# 華夏興華混合型證券投資基金 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:中國建設銀行股份有限公司

報告送出日期:二〇二一年八月三十日

# 華夏興華混合型證券投資基金("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,除華夏興華混合型證券投資基金和華夏回報證券投資基金外,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。

基金託管人中國建設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	41
	7.1 期末基金資產組合情況	41
	7.2 報告期末按行業分類的股票投資組合	42
	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	42
	7.4 報告期內股票投資組合的重大變動	46
	7.5 期末按債券品種分類的債券投資組合	
	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	
	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	48
	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	48
	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	48
	7.10 報告期末本基金投資的股指期貨交易情況說明	48
	7.11 報告期末本基金投資的國債期貨交易情況說明	48
	7.12 投資組合報告附注	
	基金份額持有人信息	
§9	開放式基金份額變動	50
	0 重大事件披露	
§1	1影響投資者決策的其他重要信息	53
§12	2 備查文件目錄	53
81	3 補充地露	55

# §2 基金簡介

# 2.1 基金基本情况

基金名稱	華夏興華混合型證券投資基金
基金簡稱	華夏興華混合
基金主代碼	519908
交易代碼	519908
基金運作方式	契約型開放式
基金合同生效日	2013年4月12日
基金管理人	華夏基金管理有限公司
基金託管人	中國建設銀行股份有限公司
報告期末基金份額總額	280,762,339.17 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 (519908)。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 (960004)。

#### 2.2 基金產品說明

投資目標	密切跟蹤經濟動向,挖掘中國經濟發展過程中所蘊含的機會,更好地分享中
	國經濟較快成長的發展成果,力爭實現基金資產的長期、持續增值。
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、中小企業
1又貝尔哈	私募債券投資策略、權證投資策略、股指期貨投資策略等。
業績比較基準	本基金的業績比較基準為:滬深 300 指數×70%+上證國債指數×30%。
風險收益特徵	本基金為混合基金,風險與收益高於債券基金與貨幣市場基金,低於股票基
<u>烘吹収益</u> 村倒	金,屬於較高風險、較高收益的品種。

# 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	中國建設銀行股份有限公司	
产业标志	姓名	李彬	李申	
信息披露	聯絡電話	400-818-6666	021-60637102	
貝貝八	電子郵箱	service@ChinaAMC.com	lishen.zh@ccb.com	
客戶服務電	話	400-818-6666	021-60637111	
傳真		010-63136700	021-60635778	
註冊地址		北京市順義區安慶大街甲3號 院	北京市西城區金融大街25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	北京市西城區鬧市口大街1號院1號 樓	
郵政編碼		100033	100033	
法定代表人		楊明輝	田國立	

# 2.4 信息披露方式

本基金選定的信息披露報紙名稱	《中國證券報》
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	中國證券登記結算有限責任公司	北京市西城區太平橋大街 17 號

# §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	201,320,047.97
本期利潤	61,688,626.95
加權平均基金份額本期利潤	0.2130
本期加權平均淨值利潤率	7.14%
本期基金份額淨值增長率	7.34%
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	624,691,006.31
期末可供分配基金份額利潤	2.2250
期末基金資產淨值	932,498,204.11
期末基金份額淨值	3.321
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	254.83%

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	2.53%	1.28%	-1.37%	0.57%	3.90%	0.71%
過去三個月	22.23%	1.21%	2.75%	0.68%	19.48%	0.53%

過去六個月	7.34%	1.81%	0.89%	0.92%	6.45%	0.89%
過去一年	53.82%	1.81%	18.59%	0.93%	35.23%	0.88%
過去三年	111.39%	1.63%	38.99%	0.96%	72.40%	0.67%
自基金轉型起 至今	254.83%	1.68%	93.61%	1.02%	161.22%	0.66%

3.2.2 自基金轉型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

#### 華夏興華混合型證券投資基金

#### 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

(2013年4月12日至2021年6月30日)



注:自 2013 年 4 月 12 日起,由《興華證券投資基金基金合同》修訂而成的《華夏興華混合型 證券投資基金基金合同》生效。

# §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(516600)、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)、黄金 ETF9999(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,説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 (助理) 任職日期	證券從業 年限	說明
陽琨	本基金的基金的基金的基金的基金的基金的基金的基金的基金的基础。	2013-04-12	26年	碩士。曾任寶盈基金經 理助理,益民基金投資部部 門經理,中國對外經濟貿易 信託投資有限公司財務部 門經理等。2006年8月加入 華夏基金管理有限公司。曾 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經理(2015年9月 1日至 2017年5月2日期間)、華夏大世籍選證券投資基金經理(2015年9月 1日至 2017年5月2日期間)、華夏大中華企業精選靈活配置混合型證券投資基金 (QDII)基金經理(2016年 1月20日至 2018年10月11日期間)、華夏新時代靈活配置混合型證券投資基金 (QDII)基金經理(2018年 5月30日至 2019年7月15日期間)等。

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,股票市場震盪起伏。年初市場延續了 2020年末的上升勢頭,尤其是成長類股票在年初快速上行,但農曆新年後市場發生了一次快速下跌。投資者擔心 2020年四季度開始的信貸增速放緩意味著流動性環境發生了趨勢性變化,抱團白馬股由於估值水平較高而發生鬆動,基金重倉持有的白馬股票快速下行。但在 3 月後,投資者觀察到銀行間資金利率市場仍然保持寬鬆,股票市場隨後逐步企穩並出現了一輪反彈。總體而言,上半年雖然國內信貸增速放緩,實體信用創造低於預期,但整體流動性依舊寬鬆。在 4 月後市場反彈過程中,成長類個股表現較好,新能源及新能源車、醫藥、高端製造等景氣類個股基本回復高位,部分個股創出新高。此外,週期類個股在強勁的業績報告刺激下也表現突出,部分企業利潤受益於商品價格大幅上漲而得到市場關注。穩健成長類個股表現相對較弱,部分受損於原文件價格上行的個股表現不佳。

本基金在上半年延續了對高景氣板塊的超配,進一步集中投資於新能源車、軍工產業鏈和高端製造業,並少量投資於順週期價格上行的板塊。

#### 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 3.321 元,本報告期份額淨值增長率為 7.34%,同期 業績比較基準增長率為 0.89%。

4.5 管理人對宏觀經濟、證券市場及行業走勢的簡要展望

展望下一階段,我們認為股票市場可能繼續呈現區間波動的走勢。2021年影響股票市場發展的

因素較複雜:一方面海外主要經濟體採取了超寬鬆的財政貨幣政策組合,導致全球通脹壓力增大;另一方面國內經濟提前收縮,國家採取了相對謹慎的政策措施,力圖將歐美經濟體政策外溢的副作用降至較低水平。鑒於內外部因素的多變性,我們在年內可能需要面對一個較複雜的政策組合環境。因此,我們認為股票市場可能繼續波動分化,投資以結構性機會為主。未來一段時間,我們將淡化股票倉位擇時操作,繼續相對集中投資於長期發展前景與短期景氣兼具的板塊與個股,繼續看好以新能源車、光伏、軍工產業鏈為代表的高端製造業,以及國產化超預期的部分半導體產業鏈股票,並關注受益於價格上漲的部分週期類個股,認為其超預期的業績表現可能為投資者帶來階段性回報。

我們將繼續強調自下而上的個股選擇,爭取以個股的確定性對抗市場的不確定性,爭取以專業投資為持有人提供理想的回報。

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

#### 4.6 管理人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

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。

4.8 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,中國建設銀行股份有限公司在本基金的託管過程中,嚴格遵守了《證券投資基金法》、基金合同、託管協議和其他有關規定,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

行了基金託管人應盡的義務。

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,本託管人按照國家有關規定、基金合同、託管協議和其他有關規定,對本基金的基金資產淨值計算、基金費用開支等方面進行了認真的覆核,對本基金的投資運作方面進行了監督,未發現基金管理人有損害基金份額持有人利益的行為。

報告期內,本基金利潤分配情況真實、準確。

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

本託管人覆核審查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。

# §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:華夏興華混合型證券投資基金

報告截止日:2021年6月30日

次本	附注號	本期末	上年度末
<b>資產</b>	門以土地	2021年6月30日	2020年12月31日
資產:		-	-
銀行存款	6.4.7.1	103,872,631.63	70,341,038.59
結算備付金		1,748,370.88	1,570,486.91
存出保證金		290,024.10	268,694.53
交易性金融資產	6.4.7.2	833,595,316.96	873,230,074.04
其中:股票投資		833,434,616.96	863,221,074.04
基金投資		-	-
債券投資		160,700.00	10,009,000.00
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	-	-
應收證券結算款		8,864,487.90	-
應收利息	6.4.7.5	11,384.90	265,540.03
應收股利		-	-
應收申購款		143,609.48	200,531.87
遞延所得稅資產		-	-
其他資產	6.4.7.6	218,378.00	218,378.00

