序第 10/36；

固收與固收+產品：在普通債券型基金（可投轉債）(A 類) 中華夏聚利債券排序第 1/196、華夏雙債債券(A 類)排序第 3/196、華夏債券(A/B 類)排序第 12/196；在可轉換債券型基金 (A 類) 中華夏可轉債增強債券(A 類)排序第 3/34；在定期開放式純債債券型基金（攤餘成本法）(A 類) 中華夏恒泰 64 個月定開債券排序第 12/73；在短期純債債券型基金(A 類)中華夏短債債券(A 類)排序第 12/53；在偏債型基金 (A 類) 中華夏永康添福混合排序第 18/149；在普通債券型基金（二級）(A 類) 中華夏安康債券(A 類)排序第 40/248、華夏鼎利債券(A 類)排序第 41/248。在 QDII 債券型基金（非 A 類）中華夏收益債券 (QDII) (A 類)(美元)排序第 2/35、華夏大中華信用債券 (QDII) (A 類)（美元）排序第 4/35；

指數與量化產品：在策略指數股票 ETF 基金中華夏創成長 ETF 排序第 1/22、華夏創藍籌 ETF 排序第 6/22；在規模指數股票 ETF 基金中華夏創業板 ETF 排序第 1/90、華夏 MSCI 中國 A 股國際通 ETF 排序第 26/90；在行業指數股票 ETF 基金中華夏消費 ETF 排序第 4/39、華夏醫藥 ETF 排序第 5/39；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)排序第 6/93；在主題指數股票 ETF 基金中華夏中證新能源汽車 ETF 排序第 3/88、華夏中證四川國改 ETF 排序第 8/88、華夏戰略新興成指 ETF 排序第 11/88。

在《上海證券報》主辦的第十八屆“金基金”獎評選活動上，華夏基金憑藉卓越的投資實力以及優秀的中長期業績回報，榮膺四大獎項：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，華夏創新前沿股票榮獲“金基金·股票型基金三年期獎”，華夏滬深 300ETF 榮獲“金基金·指數基金三年期獎”，華夏能源革新股票榮獲“金基金·社會責任投資 (ESG) 基金獎”。

在客戶服務方面，2021 年上半年度，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) 華夏基金管家用戶端上線理財小管家和微信登錄等功能，方便客戶及時了解市場觀點、投資者教育等信息，也為客戶提供了多樣的登錄方式；(2) 華夏基金公眾號上線選基助手微信小程序，包含花樣選基、目標選基、我的實驗田等 5 大功能模組，說明客戶進行產品篩選；(3) 與民商基金銷售、眾惠基金等代銷機構合作，提供更多便捷的理財管道；(4) 開展“都 2021 年了，你還要自己記麼？”、“震盪市需要口服鎮心丸”、“風往哪吹”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	證券從業	說明
----	----	-----------	------	----

		(助理) 期限		年限	
		任職日期	離任日期		
林青澤	本基金的基金經理	2019-08-15	-	8 年	碩士。2013 年 8 月加入華夏基金管理有限公司。曾任研究員、投資經理助理、投資經理等。
蔡向陽	本基金的基金經理、高級基金經理、投委會成員	2014-05-28	-	15 年	碩士。曾任天相投資顧問有限公司、新華資產管理股份有限公司研究員等。2007 年 10 月加入華夏基金管理有限公司。曾任研究員、基金經理助理、投資經理、華夏紅利混合型證券投資基金基金經理 (2016 年 4 月 8 日至 2017 年 8 月 29 日期間)、華夏行業龍頭混合型證券投資基金基金經理 (2018 年 3 月 7 日至 2019 年 7 月 29 日期間) 等。

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。

#### 4.2 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 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 41 次，其中 20 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 21 次為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

2021 年上半年，A 股各主要指數整體震盪上行，不同板塊分化明顯，市場風格比較極致：新能源車、光伏、半導體等景氣度較高行業漲幅顯著，上游週期板塊也有明顯漲幅，而消費、金融等行業表現較差。

回顧上半年市場走勢，春節前市場的上漲主要是延續 2020 年下半年以來的經濟復蘇邏輯，週期性板塊如有色、化工、銀行、鋼鐵等等輪番上漲，消費、醫藥、新能源車、光伏等成長行業核心標的也同步上漲。但節前短期的快速上漲導致估值快速提升，節後美債收益率快速上升引發市場對估值中樞的調整，市場整體呈現回檔態勢。二季度初市場的反彈先是各板塊系統性的估值修復，後半段新能源車、光伏、半導體等成長行業受益於行業景氣明顯引領市場。

組合管理方面，本基金持倉結構變化不大，個股上有所優化。背後的主要邏輯是在流動性尚寬而通脹高企的宏觀背景下，更應突出投資標的的中長期成長性，長期成長空間有限的類債資產的估值下殺在某種意義上是對通脹的補償。長期看，本基金堅持“自下而上”選擇 ROE 高、壁壘高、增長持續性強的個股，投資方向主要集中在消費、醫藥、高端製造業等領域，以期通過長期持股分享這些優秀公司的持續成長。

##### 4.4.2 報告期內基金的業績表現

截至 2021 年 6 月 30 日，本基金份額淨值為 1.963 元，本報告期份額淨值增長率為 1.70%，同期業績比較基準增長率為 0.74%。

#### 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 2021 年下半年，我國經濟基本面依然保持穩健增長態勢，貨幣政策堅持以我為主，保持穩健。海外市場經濟復蘇但就業目標尚未達到，並且不時受到變種病毒影響，疫情期間釋放的巨額流動性收緊時點一再推後。這導致市場對未來成長空間大、短期景氣度高的行業持續給予高估值溢價。本基金依然將堅持持有那些需求剛性足、業務韌性好、市場空間大、競爭壁壘高、盈利能力強的個股。

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。

#### 4.7 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 6 次，符合相關法規及基金合同的規定。

#### 4.8 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 託管人對本中期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”部分未在本託管人覆核範圍內）、投資組合報告等資料真實、準確和完整。

## §6 中期報告財務會計報告（未經審計）

### 6.1 資產負債表

會計主體：華夏回報證券投資基金

報告截止日：2021 年 6 月 30 日

單位：人民幣元

資產	附注號	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
<b>資產：</b>		-	-
銀行存款	6.4.7.1	833,212,485.47	1,915,142,637.74
結算備付金		735,640.69	10,187,205.05
存出保證金		1,085,299.86	814,491.67
交易性金融資產	6.4.7.2	14,661,646,274.68	14,416,477,995.76
其中：股票投資		10,154,475,590.64	10,102,371,163.26
基金投資		-	-
債券投資		4,507,170,684.04	4,314,106,832.50
資產支持證券投資		-	-
貴金屬投資		-	-
衍生金融資產	6.4.7.3	-	-
買入返售金融資產	6.4.7.4	1,167,551,352.04	-
應收證券結算款		6,727,085.81	3,651,608.18
應收利息	6.4.7.5	69,854,477.49	67,457,106.03
應收股利		-	-
應收申購款		16,427,197.25	30,998,072.26
遞延所得稅資產		-	-
其他資產	6.4.7.6	-	-
資產總計		16,757,239,813.29	16,444,729,116.69
<b>負債和所有者權益</b>	<b>附注號</b>	<b>本期末 2021 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2020 年 12 月 31 日</b>
<b>負債：</b>		-	-
短期借款		-	-
交易性金融負債		-	-
衍生金融負債	6.4.7.3	-	-
賣出回購金融資產款		-	-
應付證券結算款		0.01	50,213,539.04
應付贖回款		39,587,822.77	51,404,773.94
應付管理人報酬		20,676,573.40	19,205,335.67
應付託管費		3,446,095.56	3,200,889.30
應付銷售服務費		-	-
應付交易費用	6.4.7.7	14,675,251.88	14,455,376.37

應交稅費		79,275.32	79,279.64
應付利息		-	-
應付利潤		-	-
遞延所得稅負債		-	-
其他負債	6.4.7.8	757,650.51	912,886.53
負債合計		79,222,669.45	139,472,080.49
<b>所有者權益：</b>		-	-
實收基金	6.4.7.9	8,495,156,518.98	7,957,194,040.08
未分配利潤	6.4.7.10	8,182,860,624.86	8,348,062,996.12
所有者權益合計		16,678,017,143.84	16,305,257,036.20
負債和所有者權益總計		16,757,239,813.29	16,444,729,116.69

注：報告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份額淨值 1.963 元，基金份額總額 8,495,156,518.98 份。