資產總計		948,744,203.85	946,094,743.97
負債和所有者權益	附注號	本期末 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
負債:		-	-
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		-	1,113,127.28
應付贖回款		1,780,836.93	1,495,199.51
應付管理人報酬		1,120,672.82	1,058,872.96
應付託管費		186,778.80	176,478.81
應付銷售服務費		-	-
應付交易費用	6.4.7.7	11,772,179.54	10,986,525.21
應交稅費		783,414.41	783,413.95
應付利息		-	-
應付利潤		-	-
遞延所得稅負債		-	-
其他負債	6.4.7.8	602,117.24	701,212.44
負債合計		16,245,999.74	16,314,830.16
所有者權益:		-	-
實收基金	6.4.7.9	266,774,682.62	285,521,979.00
未分配利潤	6.4.7.10	665,723,521.49	644,257,934.81
所有者權益合計		932,498,204.11	929,779,913.81
負債和所有者權益總計		948,744,203.85	946,094,743.97

注:報告截止日 2021 年 6 月 30 日,基金份額淨值 3.321 元,基金份額總額 280,762,339.17 份。

# 6.2 利潤表

會計主體:華夏興華混合型證券投資基金

本報告期: 2021年1月1日至2021年6月30日

		本期	上年度可比期間
項目	附注號	2021年1月1日至	2020年1月1日至2020
		2021年6月30日	年6月30日
一、收入		72,797,308.56	140,968,160.15
1.利息收入		252,597.68	882,230.47
其中:存款利息收入	6.4.7.11	211,950.24	158,198.39
債券利息收入		38,834.04	722,218.59
資產支持證券利息收入		1	-
買入返售金融資產收入		1,813.40	1,813.49
證券出借利息收入		-	-

其他利息收入		-	-
2.投資收益(損失以"-"填列)		212,126,137.48	96,122,405.34
其中:股票投資收益	6.4.7.12	209,886,231.31	93,383,869.94
基金投資收益		-	-
債券投資收益	6.4.7.13	-7,710.00	637,940.66
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	2,247,616.17	2,100,594.74
3.公允價值變動收益(損失以"-"號填列)	6.4.7.18	-139,631,421.02	43,887,778.80
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	49,994.42	75,745.54
滅:二、費用		11,108,681.61	11,480,444.79
1.管理人報酬		6,440,281.68	5,199,753.61
2.託管費		1,073,380.30	866,625.66
3.銷售服務費		-	-
4.交易費用	6.4.7.20	3,469,940.95	5,285,914.52
5.利息支出		-	-
其中:賣出回購金融資產支出		-	-
6.稅金及附加		0.04	2.30
7.其他費用	6.4.7.21	125,078.64	128,148.70
三、利潤總額(虧損總額以"-"號填列)		61,688,626.95	129,487,715.36
滅:所得稅費用		-	
四、淨利潤(淨虧損以"-"號填列)		61,688,626.95	129,487,715.36

6.3 所有者權益(基金淨值)變動表

會計主體:華夏興華混合型證券投資基金

本報告期: 2021年1月1日至2021年6月30日

	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		
項目			
	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	205 521 070 00	(44.257.024.01	020 770 012 01
金淨值)	285,521,979.00	644,257,934.81	929,779,913.81
二、本期經營活動產生的			
基金淨值變動數(本期利	-	61,688,626.95	61,688,626.95
潤)			
三、本期基金份額交易產			
生的基金淨值變動數(淨	-18,747,296.38	-40,223,040.27	-58,970,336.65
值減少以"-"號填列)			

其中:1.基金申購款	18,755,019.59	41,567,371.84	60,322,391.43
2.基金贖回款	-37,502,315.97	-81,790,412.11	-119,292,728.08
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)	-	-	-
五、期末所有者權益(基 金淨值)	266,774,682.62	665,723,521.49	932,498,204.11
		上年度可比期間	
項目	2020 3	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)	402,049,812.73	361,671,978.85	763,721,791.58
二、本期經營活動產生的 基金淨值變動數(本期利 潤)	-	129,487,715.36	129,487,715.36
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)	-69,906,226.39	-68,482,416.67	-138,388,643.06
其中:1.基金申購款	14,449,981.17	13,015,428.80	27,465,409.97
2.基金贖回款	-84,356,207.56	-81,497,845.47	-165,854,053.03
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)	-	-	-
五、期末所有者權益(基 金淨值)	332,143,586.34	422,677,277.54	754,820,863.88

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基金基本情况

根據原興華證券投資基金(以下簡稱"基金興華")基金份額持有人大會審議通過的《關於興華證券投資基金轉型有關事項的議案》,並經中國證券監督管理委員會(以下簡稱"中國證監會")證監許可[2013]277號《關於核准興華證券投資基金基金份額持有人大會有關轉換基金運作方式決議的批覆》及上海證券交易所上證基字[2013]95號《關於終止興華證券投資基金上市的決定》的同意,基金興華於2013年4月11日進行終止上市權利登記,2013年4月12日終止上市。原《興華證券投資基金基金合同》於同一日起生效,同

時基金興華更名為華夏興華混合型證券投資基金(以下簡稱"本基金")。本基金為契約型開放式,存續期限為不定期。本基金的基金管理人為華夏基金管理有限公司,基金託管人為中國建設銀行股份有限公司。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興華混合型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《華夏興華混合型證券投資基金招募說明書》,基金管理人華夏基金管理有限公司確定 2013 年 5 月 15 日為基金興華基金份額折算基準日。經本基金管理人計算並經基金託管人覆核的折算前基金份額淨值為 1.052 元,精確到小數點後第 9 位為 1.052420524 元 (第 10 位捨去),本基金管理人按照 1.052420524 的折算比例對原興華證券投資基金進行了基金份額折算,折算後的基金份額淨值為 1.000 元,折算後的基金份額為折算前的基金份額乘以折算比例,採用截尾法保留到整數位元,所產生的誤差歸入基金財產。折算前原興華證券投資基金份額總額為 20 億份,折算後基金份額總額為 2,104,814,287 份。

本基金於基金合同生效後自 2013 年 4 月 18 日至 2013 年 5 月 10 日期間內開放集中申購,共募集 1,355,413,663.50 元,其中用於折合基金份額的集中申購資金利息共計 353,522.99 元,業經德勤華永會計師事務所(特殊普通合夥)德師報(驗)字(13)第0084號審驗報告予以驗證。上述集中申購募集資金折合為 1,355,413,663.50 份基金份額,其中集中申購資金利息折合 353,522.99 份基金份額。

根據《中華人民共和國證券投資基金法》和《華夏興華混合型證券投資基金基金合同》等有關規定,本基金的投資範圍為具有良好流動性的金融工具,包括國內依法發行的股票(包括創業板、中小板股票、存托憑證)、債券(含中小企業私募債券)、貨幣市場工具、權證、資產支持證券、股指期貨以及法律法規或中國證監會允許基金投資的其他金融工具。

#### 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[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有關問題的通知》、財稅[2017]90 號《關於租入固定資產進項稅額抵扣等增值稅政策的通知》及其他相關財稅法規和實務操作,主要稅項列示如下:

- (1) 以發行基金方式募集資金不屬於增值稅徵收範圍,不徵收增值稅。
- (2) 資管產品運營過程中發生的增值稅應稅行為,以資管產品管理人為增值稅納稅人。資管產品管理人運營資管產品過程中發生的增值稅應稅行為,暫適用簡易計稅方法,按照 3%的徵收率繳納增值稅。
  - (3)基金買賣股票、債券的差價收入免征增值稅,暫不徵收企業所得稅。
  - (4) 存款利息收入不徵收增值稅。

- (5) 國債、地方政府債利息收入,金融同業往來利息收入免征增值稅。
- (6) 對基金取得的債券的利息收入及其他收入,暫不徵收企業所得稅。
- (7)基金作為流通股股東在股權分置改革過程中收到由非流通股股東支付的股份、現金等對價 暫免徵收印花稅、企業所得稅和個人所得稅。
- (8) 對基金在境內取得的股票的股息、紅利收入,由上市公司在向基金派發股息、紅利收入時代扣代繳 20%的個人所得稅,暫不徵收企業所得稅。基金在境內從上市公司分配取得的股息紅利所得,持股期限在 1 個月以內(含 1 個月)的,全額計入應納稅所得額,持股期限在 1 個月以上至 1 年(含 1 年)的,減按 50%計入應納稅所得額,持股期限超過 1 年的,暫免徵收個人所得稅。對基金通過滬港通/深港通投資香港聯交所上市 H 股取得的股息紅利,H 股公司應向中國證券登記結算有限責任公司(以下簡稱"中國結算")提出申請,由中國結算向 H 股公司提供內地個人投資者名冊,H 股公司按照 20%的稅率代扣個人所得稅。基金通過滬港通/深港通投資香港聯交所上市的非 H 股取得的股息紅利,由中國結算按照 20%的稅率代扣個人所得稅。對香港市場投資者取得的股息、紅利收入按照 10%的稅率代扣所得稅。
- (9)基金在境內賣出股票按 0.1%的稅率繳納股票交易印花稅,買入股票不徵收股票交易印花稅。基金通過滬港通/深港通買賣、繼承、贈與聯交所上市股票,按照香港特別行政區現行稅法規定繳納印花稅。
- (10)基金在境外證券交易所進行交易或取得的源自境外證券市場的收益,其涉及的稅收政策, 按照相關國家或地區稅收法律和法規執行。
- (11)本基金分別按實際繳納的增值稅額的 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