## 6.2 利潤表

會計主體：華夏回報證券投資基金

本報告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

單位：人民幣元

項目	附注號	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期間 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		432,447,537.65	1,790,970,334.67
1.利息收入		76,145,042.29	63,669,707.40
其中：存款利息收入	6.4.7.11	2,973,187.05	2,315,639.16
債券利息收入		68,429,821.41	60,417,481.40
資產支持證券利息收入		-	-
買入返售金融資產收入		4,742,033.83	936,586.84
證券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投資收益（損失以“-”填列）		1,082,648,342.17	1,015,494,727.00
其中：股票投資收益	6.4.7.12	1,037,764,841.50	893,008,988.46
基金投資收益		-	-
債券投資收益	6.4.7.13	5,919,388.36	33,498,107.68
資產支持證券投資收益	6.4.7.14	-	-
貴金屬投資收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-	-
股利收益	6.4.7.17	38,964,112.31	88,987,630.86
3.公允價值變動收益（損失以“-”號填列）	6.4.7.18	-731,261,063.00	707,394,292.81
4.匯兌收益（損失以“-”號填列）		-	-
5.其他收入（損失以“-”號填列）	6.4.7.19	4,915,216.19	4,411,607.46
<b>減：二、費用</b>		147,890,402.15	110,389,009.91
1.管理人報酬		120,640,954.18	85,202,640.62

2.託管費		20,106,825.66	14,200,440.08
3.銷售服務費		-	-
4.交易費用	6.4.7.20	6,642,082.76	10,211,360.60
5.利息支出		346,221.65	608,384.41
其中：賣出回購金融資產支出		346,221.65	608,384.41
6.稅金及附加		420.69	11,295.87
7.其他費用	6.4.7.21	153,897.21	154,888.33
三、利潤總額(虧損總額以“-”號填列)		284,557,135.50	1,680,581,324.76
減：所得稅費用		-	-
四、淨利潤(淨虧損以“-”號填列)		284,557,135.50	1,680,581,324.76

6.3 所有者權益(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：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

單位：人民幣元

項目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	實收基金	未分配利潤	所有者權益合計
一、期初所有者權益(基金淨值)	7,957,194,040.08	8,348,062,996.12	16,305,257,036.20
二、本期經營活動產生的基金淨值變動數(本期利潤)	-	284,557,135.50	284,557,135.50
三、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)	537,962,478.90	529,763,656.04	1,067,726,134.94
其中：1.基金申購款	2,303,247,469.32	2,295,981,411.51	4,599,228,880.83
2.基金贖回款	-1,765,284,990.42	-1,766,217,755.47	-3,531,502,745.89
四、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)	-	-979,523,162.80	-979,523,162.80
五、期末所有者權益(基金淨值)	8,495,156,518.98	8,182,860,624.86	16,678,017,143.84
項目	上年度可比期間 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	實收基金	未分配利潤	所有者權益合計
一、期初所有者權益(基金淨值)	8,192,394,690.04	4,214,725,796.89	12,407,120,486.93
二、本期經營活動產生的基金淨值變動數(本期利潤)	-	1,680,581,324.76	1,680,581,324.76

三、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)	-636,107,367.92	-315,362,878.04	-951,470,245.96
其中：1.基金申購款	1,616,376,897.26	785,785,020.61	2,402,161,917.87
2.基金贖回款	-2,252,484,265.18	-1,101,147,898.65	-3,353,632,163.83
四、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)	-	-784,854,200.43	-784,854,200.43
五、期末所有者權益(基金淨值)	7,556,287,322.12	4,795,090,043.18	12,351,377,365.30

報表附注為財務報表的組成部分。

本報告 6.1 至 6.4，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

#### 6.4 報表附注

##### 6.4.1 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。

##### 6.4.2 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 6.4.4 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。

#### 6.4.3 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基金淨值變動情況等有關信息。

#### 6.4.4 本報告期所採用的會計政策、會計估計與最近一期年度報告相一致的說明

本基金本報告期會計報表所採用的會計政策、會計估計與最近一期年度會計報表所採用的會計政策、會計估計一致。

#### 6.4.5 會計政策和會計估計變更以及差錯更正的說明

##### 6.4.5.1 會計政策變更的說明

本基金本報告期無會計政策變更。

##### 6.4.5.2 會計估計變更的說明

本基金本報告期無會計估計變更。

##### 6.4.5.3 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。

#### 6.4.6 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、債券的差價收入免徵增值稅，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徵增值稅。
- (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 5%、3%、2% 繳納城市維護建設稅、教育費附加和地方教育費附加。

#### 6.4.7 重要財務報表項目的說明

##### 6.4.7.1 銀行存款

單位：人民幣元

項目	本期末 2021 年 6 月 30 日	
	活期存款	833,212,485.47
定期存款	-	
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	-	
合計	833,212,485.47	

#### 6.4.7.2 交易性金融資產

單位：人民幣元

項目	本期末 2021 年 6 月 30 日			
	成本	公允價值	公允價值變動	
股票	4,456,856,615.95	10,154,475,590.64	5,697,618,974.69	
貴金屬投資-金交所 黃金合約	-	-	-	
債券	交易所市場	423,870,612.36	411,421,684.04	-12,448,928.32
	銀行間市場	4,089,764,752.75	4,095,749,000.00	5,984,247.25
	合計	4,513,635,365.11	4,507,170,684.04	-6,464,681.07
資產支持證券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合計	8,970,491,981.06	14,661,646,274.68	5,691,154,293.62	

#### 6.4.7.3 衍生金融資產/負債

無。

#### 6.4.7.4 買入返售金融資產

##### 6.4.7.4.1 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 2021 年 6 月 30 日	
	帳面餘額	其中：買斷式逆回購
交易所市場	-	-
銀行間市場	1,167,551,352.04	-
合計	1,167,551,352.04	-

##### 6.4.7.4.2 期末買斷式逆回購交易中取得的債券

無。

6.4.7.5 應收利息

單位：人民幣元

項目	本期末 2021 年 6 月 30 日
應收活期存款利息	150,116.22
應收定期存款利息	-
應收其他存款利息	-
應收結算備付金利息	331.00
應收債券利息	69,594,078.97
應收資產支持證券利息	-
應收買入返售證券利息	109,462.90
應收申購款利息	-
應收黃金合約拆借孳息	-
應收出借證券利息	-
其他	488.40
合計	69,854,477.49

6.4.7.6 其他資產

無。

6.4.7.7 應付交易費用

單位：人民幣元

項目	本期末 2021 年 6 月 30 日
交易所市場應付交易費用	14,656,254.10
銀行間市場應付交易費用	18,997.78
合計	14,675,251.88

6.4.7.8 其他負債

單位：人民幣元

項目	本期末 2021 年 6 月 30 日
應付券商交易單元保證金	500,000.00
應付贖回費	148,554.57
應付證券出借違約金	-
預提費用	109,095.94
合計	757,650.51

6.4.7.9 實收基金

金額單位：人民幣元

項目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
----	---------------------------------------

	基金份額（份）	帳面金額
上年度末	7,957,194,040.08	7,957,194,040.08
本期申購	2,303,247,469.32	2,303,247,469.32
本期贖回（以“-”號填列）	-1,765,284,990.42	-1,765,284,990.42
本期末	8,495,156,518.98	8,495,156,518.98

#### 6.4.7.10 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	68,608,987.72	8,279,454,008.40	8,348,062,996.12
本期利潤	1,015,818,198.50	-731,261,063.00	284,557,135.50
本期基金份額交易產生的變動數	8,089,837.00	521,673,819.04	529,763,656.04
其中：基金申購款	23,650,785.24	2,272,330,626.27	2,295,981,411.51
基金贖回款	-15,560,948.24	-1,750,656,807.23	-1,766,217,755.47
本期已分配利潤	-979,523,162.80	-	-979,523,162.80
本期末	112,993,860.42	8,069,866,764.44	8,182,860,624.86

#### 6.4.7.11 存款利息收入

單位：人民幣元

項目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
活期存款利息收入	2,938,278.76
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	27,590.23
其他	7,318.06
合計	2,973,187.05

#### 6.4.7.12 股票投資收益

單位：人民幣元

項目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
賣出股票成交總額	2,383,892,947.59
減：賣出股票成本總額	1,346,128,106.09
買賣股票差價收入	1,037,764,841.50

#### 6.4.7.13 債券投資收益

單位：人民幣元

項目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
賣出債券（債轉股及債券到期兌付）成交總額	2,707,816,514.16

減：賣出債券（債轉股及債券到期兌付） 成本總額	2,675,768,984.80
減：應收利息總額	26,128,141.00
買賣債券差價收入	5,919,388.36

6.4.7.14 資產支持證券投資收益

無。

6.4.7.15 貴金屬投資收益

6.4.7.15.1 貴金屬投資收益項目構成

無。

6.4.7.15.2 貴金屬投資收益——買賣貴金屬差價收入

無。

6.4.7.15.3 貴金屬投資收益——贖回差價收入

無。

6.4.7.15.4 貴金屬投資收益——申購差價收入

無。

6.4.7.16 衍生工具收益

6.4.7.16.1 衍生工具收益——買賣權證差價收入

無。

6.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投資收益

無。

6.4.7.17 股利收益

單位：人民幣元

項目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投資產生的股利收益	38,964,112.31
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	38,964,112.31

6.4.7.18 公允價值變動收益

單位：人民幣元

項目名稱	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
1.交易性金融資產	-731,261,063.00
——股票投資	-723,105,295.64

——債券投資	-8,155,767.36
——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	-731,261,063.00

#### 6.4.7.19 其他收入

單位：人民幣元

項目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
基金贖回費收入	4,915,216.19
合計	4,915,216.19

#### 6.4.7.20 交易費用

單位：人民幣元

項目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
交易所市場交易費用	6,616,282.76
銀行間市場交易費用	25,800.00
交易基金產生的費用	-
其中：申購費	-
贖回費	-
合計	6,642,082.76

#### 6.4.7.21 其他費用

單位：人民幣元

項目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
審計費用	49,588.57
信息披露費	59,507.37
證券出借違約金	-
銀行費用	26,201.27
銀行間帳戶維護費	18,000.00
其他	600.00
合計	153,897.21

#### 6.4.8 或有事項、資產負債表日後事項的說明

#### 6.4.8.1 或有事項

截至資產負債表日，本基金無或有事項。

#### 6.4.8.2 資產負債表日後事項

根據本基金管理人於 2021 年 7 月 8 日發布的分紅公告，本基金向 2021 年 7 月 12 日在本基金登記結算機構登記在冊的基金份額持有人按每 10 份基金份額派發紅利 0.150 元。

根據本基金管理人於 2021 年 7 月 30 日發布的分紅公告，本基金向 2021 年 8 月 3 日在本基金登記結算機構登記在冊的基金份額持有人按每 10 份基金份額派發紅利 0.150 元。

根據本基金管理人於 2021 年 8 月 5 日發布的分紅公告，本基金向 2021 年 8 月 9 日在本基金登記結算機構登記在冊的基金份額持有人按每 10 份基金份額派發紅利 0.300 元。

根據本基金管理人於 2021 年 8 月 11 日發布的分紅公告，本基金向 2021 年 8 月 13 日在本基金登記結算機構登記在冊的基金份額持有人按每 10 份基金份額派發紅利 0.300 元。

根據本基金管理人於 2021 年 8 月 25 日發布的分紅公告，本基金向 2021 年 8 月 27 日在本基金登記結算機構登記在冊的基金份額持有人按每 10 份基金份額派發紅利 0.450 元。

#### 6.4.9 關聯方關係

##### 6.4.9.1 本報告期存在控制關係或其他重大利害關係的關聯方發生變化的情況

本基金本報告期不存在控制關係或其他重大利害關係的關聯方發生變化的情況。

##### 6.4.9.2 本報告期與基金發生關聯交易的各關聯方

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

注：下述關聯交易均在正常業務範圍內按一般商業條款訂立。

##### 6.4.10 本報告期及上年度可比期間的關聯方交易

###### 6.4.10.1 通過關聯方交易單元進行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

金額單位：人民幣元

關聯方名稱	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期間 2020年1月1日至2020年6月30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	813,538,226.83	18.10%	1,486,876,721.83	22.14%

###### 6.4.10.1.2 權證交易



無。

### 6.4.10.1.3 債券交易

金額單位：人民幣元

關聯方名稱	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期間 2020年1月1日至2020年6月30日	
	成交金額	佔當期債券成交總額的比例	成交金額	佔當期債券成交總額的比例
中信證券	338,896.70	100.00%	522,233,043.20	61.05%

### 6.4.10.1.4 債券回購交易

金額單位：人民幣元

關聯方名稱	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期間 2020年1月1日至2020年6月30日	
	成交金額	佔當期債券回購成交總額的比例	成交金額	佔當期債券回購成交總額的比例
中信證券	-	-	40,000,000.00	2.23%

### 6.4.10.1.5 應支付關聯方的佣金

金額單位：人民幣元

關聯方名稱	本期 2021年1月1日至2021年6月30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	19.93%	757,641.92	5.17%
關聯方名稱	上年度可比期間 2020年1月1日至2020年6月30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	1,384,721.81	25.29%	1,384,721.81	8.78%

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。

### 6.4.10.2 關聯方報酬

#### 6.4.10.2.1 基金管理費

單位：人民幣元

項目	本期	上年度可比期間
----	----	---------

	2021年1月1日至2021年6月 30日	2020年1月1日至2020年6月30 日
當期發生的基金應支付的管理費	120,640,954.18	85,202,640.62
其中：支付銷售機構的客戶維護費	29,711,399.89	17,516,183.58

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。

#### 6.4.10.2.2 基金託管費

單位：人民幣元

項目	本期 2021年1月1日至2021年6月 30日	上年度可比期間 2020年1月1日至2020年6月30 日
當期發生的基金應支付的託管費	20,106,825.66	14,200,440.08

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。

#### 6.4.10.3 與關聯方進行銀行間同業市場的債券(含回購)交易

無。

#### 6.4.10.4 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

##### 6.4.10.4.1 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。

##### 6.4.10.4.2 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。

#### 6.4.10.5 各關聯方投資本基金的情況

##### 6.4.10.5.1 報告期內基金管理人運用固有資金投資本基金的情況

無。

##### 6.4.10.5.2 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。

#### 6.4.10.6 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 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期間 2020年1月1日至2020年6月30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	833,212,485.47	2,938,278.76	655,562,816.75	2,244,794.09

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。

6.4.10.7 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 2021年1月1日至2021年6月30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	688819	天能股份	網下申購	28,382	1,186,083.78
中信證券	688660	電氣風電	網下申購	51,238	278,734.72
中信證券	688276	百克生物	網下申購	3,486	126,716.10
中信證券	688617	惠泰醫療	網下申購	1,673	124,571.58
中信證券	688575	亞輝龍	網下申購	3,435	50,838.00
中信證券	300982	蘇文電能	網下申購	3,170	50,181.10
中信證券	300993	玉馬遮陽	網下申購	4,097	49,573.70
中信證券	688315	諾禾致源	網下申購	3,711	47,352.36
中信證券	300997	歡樂家	網下申購	9,279	45,838.26
中信證券	688607	康眾醫療	網下申購	1,890	43,866.90
中信證券	300930	屹通新材	網下申購	3,220	42,214.20
中信證券	603529	愛瑪科技	網下申購	1,019	28,389.34
中信證券	688690	納微科技	網下申購	3,477	28,059.39
中信證券	300966	共同藥業	網下申購	2,858	23,549.92
中信證券	688565	力源科技	網下申購	2,464	23,136.96
中信證券	688226	威騰電氣	網下申購	2,693	17,289.06
中信證券	600916	中國黃金	網下申購	3,371	16,821.29
中信證券	605060	聯德股份	網下申購	883	13,765.97
中信證券	605488	福萊新材	網下申購	416	8,498.88
中信證券	001208	華菱線纜	網下申購	1,754	6,437.18
中信證券	003040	楚天龍	網下申購	1,101	5,086.62
中信證券	601279	英利汽車	網下申購	2,004	4,148.28
上年度可比期間 2020年1月1日至2020年6月30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
-	-	-	-	-	-

6.4.10.8 其他關聯交易事項的說明

6.4.10.8.1 其他關聯交易事項的說明

無。

6.4.11 利潤分配情況

單位：人民幣元

序號	權益登記日	除息日 (場外)	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
1	2021-01-08	2021-01-08	0.300	81,376,323.90	157,792,011.33	239,168,335.23	-
2	2021-01-14	2021-01-14	0.150	40,937,804.38	80,616,633.83	121,554,438.21	-
3	2021-04-16	2021-04-16	0.150	41,626,926.17	79,961,818.44	121,588,744.61	-
4	2021-04-22	2021-04-22	0.150	41,376,504.76	81,005,397.77	122,381,902.53	-
5	2021-06-03	2021-06-03	0.150	41,516,028.67	82,392,426.25	123,908,454.92	-
6	2021-06-18	2021-06-18	0.300	83,838,857.54	167,082,429.76	250,921,287.30	-
合計			1.200	330,672,445.42	648,850,717.38	979,523,162.80	-

注：根據本基金管理人於 2021 年 7 月 8 日發布的分紅公告，本基金向 2021 年 7 月 12 日在本基金登記結算機構登記在冊的基金份額持有人按每 10 份基金份額派發紅利 0.150 元。

根據本基金管理人於 2021 年 7 月 30 日發布的分紅公告，本基金向 2021 年 8 月 3 日在本基金登記結算機構登記在冊的基金份額持有人按每 10 份基金份額派發紅利 0.150 元。

根據本基金管理人於 2021 年 8 月 5 日發布的分紅公告，本基金向 2021 年 8 月 9 日在本基金登記結算機構登記在冊的基金份額持有人按每 10 份基金份額派發紅利 0.300 元。