項目	本期末 2021年6月30日
活期存款	103,872,631.63
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	103,872,631.63

#### 6.4.7.2 交易性金融資產

單位:人民幣元

		本期末		
	項目	2021年6月30日		
		成本	公允價值	公允價值變動
股票		678,472,238.48	833,434,616.96	154,962,378.48
貴金屬	屬投資-金交所			
黄金合約		1	-	-
	交易所市場	160,700.00	160,700.00	-
債券	銀行間市場	1	-	-
	合計	160,700.00	160,700.00	-
資產支	· 持證券	ı	-	
基金		ı	-	
其他		•	-	-
合計		678,632,938.48	833,595,316.96	154,962,378.48

# 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

無。

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

17H U	本期末	
項目	2021年6月30日	
應收活期存款利息	10,452.81	
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	786.80	
應收債券利息	14.79	
應收資產支持證券利息	-	
應收買入返售證券利息	-	
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	130.50	
合計	11,384.90	

# 6.4.7.6 其他資產

單位:人民幣元

項目	本期末 2021 年 6 月 30 日
其他應收款	218,378.00
待攤費用	-
合計	218,378.00

# 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	11,772,179.54
銀行間市場應付交易費用	-
合計	11,772,179.54

# 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	2,938.29
應付證券出借違約金	-
預提費用	99,178.95
合計	602,117.24

# 6.4.7.9 實收基金

金額單位:人民幣元

	本期		
項目	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	300,492,372.64	285,521,979.00	
本期申購	19,738,553.63	18,755,019.59	
本期贖回(以"-"號填列)	-39,468,587.10	-37,502,315.97	
本期末	280,762,339.17	266,774,682.62	

# 6.4.7.10 未分配利潤

項目	已實現部分	未實現部分	未分配利潤合計
上年度末	460,972,272.00	183,285,662.81	644,257,934.81
本期利潤	201,320,047.97	-139,631,421.02	61,688,626.95
本期基金份額交易產生的	-37,601,313.66	-2,621,726.61	-40,223,040.27

變動數			
其中:基金申購款	35,552,639.79	6,014,732.05	41,567,371.84
基金贖回款	-73,153,953.45	-8,636,458.66	-81,790,412.11
本期已分配利潤	-	-	-
本期末	624,691,006.31	41,032,515.18	665,723,521.49

# 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	197,213.52	
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	12,260.25	
其他	2,476.47	
合計	211,950.24	

# 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	1,201,701,505.84
減:賣出股票成本總額	991,815,274.53
買賣股票差價收入	209,886,231.31

# 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	10,296,000.00	
減: 賣出債券(債轉股及債券到期兌付) 成本總額	10,007,710.00	
減:應收利息總額	296,000.00	
買賣債券差價收入	-7,710.00	

# 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	2,247,616.17
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	2,247,616.17

#### 6.4.7.18 公允價值變動收益

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	-139,631,421.02
——股票投資	-139,630,131.02
——債券投資	-1,290.00
——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	-139,631,421.02

#### 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		49,994.42
合計		49,994.42

#### 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	3,469,940.95
銀行間市場交易費用	-
交易基金產生的費用	-
其中:申購費	-
贖回費	-
合計	3,469,940.95

#### 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	39,671.58
信息披露費	59,507.37
證券出借違約金	-
銀行費用	7,299.69
銀行間帳戶維護費	18,000.00
其他	600.00
合計	125,078.64

#### 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

截至財務報表批准日,本基金無資產負債表日後事項。

#### 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
中國建設銀行股份有限公司("中國建設銀行")	基金託管人

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

無。

6.4.10.1.2 權證交易

無。

6.4.10.1.3 債券交易

無。

6.4.10.1.4 債券回購交易

無。

6.4.10.1.5 應支付關聯方的佣金

無。

- 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

	本期	上年度可比期間
項目	2021年1月1日至2021年6月	2020年1月1日至2020年6月30
	30⊟	日
當期發生的基金應支付的管理費	6,440,281.68	5,199,753.61
其中:支付銷售機構的客戶維護費	509,955.85	429,782.49

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

	本期	上年度可比期間
項目	2021年1月1日至2021年6月	2020年1月1日至2020年6月30
	30⊟	日
當期發生的基金應支付的託管費	1,073,380.30	866,625.66

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

	本	期	上年度同	可比期間
關聯方名稱	2021年1月1日至	2021年6月30日	2020年1月1日至	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
中國建設銀行活期存款	103,872,631.63	197,213.52	29,466,484.76	134,607.54

注:本基金的活期銀行存款由基金託管人中國建設銀行保管,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											
				基金在	E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	總金額							
				位:股/張)	総立領							
中信證券	600905	三峽能源	網下申購	1,296,803	3,436,527.95							

中信證券	688819	天能股份	網下申購	14,759	616,778.61
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	日至 2020 年 6	月 30 日	
				基金在	三承銷期內買入
關聯方名稱	證券代碼	證券名稱	發行方式	數量(單	總金額
				位:股/張)	於 立
-	-	-	-	-	-

#### 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

本基金本報告期無利潤分配事項。

- 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	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

				受						
				限類						
				型大						
603712	セーニ	2021-03- 29	2021-09-	宗轉讓流通受限	31.19	34.47	500,000	15,595,000.00	17,235,000.00	-
600905	三峽能源	2021-06-	2021-12-	新發流通受限	2.65	5.67	907,763	2,405,571.95	5,147,016.21	-
688183	生益電子	2021-02- 10	2021-08- 25	新發流通受限	12.42	14.19	18,394	228,453.48	261,010.86	-
688076	諾泰生物	2021-05- 12	2021-11-22	新發流通受限	15.57	48.55	4,984	77,600.88	241,973.20	-
688059	華銳精密	2021-02- 01	2021-08- 09	新發流通受限	37.09	160.26	1,023	37,943.07	163,945.98	-
300957	貝泰妮	2021-03- 18	2021-09- 27	新發流通受限	47.33	251.96	644	30,480.52	162,262.24	-
688097	博眾	2021-04-	2021-11-	新發	11.27	28.01	3,983	44,888.41	111,563.83	-

	精工			流通受四						
300919	中偉股份	2020-12- 15	2021-07-	限新發流通受限	24.60	163.00	610	15,006.00	99,430.00	-
688682	霍萊沃	2021-04-	2021-10-20	新發流通受限	45.72	103.85	946	43,251.12	98,242.10	1
688499	利元亨	2021-06-23	2021-07-	新發流通受限	38.85	38.85	2,149	83,488.65	83,488.65	ı
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	ı
688350	富淼科技	2021-01-	2021-07-28	新發流通受限	13.58	22.44	2,552	34,656.16	57,266.88	ı
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	1
300981	中紅醫療	2021-04- 19	2021-10-	新發流通	48.59	90.39	601	29,202.59	54,324.39	-

				受						
				限						
688087	英科再生	2021-06-30	2021-07-	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	新發流通受限	8.86	8.86	4,995	44,255.70	44,255.70	-
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-	新發流通受限	10.64	10.64	3,789	40,314.96	40,314.96	-
688092	XD 愛 科	2021-03- 12	2021-09-	新發流通受限	19.11	33.21	1,137	21,728.07	37,759.77	-
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-	2021-09-	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-	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	2021-07- 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-	新發流通受限	12.76	43.38	307	3,917.32	13,317.66	1
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	2021-01- 20	2021-07- 27	新發	12.25	53.71	244	2,989.00	13,105.24	-