根據本基金管理人於 2021 年 8 月 11 日發布的分紅公告，本基金向 2021 年 8 月 13 日在本基金登記結算機構登記在冊的基金份額持有人按每 10 份基金份額派發紅利 0.300 元。

根據本基金管理人於 2021 年 8 月 25 日發布的分紅公告，本基金向 2021 年 8 月 27 日在本基金登記結算機構登記在冊的基金份額持有人按每 10 份基金份額派發紅利 0.450 元。

6.4.12 期末（2021 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限證券

6.4.12.1 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

6.4.12.1.1 受限證券類別：股票
----------------------

證券代碼	證券名稱	成功認購日	可流通日	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
688538	和輝光電	2021-05-20	2021-11-29	新發流通受限	2.65	3.38	375,156	994,163.40	1,268,027.28	-
688317	之江生物	2021-01-08	2021-07-19	新發流通受限	43.22	63.82	5,740	248,082.80	366,326.80	-
300957	貝泰妮	2021-03-18	2021-09-27	新發流通受限	47.33	251.96	853	40,372.49	214,921.88	-
688601	力芯微	2021-06-18	2021-12-28	新發流通受限	36.48	133.69	1,174	42,827.52	156,952.06	-
688700	東威科技	2021-06-07	2021-12-15	新發流通受限	9.41	38.46	3,049	28,691.09	117,264.54	-
688625	呈和科技	2021-05-31	2021-12-07	新發流通受限	16.48	42.63	2,672	44,034.56	113,907.36	-
300919	中偉股份	2020-12-15	2021-07-02	新發流通受限	24.60	163.00	610	15,006.00	99,430.00	-
688607	康眾醫療	2021-01-25	2021-08-02	新發流通受限	23.21	44.50	1,890	43,866.90	84,105.00	-
688499	利元亨	2021-06-23	2021-07-01	新發流通受限	38.85	38.85	2,149	83,488.65	83,488.65	-
300979	華利集團	2021-04-15	2021-10-26	新發流通受限	33.22	87.50	925	30,728.50	80,937.50	-
688239	航宇科技	2021-06-25	2021-07-05	新發流通受限	11.48	11.48	4,926	56,550.48	56,550.48	-
300981	中紅醫療	2021-04-19	2021-10-27	新發流通受限	48.59	90.39	601	29,202.59	54,324.39	-
688087	英科再生	2021-06-30	2021-07-09	新發流通受限	21.96	21.96	2,469	54,219.24	54,219.24	-
301017	漱玉平民	2021-06-23	2021-07-05	新發流通	8.86	8.86	4,995	44,255.70	44,255.70	-

				受限						
300973	立高食品	2021-04-08	2021-10-15	新發流通受限	28.28	115.71	360	10,180.80	41,655.60	-
301020	密封科技	2021-06-28	2021-07-06	新發流通受限	10.64	10.64	3,789	40,314.96	40,314.96	-
301021	英諾鐳射	2021-06-28	2021-07-06	新發流通受限	9.46	9.46	2,609	24,681.14	24,681.14	-
300953	震裕科技	2021-03-11	2021-09-22	新發流通受限	28.77	99.85	240	6,904.80	23,964.00	-
300941	創識科技	2021-02-02	2021-08-09	新發流通受限	21.31	49.94	399	8,502.69	19,926.06	-
301015	百洋醫藥	2021-06-22	2021-12-30	新發流通受限	7.64	38.83	462	3,529.68	17,939.46	-
688226	威騰電氣	2021-06-28	2022-01-07	新發流通受限	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	-
300982	蘇文電能	2021-04-19	2021-10-27	新發流通受限	15.83	45.29	317	5,018.11	14,356.93	-
300968	格林精密	2021-04-06	2021-10-15	新發流通受限	6.87	12.07	1,162	7,982.94	14,025.34	-
300940	南極光	2021-01-27	2021-08-03	新發流通受限	12.76	43.38	307	3,917.32	13,317.66	-
300614	百川暢銀	2021-05-18	2021-11-25	新發流通受限	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02	-
300937	藥易購	2021-01-20	2021-07-27	新發流通受限	12.25	53.71	244	2,989.00	13,105.24	-
301013	利和興	2021-06-21	2021-12-29	新發流通受限	8.72	27.11	471	4,107.12	12,768.81	-
300942	易瑞生物	2021-02-02	2021-08-09	新發流通受限	5.31	28.52	443	2,352.33	12,634.36	-
300997	歡樂	2021-	2021-	新發	4.94	13.05	928	4,584.32	12,110.40	-

	家	05-26	12-02	流通受限						
300933	中辰股份	2021-01-15	2021-07-22	新發流通受限	3.37	10.44	1,112	3,747.44	11,609.28	-
301002	崧盛股份	2021-05-27	2021-12-07	新發流通受限	18.71	57.62	201	3,760.71	11,581.62	-
605287	德才股份	2021-06-28	2021-07-06	新發流通受限	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-
300955	嘉亨家化	2021-03-16	2021-09-24	新發流通受限	16.53	46.07	232	3,834.96	10,688.24	-
300996	普聯軟體	2021-05-26	2021-12-03	新發流通受限	20.81	42.23	241	5,015.21	10,177.43	-
300956	英力股份	2021-03-16	2021-09-27	新發流通受限	12.85	25.80	371	4,767.35	9,571.80	-
300962	中金輻照	2021-03-29	2021-10-11	新發流通受限	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12	-
300952	恒輝安防	2021-03-03	2021-09-13	新發流通受限	11.72	27.08	340	3,984.80	9,207.20	-
300966	共同藥業	2021-03-31	2021-10-11	新發流通受限	8.24	31.54	286	2,356.64	9,020.44	-
300945	曼卡龍	2021-02-03	2021-08-10	新發流通受限	4.56	18.88	474	2,161.44	8,949.12	-
300948	冠中生態	2021-02-18	2021-08-25	新發流通受限	13.00	27.42	324	2,808.00	8,884.08	-
300931	通用電梯	2021-01-13	2021-07-21	新發流通受限	4.31	13.11	672	2,896.32	8,809.92	-
300961	深水海納	2021-03-23	2021-09-30	新發流通受限	8.48	22.07	394	3,341.12	8,695.58	-
300950	德固特	2021-02-24	2021-09-03	新發流通受限	8.41	39.13	219	1,841.79	8,569.47	-

605162	新中港	2021-06-29	2021-07-07	新發流通受限	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39	-
300958	建工修復	2021-03-18	2021-09-29	新發流通受限	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00	-
300986	志特新材	2021-04-21	2021-11-01	新發流通受限	14.79	30.57	264	3,904.56	8,070.48	-
300987	川網傳媒	2021-04-28	2021-11-11	新發流通受限	6.79	26.81	301	2,043.79	8,069.81	-
300926	博俊科技	2020-12-29	2021-07-12	新發流通受限	10.76	22.20	359	3,862.84	7,969.80	-
300993	玉馬遮陽	2021-05-17	2021-11-24	新發流通受限	12.10	19.29	410	4,961.00	7,908.90	-
300930	屹通新材	2021-01-13	2021-07-21	新發流通受限	13.11	24.48	322	4,221.42	7,882.56	-
300985	致遠新能	2021-04-21	2021-10-29	新發流通受限	24.90	24.81	295	7,345.50	7,318.95	-
300971	博亞精工	2021-04-07	2021-10-15	新發流通受限	18.24	28.29	245	4,468.80	6,931.05	-
301004	嘉益股份	2021-06-18	2021-12-27	新發流通受限	7.81	21.94	312	2,436.72	6,845.28	-
300991	創益通	2021-05-12	2021-11-22	新發流通受限	13.06	26.51	254	3,317.24	6,733.54	-
300927	江天化學	2020-12-29	2021-07-07	新發流通受限	13.39	30.10	217	2,905.63	6,531.70	-
300975	商絡電子	2021-04-14	2021-10-21	新發流通受限	5.48	13.03	492	2,696.16	6,410.76	-
300963	中洲特材	2021-03-30	2021-10-11	新發流通受限	12.13	22.49	283	3,432.79	6,364.67	-
301011	華立科技	2021-06-09	2021-12-17	新發流通	14.20	33.84	175	2,485.00	5,922.00	-



				受限						
300943	春暉智控	2021-02-03	2021-08-10	新發流通受限	9.79	23.01	255	2,496.45	5,867.55	-
300967	曉鳴股份	2021-04-02	2021-10-13	新發流通受限	4.54	11.54	507	2,301.78	5,850.78	-
300972	萬辰生物	2021-04-08	2021-10-19	新發流通受限	7.19	12.65	430	3,091.70	5,439.50	-
300929	華騏環保	2021-01-12	2021-07-21	新發流通受限	13.87	29.55	183	2,538.21	5,407.65	-
300960	通業科技	2021-03-22	2021-09-29	新發流通受限	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04	-
301017	漱玉平民	2021-06-23	2022-01-05	新發流通受限	8.86	8.86	555	4,917.30	4,917.30	-
301020	密封科技	2021-06-28	2022-01-06	新發流通受限	10.64	10.64	421	4,479.44	4,479.44	-
301007	德邁仕	2021-06-04	2021-12-16	新發流通受限	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	-
300998	寧波方正	2021-05-25	2021-12-02	新發流通受限	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	-
301012	揚電科技	2021-06-15	2021-12-22	新發流通受限	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20	-
300992	泰福泵業	2021-05-17	2021-11-25	新發流通受限	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00	-
301010	晶雪節能	2021-06-09	2021-12-20	新發流通受限	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	-
301021	英諾鐳射	2021-06-28	2022-01-06	新發流通受限	9.46	9.46	290	2,743.40	2,743.40	-

注：①根據中國證監會《上市公司證券發行管理辦法》、《創業板上市公司證券發行管理暫行辦法》以及《上市公司非公開發行股票實施細則》，本基金作為特定投資者所認購的 2020 年 2 月 14 日前發行完畢的非公開發行股份，自發行結束之日起 12 個月內不得轉讓。根據《上市公司股東、董監

高減持股份的若干規定》及《深圳/上海證券交易所上市公司股東及董事、監事、高級管理人員減持股份實施細則》，本基金持有的上市公司非公開發行股份，採取集中競價交易方式的，在任意連續 90 日內，減持股份的總數不得超過公司股份總數的 1%，且自股份解除限售之日起 12 個月內，通過集中競價交易減持的數量不得超過本基金持有該次非公開發行股份數量的 50%；採取大宗交易方式的，在任意連續 90 日內，減持股份的總數不得超過公司股份總數的 2%。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。

根據中國證監會《關於修改〈上市公司證券發行管理辦法〉的決定》、《關於修改〈創業板上市公司證券發行管理暫行辦法〉的決定》以及《關於修改〈上市公司非公開發行股票實施細則〉的決定》，本基金所認購的 2020 年 2 月 14 日(含)後發行完畢的非公開發行股份，自發行結束之日起 6 個月內不得轉讓。此外，本基金減持上述非公開發行股份不適用《上市公司股東、董監高減持股份的若干規定》及《深圳/上海證券交易所上市公司股東及董事、監事、高級管理人員減持股份實施細則》的有關規定。

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。

⑥以上“可流通日”是根據上市公司公告估算的流通日期，最終日期以上市公司公告為準。

#### 6.4.12.2 期末持有的暫時停牌等流通受限股票

無。

#### 6.4.12.3 期末債券正回購交易中作為抵押的債券

##### 6.4.12.3.1 銀行間市場債券正回購

無。

#### 6.4.12.3.2 交易所市場債券正回購

無。

#### 6.4.12.4 期末參與轉融通證券出借業務的證券

無。

### 6.4.13 金融工具風險及管理

#### 6.4.13.1 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。

#### 6.4.13.2 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。

#### 6.4.13.3 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“6.4.12 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。

#### 6.4.13.3.1 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。

#### 6.4.13.4 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。

##### 6.4.13.4.1 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。

##### 6.4.13.4.1.1 利率風險敞口

單位：人民幣元

本期末 2021年6月30日	1年以內	1-5年	5年以上	合計
銀行存款	833,212,485.47	-	-	833,212,485.47
結算備付金	735,640.69	-	-	735,640.69
結算保證金	1,085,299.86	-	-	1,085,299.86
債券投資	2,215,392,684.04	2,089,278,000.00	202,500,000.00	4,507,170,684.04
資產支持證券	-	-	-	-
買入返售金融資產	1,167,551,352.04	-	-	1,167,551,352.04
應收直銷申購款	-	-	-	-
上年度末 2020年12月31日	1年以內	1-5年	5年以上	合計
銀行存款	1,915,142,637.74	-	-	1,915,142,637.74
結算備付金	10,187,205.05	-	-	10,187,205.05
結算保證金	814,491.67	-	-	814,491.67

債券投資	1,980,275,832.50	2,313,779,000.00	20,052,000.00	4,314,106,832.50
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：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。

#### 6.4.13.4.1.2 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 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
	利率下降 25 個基點	16,056,601.06	15,113,525.56
利率上升 25 個基點	-15,879,877.58	-14,990,788.91	

#### 6.4.13.4.2 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。

#### 6.4.13.4.3 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。

#### 6.4.13.4.3.1 其他價格風險敞口

金額單位：人民幣元

項目	本期末 2021年6月30日		上年度末 2020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	10,154,475,590.64	60.89	10,102,371,163.26	61.96
交易性金融資產－基金投資	-	-	-	-
交易性金融資產－債券投資	3,201,874.04	0.02	342,713.00	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	10,157,677,464.68	60.90	10,102,713,876.26	61.96

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。

#### 6.4.13.4.3.2 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 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
	-5%	-854,191,016.77	-510,705,094.35
	+5%	854,191,016.77	510,705,094.35

#### 6.4.14 有助於理解和分析會計報表需要說明的其他事項

##### （1）金融工具公允價值計量的方法

根據企業會計準則的相關規定，以公允價值計量的金融工具，其公允價值的計量可分為三個層次：

第一層次：對存在活躍市場報價的金融工具，可以相同資產/負債在活躍市場上的報價確定公允價值。

第二層次：對估值日活躍市場無報價的金融工具，可以類似資產/負債在活躍市場上的報價為依據做必要調整確定公允價值；對估值日不存在活躍市場的金融工具，可以相同或類似資產/負債在非活躍市場上的報價為依據做必要調整確定公允價值。

第三層次：對無法獲得相同或類似資產可比市場交易價格的金融工具，可以其他反映市場參與者對資產/負債定價時所使用的參數為依據確定公允價值。

##### （2）各層次金融工具公允價值

截至 2021 年 6 月 30 日止，本基金持有的以公允價值計量的金融工具第一層次的餘額為 10,154,637,210.85 元，第二層次的餘額為 4,507,009,063.83 元，第三層次的餘額為 0 元。（截至 2020 年 12 月 31 日止：第一層次的餘額為 10,081,859,003.90 元，第二層次的餘額為 4,334,618,991.86 元，第三層次的餘額為 0 元。）

##### （3）公允價值所屬層次間的重大變動

對於特殊事項停牌、交易不活躍(包括漲跌停時的交易不活躍)的股票，本基金將相關股票公允價值所屬層次於其進行估值調整之日起從第一層次轉入第二層次或第三層次，於股票復牌能體現公允價值並恢復市價估值之日起從第二層次或第三層次轉入第一層次。對於持有的非公開發行股票，本

基金於限售期內將相關股票公允價值所屬層次列入第二層次，於限售期滿並恢復市價估值之日起從第二層次轉入第一層次。

(4) 第三層次公允價值本期變動金額

本基金持有的以公允價值計量的金融工具第三層次公允價值本期未發生變動。

## §7 投資組合報告

### 7.1 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	10,154,475,590.64	60.60
	其中：股票	10,154,475,590.64	60.60
2	基金投資	-	-
3	固定收益投資	4,507,170,684.04	26.90
	其中：債券	4,507,170,684.04	26.90
	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	1,167,551,352.04	6.97
	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	833,948,126.16	4.98
8	其他各項資產	94,094,060.41	0.56
9	合計	16,757,239,813.29	100.00

### 7.2 報告期末按行業分類的股票投資組合

#### 7.2.1 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	38,147.08	0.00
B	採礦業	-	-
C	製造業	8,231,360,395.11	49.35
D	電力、熱力、燃氣及水生產和供應業	297,304.49	0.00
E	建築業	25,371.37	0.00
F	批發和零售業	328,753.90	0.00
G	交通運輸、倉儲和郵政業	4,331,700.00	0.03
H	住宿和餐飲業	-	-

I	信息傳輸、軟體和信息技術服務業	100,038,046.50	0.60
J	金融業	110,110.55	0.00
K	房地產業	10,123.56	0.00
L	租賃和商務服務業	876,938,157.86	5.26
M	科學研究和技術服務業	9,925,965.61	0.06
N	水利、環境和公共設施管理業	207,853.61	0.00
O	居民服務、修理和其他服務業	-	-
P	教育	-	-
Q	衛生和社會工作	930,863,661.00	5.58
R	文化、體育和娛樂業	-	-
S	綜合	-	-
	合計	10,154,475,590.64	60.89