	購			流						
	7113			通						
				受						
				限						
				新						
	利	2021.06	2021 12	發						
301013	和	2021-06-	2021-12- 29	流通	8.72	27.11	471	4,107.12	12,768.81	-
	興	21	29	受						
				限						
				新						
	易			發						
300942	瑞	2021-02-	2021-08-	流	5.31	28.52	443	2,352.33	12,634.36	_
300712	生	02	09	通	3.31	20.32	113	2,332.33	12,03 1.30	
	物			受						
				限新						
				發						
	歡	2021-05-	2021-12-	流						
300997	樂	26	02	通	4.94	13.05	928	4,584.32	12,110.40	-
	家			受						
				限						
				新						
	中	2021 01	2021-07-	發						
300933	辰股	2021-01- 15	2021-07-	流通	3.37	10.44	1,112	3,747.44	11,609.28	-
	份	13	22	受						
				限						
				新						
	崧			發						
301002	盛	2021-05-	2021-12-	流	18.71	57.62	201	3,760.71	11,581.62	_
	股	27	07	通				,	Ź	
	份			受限						
				新						
	德			發						
605287	才	2021-06-	2021-07-	流	21 57	21 57	349	11 014 44	11 014 44	
003287	股	28	06	通	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-
	份			受						
	<del></del>			限						
	嘉亨	2021-03-	2021-09-	新發						
300955	家	16	2021-09-	资流	16.53	46.07	232	3,834.96	10,688.24	-
	化	10	∠ <del>-</del> 7	通						
	ı			\(\frac{1}{14}\)						

				受						
				限						
300996	普聯軟體	2021-05- 26	2021-12-	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-	新發流通受限	12.85	25.80	371	4,767.35	9,571.80	-
300962	中金輻照	2021-03-	2021-10-	新發流通受限	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12	1
300952	恒輝安防	2021-03-	2021-09-	新發流通受限	11.72	27.08	340	3,984.80	9,207.20	-
300966	共同藥業	2021-03-	2021-10-	新發流通受限	8.24	31.54	286	2,356.64	9,020.44	-
300945	曼卡龍	2021-02-	2021-08-	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-	2021-07-	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-	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-	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-	新發流通受限	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00	-
300986	志特新材	2021-04-	2021-11-	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-	新發流通受限	6.79	26.81	301	2,043.79	8,069.81	-
300926	博 俊	2020-12- 29	2021-07- 12	新發	10.76	22.20	359	3,862.84	7,969.80	-

	科技			流通						
				受限						
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-	2021-07-	新發流通受限	13.11	24.48	322	4,221.42	7,882.56	-
300985	致遠新能	2021-04-	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-	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	13.39	30.10	217	2,905.63	6,531.70	-

				受						
				限						
300975	商絡電子	2021-04-	2021-10-	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-	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	新發流通受限	14.20	33.84	175	2,485.00	5,922.00	-
300943	春暉智控	2021-02-	2021-08-	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-	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-	2021-07-	新發流通受限	13.87	29.55	183	2,538.21	5,407.65	-

300960	通業科技	2021-03-	2021-09-	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-	2021-12-	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-	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-	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	品 雪	2021-06- 09	2021-12- 20	新發	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	-

	節能			流通						
				受限						
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	-
6.4.12.1.	2 受限	證券類別:	債券							
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		期末 成本總額	期末 估值總額	備註
127038	國微轉債	2021-06- 10	2021-07- 14	新發流通受限	100.00	100.00	1,607	160,700.00	160,700.00	-

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准。

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				
	1年以內	1-5年	5年以上	合計
2021年6月30日		· 		
銀行存款	103,872,631.63	-		- 103,872,631.63
結算備付金	1,748,370.88	-		1,748,370.88
結算保證金	290,024.10	-		- 290,024.10
債券投資	160,700.00	-		- 160,700.00
資產支持證券	-	-		_
買入返售金融資產	-	-		_
應收直銷申購款	2,401.38	-		- 2,401.38
上年度末				
2020年12月31	1年以內	1-5年	5 年以上	合計
日				
銀行存款	70,341,038.59	-		70,341,038.59
結算備付金	1,570,486.91	-		- 1,570,486.91
結算保證金	268,694.53	-		- 268,694.53
債券投資	10,009,000.00	-		- 10,009,000.00
資產支持證券	-	-		-
買入返售金融資產	-	-		_
應收直銷申購款	643.84	-		- 643.84
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	↓□見見 〒 『○ 総数申/。 / / / / 公数 系· /	對資產負債表日基金資產淨值的 影響金額(單位:人民幣元)				
	相關風險變數的變動	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	-	3,435.19			

	利率上升 25 個基點	-	-3,432.89
--	-------------	---	-----------

## 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

	本期	末	上年度末		
	2021年6	月 30 日	2020年12月31日		
項目		佔基金資		佔基金資產	
	公允價值	產淨值比	公允價值	淨值比例	
		例 (%)		(%)	
交易性金融資產-股票投資	833,434,616.96	89.38	863,221,074.04	92.84	
交易性金融資產-基金投資	-	1	ı	1	
交易性金融資產-債券投資	160,700.00	0.02	ı	1	
交易性金融資產-貴金屬投資	-	1	ı	-	
衍生金融資產-權證投資	-	1	ı	-	
其他	-	-	-	-	
合計	833,595,316.96	89.39	863,221,074.04	92.84	

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由於四捨五人的原因,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						
	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	(日)翰/巴(P) (安安) (日) (安里)	本期末	上年度末				
73 171		2021年6月30日	2020年12月31日				
	-5%	-47,969,242.92	-49,131,270.97				
	+5%	47,969,242.92	49,131,270.97				

## 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 826,595,526.98 元,第二層次的餘額為 6,999,789.98 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 840,824,944.10 元,第二層次的餘額為 32,405,129.94 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,於股票複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

序號	項目	金額	佔基金總資產的比例(%)
1	權益投資	833,434,616.96	87.85
	其中:股票	833,434,616.96	87.85
2	基金投資	-	-
3	固定收益投資	160,700.00	0.02

	其中:債券	160,700.00	0.02
	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	105,621,002.51	11.13
8	其他各項資產	9,527,884.38	1.00
9	合計	948,744,203.85	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	11,290.28	0.00
В	採礦業	71,345,894.04	7.65
С	製造業	676,408,307.72	72.54
D	電力、熱力、燃氣及水生產和供應業	5,197,063.80	0.56
Е	建築業	25,371.37	0.00
F	批發和零售業	328,753.90	0.04
G	交通運輸、倉儲和郵政業	-	-
Н	住宿和餐飲業	-	-
I	信息傳輸、軟體和信息技術服務業	71,537,896.50	7.67
J	金融業	97,319.40	0.01
K	房地產業	10,123.56	0.00
L	租賃和商務服務業	15,994.06	0.00
M	科學研究和技術服務業	8,412,164.00	0.90
N	水利、環境和公共設施管理業	44,438.33	0.00
О	居民服務、修理和其他服務業	-	1
P	教育	-	-
Q	衛生和社會工作	-	-
R	文化、體育和娛樂業	-	-
S	綜合	-	-
	合計	833,434,616.96	89.38

## 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

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	600581	八一鋼鐵	9,652,315	59,651,306.70	6.40

2	300750	寧德時代	110,200	58,934,960.00	6.32
3	300450	先導智能	739,500	44,473,530.00	4.77
4	002179	中航光電	547,819	43,288,657.38	4.64
5	688083	中望軟體	77,929	43,040,186.70	4.62
6	603712	七一二	1,168,520	41,368,572.00	4.44
7	601808	中海油服	2,759,139	39,621,236.04	4.25
8	600765	中航重機	1,511,115	34,226,754.75	3.67
9	000703	亞鉀國際	1,940,900	32,413,030.00	3.48
10	300073	當升科技	513,200	28,836,708.00	3.09
11	300682	朗新科技	1,684,500	28,333,290.00	3.04
12	603659	璞泰來	201,057	27,464,386.20	2.95
13	300077	國民技術	1,717,000	27,437,660.00	2.94
14	300593	新雷能	625,152	27,162,854.40	2.91
15	600862	中航高科	873,500	26,886,330.00	2.88
16	300034	鋼研高納	826,508	26,621,822.68	2.85
17	603799	華友鈷業	225,700	25,774,940.00	2.76
18	002651	利君股份	1,955,400	23,640,786.00	2.54
19	601857	中國石油	3,458,100	18,293,349.00	1.96
20	600316	洪都航空	458,000	17,623,840.00	1.89
21	600893	航發動力	324,500	17,260,155.00	1.85
22	600884	杉杉股份	731,200	17,051,584.00	1.83
23	601899	紫金礦業	1,386,100	13,431,309.00	1.44
24	688680	海優新材	50,348	12,939,436.00	1.39
25	600096	雲天化	721,900	10,135,476.00	1.09
26	002049	紫光國微	65,000	10,022,350.00	1.07
27	002539	雲圖控股	1,068,100	9,324,513.00	1.00
28	600141	興發集團	472,300	8,893,409.00	0.95
29	300825	阿爾特	312,700	8,280,296.00	0.89
30	000915	華特達因	296,000	7,912,080.00	0.85
31	688002	睿創微納	78,535	7,840,149.05	0.84
32	002532	天山鋁業	867,200	7,275,808.00	0.78
33	300699	光威複材	90,540	6,876,513.00	0.74
34	002705	新寶股份	253,400	6,651,750.00	0.71
35	600905	三峽能源	907,763	5,147,016.21	0.55
36	600150	中國船舶	272,471	4,498,496.21	0.48
37	688690	納微科技	3,477	408,547.50	0.04
38	688276	百克生物	3,486	364,565.88	0.04
39	688161	威高骨科	3,069	325,467.45	0.03
40	688183	生益電子	18,394	261,010.86	0.03
41	301015	百洋醫藥	4,614	251,115.78	0.03
42	688076	諾泰生物	4,984	241,973.20	0.03
43	688601	力芯微	1,174	216,133.40	0.02
			1		