7.3 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	000858	五糧液	5,120,887	1,525,461,028.43	9.15
2	600809	山西汾酒	3,257,860	1,459,521,280.00	8.75
3	002304	洋河股份	6,989,074	1,448,136,132.80	8.68
4	600519	貴州茅台	700,774	1,441,281,885.80	8.64
5	300015	愛爾眼科	13,114,450	930,863,661.00	5.58
6	601888	中國中免	2,921,935	876,872,693.50	5.26
7	000661	長春高新	2,058,570	796,666,590.00	4.78
8	300760	邁瑞醫療	1,402,293	673,170,754.65	4.04
9	300122	智飛生物	2,346,121	438,091,174.33	2.63
10	603613	國聯股份	876,837	87,657,394.89	0.53
11	300151	昌紅科技	3,126,625	84,231,277.50	0.51
12	000568	瀘州老窖	349,600	82,484,624.00	0.49
13	300601	康泰生物	333,482	49,688,818.00	0.30
14	000333	美的集團	540,687	38,588,831.19	0.23
15	300628	億聯網路	384,481	32,219,507.80	0.19
16	002891	中寵股份	559,999	22,959,959.00	0.14
17	300750	寧德時代	33,800	18,076,240.00	0.11
18	000513	麗珠集團	320,300	16,021,406.00	0.10
19	600079	人福醫藥	558,000	15,774,660.00	0.09
20	300142	沃森生物	243,200	15,005,440.00	0.09
21	002311	海大集團	172,762	14,097,379.20	0.08
22	300453	三鑫醫療	674,880	10,507,881.60	0.06
23	300452	山河藥輔	676,633	10,095,364.36	0.06
24	600887	伊利股份	250,000	9,207,500.00	0.06
25	603259	藥明康得	58,224	9,117,296.16	0.05
26	600276	恒瑞醫藥	119,527	8,124,250.19	0.05



27	603444	吉比特	14,200	7,526,000.00	0.05
28	300639	凱普生物	159,971	5,280,642.71	0.03
29	603027	千禾味業	186,366	4,899,562.14	0.03
30	688109	品茗股份	60,100	4,666,164.00	0.03
31	600009	上海機場	90,000	4,331,700.00	0.03
32	688389	普門科技	96,768	2,966,906.88	0.02
33	688538	和輝光電	375,156	1,268,027.28	0.01
34	688131	皓元醫藥	1,955	676,801.45	0.00
35	002475	立訊精密	10,900	501,400.00	0.00
36	688660	電氣風電	51,238	450,894.40	0.00
37	688690	納微科技	3,477	408,547.50	0.00
38	688317	之江生物	5,740	366,326.80	0.00
39	688276	百克生物	3,486	364,565.88	0.00
40	688076	諾泰生物	4,984	339,958.64	0.00
41	688161	威高骨科	3,069	325,467.45	0.00
42	300957	貝泰妮	1,253	323,597.88	0.00
43	688269	凱立新材	1,941	270,808.32	0.00
44	301015	百洋醫藥	4,614	251,115.78	0.00
45	688613	奧精醫療	2,617	237,597.43	0.00
46	600905	三峽能源	33,000	209,880.00	0.00
47	300614	百川暢銀	3,283	176,700.30	0.00
48	301013	利和興	4,704	168,966.51	0.00
49	300997	歡樂家	9,279	168,775.16	0.00
50	301002	崧盛股份	2,001	159,001.62	0.00
51	605499	東鵬飲料	632	158,505.60	0.00
52	688601	力芯微	1,174	156,952.06	0.00
53	688575	亞輝龍	3,435	152,514.00	0.00
54	688216	氣派科技	2,000	133,400.00	0.00
55	300996	普聯軟體	2,410	132,487.34	0.00
56	688621	陽光諾和	1,485	131,868.00	0.00
57	688319	歐林生物	3,412	127,642.92	0.00
58	688700	東威科技	3,049	117,264.54	0.00
59	688314	康拓醫療	1,085	114,619.40	0.00
60	688625	呈和科技	2,672	113,907.36	0.00
61	300993	玉馬遮陽	4,097	99,899.55	0.00
62	688678	福立旺	4,198	99,492.60	0.00
63	300919	中偉股份	610	99,430.00	0.00
64	688698	偉創電氣	4,751	94,972.49	0.00
65	301004	嘉益股份	3,115	90,654.98	0.00
66	300991	創益通	2,535	89,214.50	0.00
67	688607	康眾醫療	1,890	84,105.00	0.00
68	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.00
69	300979	華利集團	925	80,937.50	0.00

70	688117	聖諾生物	1,672	80,924.80	0.00
71	301011	華立科技	1,750	79,474.50	0.00
72	688359	三孚新科	2,213	78,561.50	0.00
73	601665	齊魯銀行	6,731	62,598.30	0.00
74	301007	德邁仕	3,022	60,305.15	0.00
75	300998	寧波方正	2,003	60,075.24	0.00
76	603529	愛瑪科技	1,019	59,224.28	0.00
77	301012	揚電科技	1,691	56,994.16	0.00
78	688239	航宇科技	4,926	56,550.48	0.00
79	300992	泰福泵業	1,998	55,828.42	0.00
80	300981	中紅醫療	601	54,324.39	0.00
81	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.00
82	301010	晶雪節能	2,172	50,480.96	0.00
83	300910	瑞豐新材	474	49,556.70	0.00
84	601156	東航物流	2,090	49,470.30	0.00
85	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.00
86	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.00
87	300973	立高食品	360	41,655.60	0.00
88	688517	金冠電氣	2,892	41,095.32	0.00
89	688067	愛威科技	1,259	39,520.01	0.00
90	688367	工大高科	1,717	37,035.69	0.00
91	600032	浙江新能	3,045	37,027.20	0.00
92	605090	九豐能源	1,090	35,326.90	0.00
93	688681	科匯股份	1,899	34,903.62	0.00
94	601528	瑞豐銀行	2,230	34,721.10	0.00
95	300180	華峰超纖	6,434	31,848.30	0.00
96	301021	英諾鐳射	2,899	27,424.54	0.00
97	605296	神農集團	569	26,856.80	0.00
98	300953	震裕科技	240	23,964.00	0.00
99	001207	聯科科技	682	22,581.02	0.00
100	300911	億田智能	309	21,407.52	0.00
101	603833	歐派家居	144	20,442.24	0.00
102	300941	創識科技	399	19,926.06	0.00
103	603511	愛慕股份	553	18,249.00	0.00
104	688226	威騰電氣	2,693	17,289.06	0.00
105	603836	海程邦達	733	15,994.06	0.00
106	300925	法本信息	600	15,774.00	0.00
107	688606	奧泰生物	100	14,900.00	0.00
108	300982	蘇文電能	317	14,356.93	0.00
109	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.00
110	605319	無錫振華	764	13,706.16	0.00
111	001208	華菱線纜	1,754	13,558.42	0.00
112	300940	南極光	307	13,317.66	0.00

113	300937	藥易購	244	13,105.24	0.00
114	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00
115	603171	稅友股份	637	12,230.40	0.00
116	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.00
117	300918	南山智尚	1,063	11,065.83	0.00
118	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
119	688667	菱電電控	100	11,001.00	0.00
120	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
121	605259	綠田機械	295	10,516.75	0.00
122	605189	富春染織	422	10,165.98	0.00
123	300917	特發服務	366	10,123.56	0.00
124	300922	天秦裝備	287	9,996.21	0.00
125	300956	英力股份	371	9,571.80	0.00
126	300962	中金輻照	576	9,429.12	0.00
127	688661	和林微納	100	9,415.00	0.00
128	300952	恒輝安防	340	9,207.20	0.00
129	300966	共同藥業	286	9,020.44	0.00
130	300945	曼卡龍	474	8,949.12	0.00
131	300948	冠中生態	324	8,884.08	0.00
132	300931	通用電梯	672	8,809.92	0.00
133	300961	深水海納	394	8,695.58	0.00
134	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
135	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
136	300958	建工修復	300	8,166.00	0.00
137	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
138	300987	川網傳媒	301	8,069.81	0.00
139	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
140	300930	屹通新材	322	7,882.56	0.00
141	688529	豪森股份	300	7,677.00	0.00
142	300985	致遠新能	295	7,318.95	0.00
143	600885	宏發股份	112	7,022.40	0.00
144	300971	博亞精工	245	6,931.05	0.00
145	601318	中國平安	104	6,685.12	0.00
146	300927	江天化學	217	6,531.70	0.00
147	300975	商絡電子	492	6,410.76	0.00
148	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
149	601336	新華保險	133	6,106.03	0.00
150	300943	春暉智控	255	5,867.55	0.00
151	300967	曉鳴股份	507	5,850.78	0.00
152	688633	星球石墨	100	5,587.00	0.00
153	688329	艾隆科技	100	5,466.00	0.00
154	300972	萬辰生物	430	5,439.50	0.00
155	300929	華騏環保	183	5,407.65	0.00

156	300960	通業科技	234	5,396.04	0.00
157	605011	杭州熱電	525	4,662.00	0.00
158	600585	海螺水泥	99	4,063.95	0.00
159	688609	九聯科技	200	3,456.00	0.00
160	688092	愛科科技	100	3,455.00	0.00
161	003040	楚天龍	100	3,040.00	0.00
162	688616	西力科技	200	2,852.00	0.00
163	688195	騰景科技	100	2,177.00	0.00
164	688260	昀塚科技	100	2,144.00	0.00
165	603759	海天股份	100	2,050.00	0.00
166	002050	三花智控	48	1,151.04	0.00