45	688059	華銳精密	1,023	163,945.98	0.02
46	300957	貝泰妮	644	162,262.24	0.02
47	688216	氣派科技	2,000	133,400.00	0.01
48	688621	陽光諾和	1,485	131,868.00	0.01
49	688097	博眾精工	3,983	111,563.83	0.01
50	300919	中偉股份	610	99,430.00	0.01
51	688682	霍萊沃	946	98,242.10	0.01
52	301004	嘉益股份	3,115	90,654.98	0.01
53	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.01
54	300979	華利集團	925	80,937.50	0.01
55	601665	齊魯銀行	6,731	62,598.30	0.01
56	603529	愛瑪科技	1,019	59,224.28	0.01
57	688350	富淼科技	2,552	57,266.88	0.01
58	301012	揚電科技	1,691	56,994.16	0.01
59	688239	航宇科技	4,926	56,550.48	0.01
60	300981	中紅醫療	601	54,324.39	0.01
61	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.01
62	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.01
63	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.00
64	300973	立高食品	360	41,655.60	0.00
65	688517	金冠電氣	2,892	41,095.32	0.00
66	688067	愛威科技	1,259	39,520.01	0.00
67	688092	愛科科技	1,137	37,759.77	0.00
68	600032	浙江新能	3,045	37,027.20	0.00
69	688681	科匯股份	1,899	34,903.62	0.00
70	601528	瑞豐銀行	2,230	34,721.10	0.00
71	301021	英諾鐳射	2,899	27,424.54	0.00
72	300953	震裕科技	240	23,964.00	0.00
73	001207	聯科科技	682	22,581.02	0.00
74	300911	億田智能	309	21,407.52	0.00
75	300941	創識科技	399	19,926.06	0.00
76	603511	愛慕股份	553	18,249.00	0.00
77	688226	威騰電氣	2,693	17,289.06	0.00
78	603836	海程邦達	733	15,994.06	0.00
79	300925	法本信息	600	15,774.00	0.00
80	300982	蘇文電能	317	14,356.93	0.00
81	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.00
82	605319	無錫振華	764	13,706.16	0.00
83	001208	華菱線纜	1,754	13,558.42	0.00
84	300940	南極光	307	13,317.66	0.00
85	300614	百川暢銀	329	13,285.02	0.00
86	300937	藥易購	244	13,105.24	0.00
87	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00

00	602171	粉卡肌心	627	12 220 40	0.00
88 89	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
	300997	歡樂家	928	12,110.40	
90	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.00
91	301002	<u> </u>	201	11,581.62	0.00
92	300918	南山智尚	1,063	11,065.83	0.00
93	605287	徳才股份	349	11,014.44	0.00
94	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
95	605259	緑田機械	295	10,516.75	0.00
96	300996	普聯軟體	241	10,177.43	0.00
97	300917	特發服務	366	10,123.56	0.00
98	300922	天秦裝備	287	9,996.21	0.00
99	300956	英力股份	371	9,571.80	0.00
100	300962	中金輻照	576	9,429.12	0.00
101	300952	恒輝安防	340	9,207.20	0.00
102	300966	共同藥業	286	9,020.44	0.00
103	300945	曼卡龍	474	8,949.12	0.00
104	300948	冠中生態	324	8,884.08	0.00
105	300931	通用電梯	672	8,809.92	0.00
106	300961	深水海納	394	8,695.58	0.00
107	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
108	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
109	300958	建工修復	300	8,166.00	0.00
110	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
111	300987	川網傳媒	301	8,069.81	0.00
112	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
113	300993	玉馬遮陽	410	7,908.90	0.00
114	300930	屹通新材	322	7,882.56	0.00
115	300985	致遠新能	295	7,318.95	0.00
116	300971	博亞精工	245	6,931.05	0.00
117	300991	創益通	254	6,733.54	0.00
118	300927	江天化學	217	6,531.70	0.00
119	300975	商絡電子	492	6,410.76	0.00
120	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
121	301011	華立科技	175	5,922.00	0.00
122	300943	春暉智控	255	5,867.55	0.00
123	300967	曉鳴股份	507	5,850.78	0.00
124	300972	萬辰生物	430	5,439.50	0.00
125	300929	華騏環保	183	5,407.65	0.00
126	300960	通業科技	234	5,396.04	0.00
127	605011	杭州熱電	525	4,662.00	0.00
128	301007	德邁仕	303	4,375.32	0.00
129	300998	寧波方正	201	4,285.32	0.00
130	300992	泰福泵業	200	4,064.00	0.00
150	300772	ない日本スペント	200	1,001.00	5.00

131	301010	晶雪節能	218	3,838.98	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	601919	中遠海控	55,209,286.02	5.94
2	600581	八一鋼鐵	54,809,183.57	5.89
3	000893	亞鉀國際	48,616,987.00	5.23
4	601808	中海油服	43,741,941.82	4.70
5	601899	紫金礦業	33,940,395.00	3.65
6	601601	中國太保	33,450,141.23	3.60
7	688083	中望軟體	33,236,737.27	3.57
8	300518	盛訊達	32,834,561.00	3.53
9	300073	當升科技	32,195,968.51	3.46
10	600150	中國船舶	31,945,847.84	3.44
11	600765	中航重機	31,854,694.25	3.43
12	300682	朗新科技	29,849,888.83	3.21
13	600316	洪都航空	28,218,688.22	3.03
14	002539	雲圖控股	28,044,132.00	3.02
15	600862	中航高科	27,728,488.00	2.98
16	300077	國民技術	26,974,401.90	2.90
17	300059	東方財富	25,913,922.03	2.79
18	688680	海優新材	25,895,353.98	2.79
19	002045	國光電器	20,946,297.00	2.25
20	002651	利君股份	18,905,160.50	2.03
21	300034	鋼研高納	18,904,317.48	2.03
22	603026	石大勝華	18,785,433.40	2.02
23	603906	龍蟠科技	18,768,322.52	2.02
24	002602	世紀華通	18,673,643.00	2.01
25	603444	吉比特	18,641,462.00	2.00

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

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	601919	中遠海控	83,497,166.80	8.98
2	002304	洋河股份	75,293,543.33	8.10
3	603659	璞泰來	45,943,385.78	4.94
4	000333	美的集團	42,226,724.00	4.54

5	300724	捷佳偉創	41,476,195.00	4.46
6	600316	洪都航空	38,733,221.65	4.17
7	300750	寧德時代	37,835,706.00	4.07
8	300450	先導智能	35,708,145.60	3.84
9	300059	東方財富	34,057,603.24	3.66
10	300518	盛訊達	32,253,743.06	3.47
11	603026	石大勝華	29,641,635.29	3.19
12	603259	藥明康得	29,478,403.00	3.17
13	603799	華友鈷業	28,379,253.67	3.05
14	600150	中國船舶	27,240,919.97	2.93
15	601601	中國太保	25,322,708.54	2.72
16	000893	亞鉀國際	25,264,171.72	2.72
17	002610	愛康科技	24,387,510.59	2.62
18	300073	當升科技	24,099,859.40	2.59
19	002602	世紀華通	22,531,003.11	2.42
20	300760	邁瑞醫療	22,105,354.00	2.38
21	600031	三一重工	21,686,428.26	2.33
22	002985	北摩高科	20,776,522.40	2.23
23	002045	國光電器	18,621,991.80	2.00

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	1,101,658,948.47
賣出股票的收入(成交)總額	1,201,701,505.84

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

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	-	-
	其中:政策性金融債	•	-
4	企業債券	ı	-
5	企業短期融資券	ı	-
6	中期票據	ı	-
7	可轉債(可交換債)	160,700.00	0.02
8	同業存單	1	-
9	其他	-	-

10	合計	160,700.00	0.02
----	----	------------	------

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	127038	國微轉債	1,607	160,700.00	0.02
2	-	-	-	-	-
3	1	1	1	1	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

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 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。
- 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	290,024.10
2	應收證券結算款	8,864,487.90
3	應收股利	-
4	應收利息	11,384.90
5	應收申購款	143,609.48
6	其他應收款	218,378.00
7	待攤費用	-
8	其他	-
9	合計	9,527,884.38