7.4 報告期內股票投資組合的重大變動

7.4.1 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	002304	洋河股份	465,045,348.50	2.85
2	300122	智飛生物	463,323,347.18	2.84
3	000661	長春高新	274,623,729.81	1.68
4	300760	邁瑞醫療	126,883,855.17	0.78
5	000333	美的集團	99,905,197.79	0.61
6	300151	昌紅科技	95,345,818.03	0.58
7	603613	國聯股份	89,376,189.71	0.55
8	601888	中國中免	71,324,477.16	0.44
9	000568	瀘州老窖	62,271,256.48	0.38
10	300015	愛爾眼科	59,933,032.79	0.37
11	300601	康泰生物	45,397,804.00	0.28
12	300628	億聯網路	28,834,495.93	0.18
13	600519	貴州茅台	22,683,550.00	0.14
14	600809	山西汾酒	20,195,947.00	0.12
15	000858	五糧液	19,603,689.70	0.12
16	002352	順豐控股	19,123,923.00	0.12
17	000513	麗珠集團	15,857,152.00	0.10
18	600079	人福醫藥	15,414,030.00	0.09
19	300750	寧德時代	12,103,570.50	0.07
20	002311	海大集團	12,027,296.16	0.07

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。

7.4.2 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	000333	美的集團	836,030,994.78	5.13
2	300015	愛爾眼科	297,156,993.89	1.82
3	603833	歐派家居	279,375,818.21	1.71
4	600779	水井坊	114,011,436.14	0.70
5	600809	山西汾酒	85,689,571.21	0.53
6	000858	五糧液	84,353,735.17	0.52
7	300122	智飛生物	61,034,701.04	0.37
8	601888	中國中免	55,212,464.88	0.34
9	002311	海大集團	41,318,115.28	0.25
10	300760	邁瑞醫療	39,641,520.44	0.24
11	000568	瀘州老窖	29,203,466.00	0.18
12	603369	今世緣	27,951,667.00	0.17
13	600276	恒瑞醫藥	24,601,191.43	0.15
14	002304	洋河股份	21,844,671.00	0.13
15	300601	康泰生物	21,523,259.86	0.13
16	600867	通化東寶	18,475,232.92	0.11
17	600660	福耀玻璃	18,167,590.70	0.11
18	002352	順豐控股	16,546,908.00	0.10
19	603259	藥明康德	16,492,624.00	0.10
20	688050	愛博醫療	15,837,664.48	0.10

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。

#### 7.4.3 買入股票的成本總額及賣出股票的收入總額

金額單位：人民幣元

買入股票的成本（成交）總額	2,121,337,829.11
賣出股票的收入（成交）總額	2,383,892,947.59

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。

#### 7.5 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	408,219,810.00	2.45
2	央行票據	-	-
3	金融債券	4,085,628,000.00	24.50
	其中：政策性金融債	4,085,628,000.00	24.50
4	企業債券	-	-
5	企業短期融資券	-	-
6	中期票據	10,121,000.00	0.06
7	可轉債（可交換債）	3,201,874.04	0.02

8	同業存單	-	-
9	其他	-	-
10	合計	4,507,170,684.04	27.02

7.6 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	210201	21 國開 01	10,100,000	1,010,606,000.00	6.06
2	160404	16 農發 04	5,000,000	503,950,000.00	3.02
3	180204	18 國開 04	4,700,000	484,711,000.00	2.91
4	200407	20 農發 07	4,500,000	451,440,000.00	2.71
5	010107	21 國債(7)	4,074,050	408,219,810.00	2.45

7.7 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。

7.8 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。

7.9 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。

7.10 報告期末本基金投資的股指期貨交易情況說明

7.10.1 報告期末本基金投資的股指期貨持倉和損益明細

本基金本報告期末無股指期貨投資。

7.10.2 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。

7.11 報告期末本基金投資的國債期貨交易情況說明

7.11.1 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。

7.11.2 報告期末本基金投資的國債期貨持倉和損益明細

本基金本報告期末無國債期貨投資。

7.11.3 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。

7.12 投資組合報告附注

7.12.1 本基金投資的前十名證券的發行主體中，國家開發銀行出現在報告編製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。

7.12.2 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。

7.12.3 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	1,085,299.86
2	應收證券結算款	6,727,085.81
3	應收股利	-
4	應收利息	69,854,477.49
5	應收申購款	16,427,197.25
6	其他應收款	-
7	待攤費用	-
8	其他	-
9	合計	94,094,060.41

7.12.4 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。

7.12.5 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。

7.12.6 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。

## §8 基金份額持有人信息

8.1 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
1,172,018	7,248.32	57,986,635.91	0.68%	8,437,169,883.07	99.32%

8.2 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	2,351,456.03	0.03%

8.3 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	50~100
本基金基金經理持有本開放式基金	10~50

## §9 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	7,957,194,040.08
本報告期基金總申購份額	2,303,247,469.32
減：本報告期基金總贖回份額	1,765,284,990.42
本報告期基金拆分變動份額	-
本報告期期末基金份額總額	8,495,156,518.98

## §10 重大事件披露

### 10.1 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。

### 10.2 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

本基金管理人於 2021 年 4 月 9 日發布公告，鄭煜女士、孫彬先生擔任華夏基金管理有限公司副總經理，蔡向陽先生擔任華夏基金管理有限公司高級管理人員。

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。

### 10.3 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。

### 10.4 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。

### 10.5 為基金進行審計的會計師事務所情況

本報告期內本基金所聘用的會計師事務所未發生改變。

### 10.6 管理人、託管人及其高級管理人員受稽查或處罰等情況

本基金管理人、基金託管人涉及託管業務的部門及其高級管理人員在本報告期內無受稽查或處



罰等情況。

## 10.7 基金租用證券公司交易單元的有關情況

### 10.7.1 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	
西南證券	2	1,277,998,863.57	28.43%	1,190,198.19	31.31%	-
中信證券	3	813,538,226.83	18.10%	757,641.92	19.93%	-
國都證券	1	476,037,613.25	10.59%	348,125.62	9.16%	-
西部證券	1	423,757,351.73	9.43%	309,894.47	8.15%	-
海通證券	1	358,053,881.82	7.97%	333,456.21	8.77%	-
瑞銀證券	1	330,963,069.61	7.36%	242,033.95	6.37%	-
信達證券	1	224,079,904.68	4.99%	163,870.03	4.31%	-
中天證券	1	212,017,429.15	4.72%	155,048.61	4.08%	-
恒泰證券	1	122,934,020.84	2.74%	89,901.58	2.36%	-
川財證券	1	82,754,172.26	1.84%	60,518.66	1.59%	-
興業證券	2	48,711,598.83	1.08%	35,622.78	0.94%	-
國泰君安證券	1	46,267,974.87	1.03%	43,089.32	1.13%	-
安信證券	1	45,002,305.30	1.00%	41,910.38	1.10%	-
廣發證券	1	32,641,546.89	0.73%	30,398.90	0.80%	-

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，在近一年內無重大違規行為。

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 有較強的研究能力，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。

v 建立了廣泛的信息網路，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 對交易單元候選券商的研究服務進行評估

本基金管理人組織相關人員依據交易單元選擇標準對交易單元候選券商的服務品質和研究實力進行評估，確定選用交易單元的券商。

ii 協議簽署及通知託管人

本基金管理人與被選擇的券商簽訂交易單元租用協議，並通知基金託管人。

③除本表列示外，本基金還選擇了財通證券、長江證券、德邦證券、東方證券、申萬巨集源、申萬巨集源證券、銀河證券、中金公司、中泰證券、中銀國際、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。

#### 10.7.2 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		回購交易	
	成交金額	佔當期債券成交總額的比例	成交金額	佔當期回購成交總額的比例
西南證券	-	-	-	-
中信證券	338,896.70	100.00%	-	-
國都證券	-	-	-	-
西部證券	-	-	-	-
海通證券	-	-	-	-
瑞銀證券	-	-	-	-
信達證券	-	-	-	-
中天證券	-	-	-	-
恒泰證券	-	-	-	-
川財證券	-	-	623,600,000.00	100.00%
興業證券	-	-	-	-
國泰君安證券	-	-	-	-
安信證券	-	-	-	-
廣發證券	-	-	-	-

#### 10.8 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	2021-01-04
2	華夏回報證券投資基金第九十七次分紅公告	中國證監會指定報刊及網站	2021-01-06
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	2021-01-09
4	華夏回報證券投資基金第九十八次分紅公告	中國證監會指定報刊及網站	2021-01-12
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	2021-01-15
6	華夏基金管理有限公司關於終止部分代銷機構辦理本公司旗下基金銷售業務的公告	中國證監會指定報刊及網站	2021-01-20
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	2021-01-27