### 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况的說明

金額單位:人民幣元

序號	股票代碼	股票名稱	流通受限部分的 公允價值	佔基金資產淨 值比例(%)	流通受限情況說明
1	603712	七一二	17,235,000.00	1.85	大宗轉讓流通受限

## 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

			持有力	人結構	
   持有人戶數(戶)	戶均持有的	機構投資	渚	個人投資	者
1寸行八广数(广)	基金份額	持有份額	佔總份額 比例	持有份額	佔總份額 比例
27,945	10,046.96	15,899,078.06	5.66%	264,863,261.11	94.34%

### 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	6,978.91	0.00%

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	U
本基金基金經理持有本開放式基金	0

# §9 開放式基金份額變動

單位:份

基金合同生效日(2013年4月12日)基金份額總額	2,000,000,000.00
本報告期期初基金份額總額	300,492,372.64
本報告期基金總申購份額	19,738,553.63
減:本報告期基金總贖回份額	39,468,587.10
本報告期基金拆分變動份額	-
本報告期期末基金份額總額	280,762,339.17

## §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

		股票交	易	應支付該券商	商的佣金	
	交易		佔當期		佔當期	
券商名稱	單元	成交金額	股票成	佣金	佣金總	備註
	數量		交總額	洲並	量的比	
			的比例		例	
中信建投證券	1	498,491,798.34	21.76%	464,472.43	22.77%	-
廣發證券	1	429,031,170.23	18.73%	399,557.18	19.59%	-
浙商證券	2	393,758,119.88	17.19%	287,952.45	14.11%	-
國都證券	1	273,106,515.30	11.92%	254,342.68	12.47%	-
國泰君安證券	1	270,273,296.53	11.80%	251,704.98	12.34%	-
申萬宏源證券	1	268,058,016.06	11.70%	249,642.80	12.24%	-
招商證券	1	83,098,715.93	3.63%	77,389.63	3.79%	-
國融證券	1	75,256,105.09	3.28%	55,035.03	2.70%	-

- 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,本基金還選擇了國海證券、國信證券、國元證券、滙豐前海、滙豐前海證券、 銀河證券的交易單元作為本基金交易單元,本報告期無股票交易及應付佣金。
- ④在上述租用的券商交易單元中,中金公司的交易單元為本基金本期剔除的交易單元,本期沒 有新增的券商交易單元。
- 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

	債券交易		回購交易	
		佔當期債		佔當期回
分问心悟	成交金額	券成交總	成交金額	購成交總
		額的比例		額的比例
中信建投證券	1	-	-	-
廣發證券	1	-	-	-
浙商證券	1	-	-	-
國都證券	1	-	-	-
國泰君安證券	1	-	-	-
申萬宏源證券	1	-	-	-
招商證券	-	-	-	-
國融證券	-	-	-	-

## 10.8 其他重大事件

		I	
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	中國證監會指定報刊及	2021-01-04
1	聯方承銷證券的公告	網站	2021-01-04
2	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 01 00
2	聯方承銷證券的公告	網站	2021-01-09
2	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 01 15
3	聯方承銷證券的公告	網站	2021-01-15
4	華夏基金管理有限公司關於終止部分代銷機	中國證監會指定報刊及	2021 01 20
4	構辦理本公司旗下基金銷售業務的公告	網站	2021-01-20
_	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	
5	聯方承銷證券的公告	網站	2021-01-27
	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	
6	聯方承銷證券的公告	網站	2021-02-01
_	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	
7	聯方承銷證券的公告	網站	2021-02-24
0	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 02 12
8	聯方承銷證券的公告	網站	2021-03-12
0	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	2021.04.02
9	聯方承銷證券的公告	網站	2021-04-02
1.0	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	
10	聯方承銷證券的公告	網站	2021-04-07
	**************************************	中國證監會指定報刊及	
11	華夏基金管理有限公司公告	網站	2021-04-09
1.5	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 04 00
12	聯方承銷證券的公告	網站	2021-04-09
1.2	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 24 21
13	聯方承銷證券的公告	網站	2021-04-21
	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	
14	聯方承銷證券的公告	網站	2021-05-08
	52	I.	I

		t manager & transcript	_
15	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	2021-05-12
	聯方承銷證券的公告	網站	
16	華夏基金管理有限公司關於旗下基金投資關	中國證監會指定報刊及	2021-05-13
10	聯方承銷證券的公告	網站	2021-03-13
1.7	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	2021 05 10
17	聯方承銷證券的公告	網站	2021-05-19
1.0	華夏基金管理有限公司關於深圳分公司營業	中國證監會指定報刊及	2021 05 25
18	場所變更的公告	網站	2021-05-25
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	2021 05 20
19	聯方承銷證券的公告	網站	2021-05-28
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	2021 07 04
20	聯方承銷證券的公告	網站	2021-06-04
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	2021 07 00
21	聯方承銷證券的公告	網站	2021-06-09
22	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 07 17
22	聯方承銷證券的公告	網站	2021-06-17
22	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 07 10
23	聯方承銷證券的公告	網站	2021-06-18
2.4	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	2021 07 10
24	聯方承銷證券的公告	網站	2021-06-19
2.5	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 20
25	聯方承銷證券的公告	網站	2021-06-30
	I.	l .	

# §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、中國證監會准予基金轉型的文件;
- 2、《華夏興華混合型證券投資基金基金合同》;
- 3、《華夏興華混合型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)
(1)股票投資		
上市投資		
中國(100%)		
八一鋼鐵	9,652,315	59,651,306.70
寧德時代	110,200	58,934,960.00
先導智能	739,500	44,473,530.00
中航光電	547,819	43,288,657.38
中望軟體	77,929	43,040,186.70
七一二	1,168,520	41,368,572.00
中海油服	2,759,139	39,621,236.04
中航重機	1,511,115	34,226,754.75
亞鉀國際	1,940,900	32,413,030.00
當升科技	513,200	28,836,708.00
朗新科技	1,684,500	28,333,290.00
璞泰來	201,057	27,464,386.20
國民技術	1,717,000	27,437,660.00
新雷能	625,152	27,162,854.40
中航高科	873,500	26,886,330.00
鋼研高納	826,508	26,621,822.68
華友鈷業	225,700	25,774,940.00
利君股份	1,955,400	23,640,786.00
中國石油	3,458,100	18,293,349.00
洪都航空	458,000	17,623,840.00
航發動力	324,500	17,260,155.00
杉杉股份	731,200	17,051,584.00
紫金礦業	1,386,100	13,431,309.00
海優新材	50,348	12,939,436.00
雲天化	721,900	10,135,476.00
紫光國微	65,000	10,022,350.00
雲圖控股	1,068,100	9,324,513.00
興發集團	472,300	8,893,409.00
阿爾特	312,700	8,280,296.00
華特達因	296,000	7,912,080.00
睿創微納	78,535	7,840,149.05
天山鋁業	867,200	7,275,808.00
光威複材	90,540	6,876,513.00
新寶股份	253,400	6,651,750.00

三峽能源	907,763	5,147,016.21
中國船舶	272,471	4,498,496.21
納微科技	3,477	408,547.50
百克生物	3,486	364,565.88
威高骨科	3,069	325,467.45
生益電子	18,394	261,010.86
百洋醫藥	4,614	251,115.78
諾泰生物	4,984	241,973.20
力芯微	1,174	216,133.40
利和興	4,704	168,966.51
華銳精密	1,023	163,945.98
貝泰妮	644	162,262.24
氣派科技	2,000	133,400.00
陽光諾和	1,485	131,868.00
博眾精工	3,983	111,563.83
中偉股份	610	99,430.00
霍萊沃	946	98,242.10
嘉益股份	3,115	90,654.98
利元亨	2,149	83,488.65
華利集團	925	80,937.50
齊魯銀行	6,731	62,598.30
愛瑪科技	1,019	59,224.28
富淼科技	2,552	57,266.88
揚電科技	1,691	56,994.16
航宇科技	4,926	56,550.48
中紅醫療	601	54,324.39
英科再生	2,469	54,219.24
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
愛科科技	1,137	37,759.77
浙江新能	3,045	37,027.20
科匯股份	1,899	34,903.62
瑞豐銀行	2,230	34,721.10
英諾鐳射	2,899	27,424.54
震裕科技	240	23,964.00
聯科科技	682	22,581.02
億田智能	309	21,407.52
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

法本信息   600   15,774.00   6   6   6   6   6   6   6   6   6	海程邦達	733	15,994.06
格林精密	法本信息	600	15,774.00
核林精密		317	·
無錫振華 764 13,706.16 華菱線織 1,754 13,558.42 南極空 307 13,317.66 百川楊銀 329 13,285.02 競易職 244 13,105.24 易瑞生物 443 12,634.36 稅友股份 637 12,230.40 歡樂家 928 12,110.40 中辰股份 1,112 11,609.28 薩亞股份 201 11,581.62 南山智尚 1,063 11,065.83 檍才股份 349 11,014.44 嘉亭家化 232 10,688.24 緣田楊城 295 10,516.75 善夢軟體 241 10,177.43 特發服務 366 10,123.56 天泰装備 287 9,996.21 英力股份 371 9,571.80 中金鰕原 576 9,429.12 度師安防 340 9,207.20 共同藥藥 286 9,020.44 曼下龍 474 8,949.12 寇中生態 324 8,884.08 張承木海納 394 8,695.58 徳固特 219 8,660.47 新中港 1,377 8,358.39 建工修復 300 8,166.00 志科新材 264 8,070.48 川澤傳陳 301 8,069.51 新中港 1,377 8,358.39 建工修復 300 8,166.00 志科新材 264 8,070.48 川澤傳陳 301 8,069.81 川澤傳陳 301 8,069.81 川澤傳陳 301 8,069.81 正孫總陽 410 7,908.90 屹通新材 322 7,882.56 致遠新能 225 7,318.95 悼亞新丁 195.81.70	格林精密	1,162	· ·
華菱線織       1,754       13,558.42         南極光       307       13,317.66         百川崩線       329       13,285.02         線易購       244       13,105.24         易端生物       443       12,634.36         板友股份       637       12,230.40         軟業家       928       12,110.40         中辰股份       1,112       11,609.28         液盘股份       201       11,581.62         南口智尚       1,063       11,065.83         修士財份       349       11,014.44         嘉亨家化       232       10,688.24         綠田樓帔       295       10,516.75         香酥軟體       241       10,177.43         特養財務       366       10,123.56         天秦裝備       287       9,996.21         红輝安防       371       9,571.80         中金幅照       576       9,429.12         红輝安防       340       9,207.20         共同標業       286       9,020.44         曼卡龍       474       8,949.12         江中生態       324       8,884.08         適用電館       672       8,809.92         深水納       394       8,695.58         總固輔       672	無錫振華	764	·
南極光   307		1,754	· ·
百川暢線       329       13,285.02         藥易購       244       13,105.24         易灌生物       443       12,634.36         稅友股份       637       12,230.40         中長股份       1,112       11,609.28         綠硫股份       201       11,581.62         南山智尚       1,063       11,065.83         億才股份       349       11,014.44         嘉亨家化       232       10,688.24         綠田機械       295       10,516.75         野軟體       241       10,177.43         特養服務       366       10,123.56         天泰裝備       287       9,996.21         英力股份       371       9,571.80         中金幅照       576       9,429.12         恒華安防       340       9,207.20         共同藥業       286       9,020.44         東中建       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         樹田時       1,377       8,358.39         東上修復       300       8,166.00         志特新材       264       8,070.48         川蝴傳縣       301	南極光	307	13,317.66
競場購       244       13,105.24         易瑞生物       443       12,634.36         稅友股份       637       12,230.40         歡家       928       12,110.40         中辰股份       1,112       11,609.28         南山智尚       1,063       11,065.83         徳才股份       349       11,101.44         荔亭家化       232       10,688.24         綠田機械       295       10,516.75         普聯軟體       241       10,177.43         特分股務       366       10,123.56         天泰装備       287       9,996.21         恒輝安防       371       9,571.80         中企驅照       576       9,429.12         恒輝安防       340       9,207.20         共同藥業       286       9,020.44         曼卡龍       474       8,949.12         殖中生態       324       8,884.08         通用建       672       8,809.92         深水海湖       394       8,695.58         衛田港       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	百川暢銀	329	13,285.02
易瑞生物       443       12,634.36         稅友股份       637       12,230.40         歡樂家       928       12,110.40         中辰股份       1,112       11,609.28         崧盛股份       201       11,581.62         商山智尚       1,063       11,065.83         億才股份       349       11,014.44         嘉字家化       232       10,688.24         綠田機械       295       10,516.75         音聯軟體       241       10,177.43         特發服務       366       10,123.56         天秦裝備       287       9,996.21         英力股份       371       9,571.80         专業提供       287       9,996.21         桂麻寒時       576       9,429.12         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         通用電業       672       8,899.92         深水納       394       8,695.54         新中連       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	藥易購	244	
歡樂家       928       12,110.40         中辰股份       1,112       11,609.28         凝盛股份       201       11,581.62         南山智尚       1,063       11,065.83         徳才股份       349       11,014.44         嘉亨家化       232       10,688.24         綠田機械       295       10,516.75         壽聯軟體       241       10,177.43         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         恒罐安防       340       9,207.20         共同藥業       286       9,020.44         曼卡龍       474       8,949.12         超中生態       324       8,869.42         添出再電梯       672       8,809.92         深水海納       394       8,695.58         徳固特       219       8,569.47         新中港       1,377       8,358.39         建工修復       300       8,166.00         志特新村       264       8,070.48         川網傳媒       301       8,069.81         博食科技       359       7,969.80         玉馬總       410	易瑞生物	443	12,634.36
中辰股份       1,112       11,609.28         崧盛股份       201       11,581.62         南山智尚       1,063       11,065.83         德才股份       349       11,014.44         嘉亨家化       232       10,688.24         緣田機械       295       10,516.75         普聯軟體       241       10,177.43         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         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         德国特       19       8,569.47         新中港       1,377       8,358.39         建工修復       300       8,166.00         志特新村       264       8,070.48         川網傳媒       301       8,069.81         博俊科技       359       7,968.90         歐邊縣       295       7,318.95         博養和養       295 <t< td=""><td>稅友股份</td><td>637</td><td>12,230.40</td></t<>	稅友股份	637	12,230.40
核盛股份       201       11,581.62         南山智尚       1,063       11,065.83         徳才股份       349       11,014.44         嘉亨家化       232       10,688.24         綠田機械       295       10,516.75         普聯軟體       241       10,177.43         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         恒華安防       340       9,207.20         共同藥業       286       9,020.44         曼卡龍       474       8,949.12         超中生態       324       8,884.08         通用電棒       672       8,809.92         深水海納       394       8,655.58         徳固特       219       8,569.47         新中港       1,377       8,358.39         建工修復       300       8,166.00         志特新村       264       8,070.48         川網傳媒       301       8,069.81         博後科技       359       7,969.80         玉馬遮陽       410       7,908.90         屹通新林       295       7,318.95         博登科       6,931.05	歡樂家	928	12,110.40
南山智尚       1,063       11,065.83         徳才股份       349       11,014.44         嘉亨家七       232       10,688.24         綠田機械       295       10,516.75         普聯軟體       241       10,177.43         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         恒摩安防       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         徳固特       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         博後科技       359       7,969.80         玉馬遮陽       410       7,908.90         屹通新材       322       7,882.56         致邊新能       295       7,318.95         博登科       6,931.05	中辰股份	1,112	11,609.28