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	2021-02-01
9	華夏基金管理有限公司關於調整華夏回報證券投資基金、華夏回報二號證券投資基金申購業務上限的公告	中國證監會指定報刊及網站	2021-02-24
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	2021-02-24
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	2021-03-12
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	2021-04-02
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	2021-04-07
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	2021-04-09
15	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	2021-04-09
16	華夏回報證券投資基金第九十九次分紅公告	中國證監會指定報刊及網站	2021-04-14
17	華夏回報證券投資基金第一百次分紅公告	中國證監會指定報刊及網站	2021-04-20
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	2021-04-21
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	2021-05-08
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	2021-05-12
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	2021-05-13
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	2021-05-19
23	華夏基金管理有限公司關於深圳分公司營業場所變更的公告	中國證監會指定報刊及網站	2021-05-25
24	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	2021-05-28
25	華夏回報證券投資基金第 101 次分紅公告	中國證監會指定報刊及網站	2021-06-01
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	2021-06-04
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	2021-06-09
28	華夏回報證券投資基金第 102 次分紅公告	中國證監會指定報刊及網站	2021-06-16
29	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	2021-06-17

	聯方承銷證券的公告	網站	
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	2021-06-18
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	2021-06-19
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	2021-06-30

## §11 影響投資者決策的其他重要信息

### 11.1 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。

## §12 備查文件目錄

### 12.1 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。

### 12.2 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。

### 12.3 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。在支付手續費後，投資者可在合理時間內取得備查文件的複製件或複印本。

## §13 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）
<b>(1) 股票投資</b>		
<b>上市投資</b>		
<b>中國(100%)</b>		
五糧液	5,120,887	1,525,461,028.43
山西汾酒	3,257,860	1,459,521,280.00
洋河股份	6,989,074	1,448,136,132.80
貴州茅台	700,774	1,441,281,885.80
愛爾眼科	13,114,450	930,863,661.00
中國中免	2,921,935	876,872,693.50
長春高新	2,058,570	796,666,590.00
邁瑞醫療	1,402,293	673,170,754.65
智飛生物	2,346,121	438,091,174.33
國聯股份	876,837	87,657,394.89
昌紅科技	3,126,625	84,231,277.50
瀘州老窖	349,600	82,484,624.00
康泰生物	333,482	49,688,818.00
美的集團	540,687	38,588,831.19
億聯網路	384,481	32,219,507.80
中寵股份	559,999	22,959,959.00
寧德時代	33,800	18,076,240.00
麗珠集團	320,300	16,021,406.00
人福醫藥	558,000	15,774,660.00
沃森生物	243,200	15,005,440.00
海大集團	172,762	14,097,379.20
三鑫醫療	674,880	10,507,881.60
山河藥輔	676,633	10,095,364.36
伊利股份	250,000	9,207,500.00
藥明康德	58,224	9,117,296.16
恒瑞醫藥	119,527	8,124,250.19
吉比特	14,200	7,526,000.00
凱普生物	159,971	5,280,642.71
千禾味業	186,366	4,899,562.14
品茗股份	60,100	4,666,164.00
上海機場	90,000	4,331,700.00
普門科技	96,768	2,966,906.88
和輝光電	375,156	1,268,027.28
皓元醫藥	1,955	676,801.45

立訊精密	10,900	501,400.00
電氣風電	51,238	450,894.40
納微科技	3,477	408,547.50
之江生物	5,740	366,326.80
百克生物	3,486	364,565.88
諾泰生物	4,984	339,958.64
威高骨科	3,069	325,467.45
貝泰妮	1,253	323,597.88
凱立新材	1,941	270,808.32
百洋醫藥	4,614	251,115.78
奧精醫療	2,617	237,597.43
三峽能源	33,000	209,880.00
百川暢銀	3,283	176,700.30
利和興	4,704	168,966.51
歡樂家	9,279	168,775.16
崧盛股份	2,001	159,001.62
東鵬飲料	632	158,505.60
力芯微	1,174	156,952.06
亞輝龍	3,435	152,514.00
氣派科技	2,000	133,400.00
普聯軟體	2,410	132,487.34
陽光諾和	1,485	131,868.00
歐林生物	3,412	127,642.92
東威科技	3,049	117,264.54
康拓醫療	1,085	114,619.40
呈和科技	2,672	113,907.36
玉馬遮陽	4,097	99,899.55
福立旺	4,198	99,492.60
中偉股份	610	99,430.00
偉創電氣	4,751	94,972.49
嘉益股份	3,115	90,654.98
創益通	2,535	89,214.50
康眾醫療	1,890	84,105.00
利元亨	2,149	83,488.65
華利集團	925	80,937.50
聖諾生物	1,672	80,924.80
華立科技	1,750	79,474.50
三孚新科	2,213	78,561.50
齊魯銀行	6,731	62,598.30
德邁仕	3,022	60,305.15
寧波方正	2,003	60,075.24
愛瑪科技	1,019	59,224.28
揚電科技	1,691	56,994.16

航宇科技	4,926	56,550.48
泰福泵業	1,998	55,828.42
中紅醫療	601	54,324.39
英科再生	2,469	54,219.24
晶雪節能	2,172	50,480.96
瑞豐新材	474	49,556.70
東航物流	2,090	49,470.30
漱玉平民	5,550	49,173.00
密封科技	4,210	44,794.40
立高食品	360	41,655.60
金冠電氣	2,892	41,095.32
愛威科技	1,259	39,520.01
工大高科	1,717	37,035.69
浙江新能	3,045	37,027.20
九豐能源	1,090	35,326.90
科匯股份	1,899	34,903.62
瑞豐銀行	2,230	34,721.10
華峰超纖	6,434	31,848.30
英諾鐳射	2,899	27,424.54
神農集團	569	26,856.80
震裕科技	240	23,964.00
聯科科技	682	22,581.02
億田智能	309	21,407.52
歐派家居	144	20,442.24
創識科技	399	19,926.06
愛慕股份	553	18,249.00
威騰電氣	2,693	17,289.06
海程邦達	733	15,994.06
法本信息	600	15,774.00
奧泰生物	100	14,900.00
蘇文電能	317	14,356.93
格林精密	1,162	14,025.34
無錫振華	764	13,706.16
華菱線纜	1,754	13,558.42
南極光	307	13,317.66
藥易購	244	13,105.24
易瑞生物	443	12,634.36
稅友股份	637	12,230.40
中辰股份	1,112	11,609.28
南山智尚	1,063	11,065.83
德才股份	349	11,014.44
菱電電控	100	11,001.00
嘉亨家化	232	10,688.24

綠田機械	295	10,516.75
富春染織	422	10,165.98
特發服務	366	10,123.56
天秦裝備	287	9,996.21
英力股份	371	9,571.80
中金輻照	576	9,429.12
和林微納	100	9,415.00
恒輝安防	340	9,207.20
共同藥業	286	9,020.44
曼卡龍	474	8,949.12
冠中生態	324	8,884.08
通用電梯	672	8,809.92
深水海納	394	8,695.58
德固特	219	8,569.47
新中港	1,377	8,358.39
建工修復	300	8,166.00
志特新材	264	8,070.48
川網傳媒	301	8,069.81
博俊科技	359	7,969.80
屹通新材	322	7,882.56
豪森股份	300	7,677.00
致遠新能	295	7,318.95
宏發股份	112	7,022.40
博亞精工	245	6,931.05
中國平安	104	6,685.12
江天化學	217	6,531.70
商絡電子	492	6,410.76
中洲特材	283	6,364.67
新華保險	133	6,106.03
春暉智控	255	5,867.55
曉鳴股份	507	5,850.78
星球石墨	100	5,587.00
艾隆科技	100	5,466.00
萬辰生物	430	5,439.50
華騏環保	183	5,407.65
通業科技	234	5,396.04
杭州熱電	525	4,662.00
海螺水泥	99	4,063.95
九聯科技	200	3,456.00
愛科科技	100	3,455.00
楚天龍	100	3,040.00
西力科技	200	2,852.00
騰景科技	100	2,177.00





銀行間同業市場買入返售金融資產		1,167,551,352.04
交易所市場買入返售金融資產		-
<b>合計</b>		<b>1,167,551,352.04</b>
<b>總投資資產</b>		<b>15,829,197,626.72</b>
<b>銀行存款和結算備付金</b>		<b>833,948,126.16</b>
<b>其他各項資產</b>		<b>94,094,060.41</b>
<b>合計</b>		<b>16,757,239,813.29</b>

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
		(%) 2021 年 6 月 30 日	例 (%) 2020 年 12 月 31 日
1	股票	60.89	61.96
2	債券	27.02	26.46
3	資產支持證券	-	-
4	買入返售金融資產	7.00	-

華夏基金管理有限公司

二〇二一年八月三十日