徳才股份       349       11,014.44         嘉亨家化       232       10,688.24         綠田機械       295       10,516.75         普聯軟體       241       10,177.43         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         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         徳固特       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         玉馬遮陽       410       7,908.90         屹通新材       322       7,882.56         致遠新能       295       7,318.95         博亞精工       245       6,931.05         創益通       254       6,7	崧盛股份	201	11,581.62
嘉亨家化       232       10,688.24         綠田機械       295       10,516.75         普聯軟體       241       10,177.43         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         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         徳固特       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         博後科技       359       7,969.80         玉馬遮陽       410       7,908.90         屹通新材       322       7,882.56         致遠新能       295       7,318.95         博亞精工       245       6,931.05         創益通       254       6,733.54         江天化學       217       6,531	南山智尚	1,063	11,065.83
縁田機械       295       10,516.75         普聯軟體       241       10,177.43         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         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       8,884.98         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         玉馬遮陽       410       7,908.90         屹通新材       322       7,882.56         致遠新能       295       7,318.95         博亞精工       245       6,931.05         創益通       254       6,733.54         江天化學       217       6,531.70         商給電子       492       6,410.	德才股份	349	11,014.44
普聯軟體       241       10,177.43         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         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         徳固特       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         玉馬遮陽       410       7,908.90         屹通新材       322       7,882.56         致遠新能       295       7,318.95         博亞精工       245       6,931.05         創益通       254       6,733.54         江天化學       217       6,531.70         商絡電子       492       6,410.76	嘉亨家化	232	10,688.24
特發服務36610,123.56天秦裝備2879,996.21英力股份3719,571.80中金輻照5769,429.12恒輝安防3409,207.20共同藥業2869,020.44曼卡龍4748,949.12冠中生態3248,884.08通用電梯6728,809.92深水海納3948,695.58德固特2198,569.47新中港1,3778,358.39建工修復3008,166.00志特新材2648,070.48川網傳媒3018,069.81博後科技3597,969.80玉馬遮陽4107,908.90屹通新材3227,882.56致遠新能2957,318.95博亞精工2456,931.05創益通2546,733.54江天化學2176,531.70商給電子4926,410.76	綠田機械	295	10,516.75
天秦裝備2879,996.21英力股份3719,571.80中金輻照5769,429.12恒輝安防3409,207.20共同藥業2869,020.44曼卡龍4748,949.12冠中生態3248,884.08通用電梯6728,809.92深水海納3948,695.58德固特2198,569.47新中港1,3778,358.39建工修復3008,166.00志特新材2648,070.48川網傳媒3018,069.81博後科技3597,969.80玉馬遮陽4107,908.90屹通新材3227,882.56致遠新能2957,318.95博亞精工2456,931.05創益通2546,733.54江天化學2176,531.70商絡電子4926,410.76	普聯軟體	241	10,177.43
英力股份3719,571.80中金輻照5769,429.12恒輝安防3409,207.20共同藥業2869,020.44曼卡龍4748,949.12冠中生態3248,884.08通用電梯6728,809.92深水海納3948,695.58德固特2198,569.47新中港1,3778,358.39建工修復3008,166.00志特新材2648,070.48川網傳媒3018,069.81博後科技3597,969.80玉馬遮陽4107,908.90屹通新材3227,882.56致遠新能2957,318.95博亞精工2456,931.05創益通2546,733.54江天化學2176,531.70商絡電子4926,410.76	特發服務	366	10,123.56
中金輻照5769,429.12恒輝安防3409,207.20共同藥業2869,020.44曼卡龍4748,949.12冠中生態3248,884.08通用電梯6728,809.92深水海納3948,695.58德固特2198,569.47新中港1,3778,358.39建工修復3008,166.00志特新材2648,070.48川網傳媒3018,069.81博後科技3597,969.80玉馬遮陽4107,908.90屹通新材3227,882.56致遠新能2957,318.95博亞精工2456,931.05創益通2546,733.54江天化學2176,531.70商絡電子4926,410.76	天秦裝備	287	9,996.21
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         博後科技       359       7,969.80         玉馬遮陽       410       7,908.90         屹通新材       322       7,882.56         致遠新能       295       7,318.95         博亞精工       245       6,931.05         創益通       254       6,733.54         江天化學       217       6,531.70         商絡電子       492       6,410.76	英力股份	371	9,571.80
共同藥業2869,020.44曼卡龍4748,949.12冠中生態3248,884.08通用電梯6728,809.92深水海納3948,695.58德固特2198,569.47新中港1,3778,358.39建工修復3008,166.00志特新材2648,070.48川網傳媒3018,069.81博俊科技3597,969.80玉馬遮陽4107,908.90屹通新材3227,882.56致遠新能2957,318.95博亞精工2456,931.05創益通2546,733.54江天化學2176,531.70商絡電子4926,410.76	中金輻照	576	9,429.12
曼卡龍4748,949.12冠中生態3248,884.08通用電梯6728,809.92深水海納3948,695.58德固特2198,569.47新中港1,3778,358.39建工修復3008,166.00志特新材2648,070.48川網傳媒3018,069.81博俊科技3597,969.80玉馬遮陽4107,908.90屹通新材3227,882.56致遠新能2957,318.95博亞精工2456,931.05創益通2546,733.54江天化學2176,531.70商絡電子4926,410.76	恒輝安防	340	9,207.20
冠中生態3248,884.08通用電梯6728,809.92深水海納3948,695.58德固特2198,569.47新中港1,3778,358.39建工修復3008,166.00志特新材2648,070.48川網傳媒3018,069.81博俊科技3597,969.80玉馬遮陽4107,908.90屹通新材3227,882.56致遠新能2957,318.95博亞精工2456,931.05創益通2546,733.54江天化學2176,531.70商絡電子4926,410.76	共同藥業	286	9,020.44
通用電梯6728,809.92深水海納3948,695.58徳固特2198,569.47新中港1,3778,358.39建工修復3008,166.00志特新材2648,070.48川網傳媒3018,069.81博俊科技3597,969.80玉馬遮陽4107,908.90屹通新材3227,882.56致遠新能2957,318.95博亞精工2456,931.05創益通2546,733.54江天化學2176,531.70商絡電子4926,410.76	曼卡龍	474	8,949.12
深水海納3948,695.58德固特2198,569.47新中港1,3778,358.39建工修復3008,166.00志特新材2648,070.48川網傳媒3018,069.81博俊科技3597,969.80玉馬遮陽4107,908.90屹通新材3227,882.56致遠新能2957,318.95博亞精工2456,931.05創益通2546,733.54江天化學2176,531.70商絡電子4926,410.76	冠中生態	324	8,884.08
德固特2198,569.47新中港1,3778,358.39建工修復3008,166.00志特新材2648,070.48川網傳媒3018,069.81博俊科技3597,969.80玉馬遮陽4107,908.90屹通新材3227,882.56致遠新能2957,318.95博亞精工2456,931.05創益通2546,733.54江天化學2176,531.70商絡電子4926,410.76	通用電梯	672	8,809.92
新中港1,3778,358.39建工修復3008,166.00志特新材2648,070.48川網傳媒3018,069.81博俊科技3597,969.80玉馬遮陽4107,908.90屹通新材3227,882.56致遠新能2957,318.95博亞精工2456,931.05創益通2546,733.54江天化學2176,531.70商絡電子4926,410.76	深水海納	394	8,695.58
建工修復3008,166.00志特新材2648,070.48川網傳媒3018,069.81博俊科技3597,969.80玉馬遮陽4107,908.90屹通新材3227,882.56致遠新能2957,318.95博亞精工2456,931.05創益通2546,733.54江天化學2176,531.70商絡電子4926,410.76	德固特	219	8,569.47
志特新材2648,070.48川網傳媒3018,069.81博俊科技3597,969.80玉馬遮陽4107,908.90屹通新材3227,882.56致遠新能2957,318.95博亞精工2456,931.05創益通2546,733.54江天化學2176,531.70商絡電子4926,410.76	新中港	1,377	8,358.39
川網傳媒3018,069.81博俊科技3597,969.80玉馬遮陽4107,908.90屹通新材3227,882.56致遠新能2957,318.95博亞精工2456,931.05創益通2546,733.54江天化學2176,531.70商絡電子4926,410.76	建工修復	300	8,166.00
博俊科技3597,969.80玉馬遮陽4107,908.90屹通新材3227,882.56致遠新能2957,318.95博亞精工2456,931.05創益通2546,733.54江天化學2176,531.70商絡電子4926,410.76	志特新材	264	8,070.48
玉馬遮陽4107,908.90屹通新材3227,882.56致遠新能2957,318.95博亞精工2456,931.05創益通2546,733.54江天化學2176,531.70商絡電子4926,410.76	川網傳媒	301	8,069.81
屹通新材3227,882.56致遠新能2957,318.95博亞精工2456,931.05創益通2546,733.54江天化學2176,531.70商絡電子4926,410.76	博俊科技	359	7,969.80
致遠新能2957,318.95博亞精工2456,931.05創益通2546,733.54江天化學2176,531.70商絡電子4926,410.76	玉馬遮陽	410	7,908.90
博亞精工2456,931.05創益通2546,733.54江天化學2176,531.70商絡電子4926,410.76	屹通新材	322	7,882.56
創益通2546,733.54江天化學2176,531.70商絡電子4926,410.76	致遠新能	295	7,318.95
江天化學2176,531.70商絡電子4926,410.76	博亞精工	245	6,931.05
商絡電子 492 6,410.76	創益通	254	6,733.54
	江天化學	217	6,531.70
中洲特材 283 6,364.67	商絡電子	492	6,410.76
	中洲特材	283	6,364.67

華立科技	175	5,922.00
春暉智控	255	5,867.55
曉鳴股份	507	5,850.78
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
德邁仕	303	4,375.32
寧波方正	201	4,285.32
泰福泵業	200	4,064.00
晶雪節能	218	3,838.98
合計	39,079,109.00	833,434,616.96
(2)債券投資		
上市投資		
中國(100%)		
國微轉債	1,607	160,700.00
合計	1,607	160,700.00
(3)資產支持證券投資		
上市投資		
中國(-%)		
合計		
(4)買入返售金融資產		
銀行間同業市場買人返售金融資產		
交易所市場買入返售金融資產		
合計		
總投資資產		833,595,316.96
銀行存款和結算備付金		105,621,002.51
其他各項資產		9,527,884.38
合計		948,744,203.85

## 補充披露 2: 投資組合變動表

		佔基金資產淨值的	佔基金資產淨值的
序號	證券類別	比例(%)	比例(%)
		2021年6月30日	2020年12月31日
1	股票	89.38	92.84
2	債券	0.02	1.08

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 二〇二一年八月三十日