

華夏回報證券投資基金

2022 年中期報告

2022 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：二〇二二年八月三十日

華夏回報證券投資基金（“本基金”）

2022 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。

本基金只有 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。

補充披露部分只編備以供在香港派發。補充披露部分載有本基金投資組合的額外詳情，其必須連同本基金的 2022 年半年度報告一併閱覽。

華夏基金（香港）有限公司

香港代表

二〇二二年八月三十日

§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 2022 年 8 月 26 日覆核了本報告中的財務指標、淨值表現、利潤分配情況、財務會計報告、投資組合報告等內容，保證覆核內容不存在虛假記載、誤導性陳述或者重大遺漏。

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

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

本報告中財務資料未經審計。

本報告期自 2022 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 淨資產（基金淨值）變動表.....	14
6.4 報表附注.....	15
§7 投資組合報告.....	36
7.1 期末基金資產組合情況.....	36
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.....	37
7.4 報告期內股票投資組合的重大變動.....	40
7.5 期末按債券品種分類的債券投資組合.....	41
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.....	41
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.....	42
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.....	42
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.....	42
7.10 本基金投資股指期貨的投資政策.....	42
7.11 報告期末本基金投資的國債期貨交易情況說明.....	42
7.12 投資組合報告附注.....	42
§8 基金份額持有人信息.....	43
§9 開放式基金份額變動.....	43
§10 重大事件披露.....	44
§11 影響投資者決策的其他重要信息.....	46
§12 備查文件目錄.....	47
§13 補充披露.....	47

§2 基金簡介

2.1 基金基本情況

基金名稱	華夏回報證券投資基金	
基金簡稱	華夏回報混合	
基金主代碼	002001	
交易代碼	002001(前端)	002002(後端)
基金運作方式	契約型開放式	
基金合同生效日	2003 年 9 月 5 日	
基金管理人	華夏基金管理有限公司	
基金託管人	中國銀行股份有限公司	
報告期末基金份額總額	9,356,487,820.12 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	95566
	電子郵箱	service@ChinaAMC.com	fcid@bankofchina.com
客戶服務電話		400-818-6666	95566
傳真		010-63136700	010-66594942
註冊地址		北京市順義區安慶大街甲3號院	北京市西城區復興門內大街1號
辦公地址		北京市西城區金融大街33號通泰大廈B座8層	北京市西城區復興門內大街1號
郵政編碼		100033	100818
法定代表人		楊明輝	劉連舸

2.4 信息披露方式

本基金選定的信息披露報紙名稱	《證券時報》
登載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	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

83 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（2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日）
本期已實現收益	-44,482,397.08
本期利潤	-466,731,374.20
加權平均基金份額本期利潤	-0.0495
本期加權平均淨值利潤率	-3.64%
本期基金份額淨值增長率	-3.28%
3.1.2 期末資料和指標	報告期末(2022年6月30日)
期末可供分配利潤	-59,236,002.57
期末可供分配基金份額利潤	-0.0063
期末基金資產淨值	13,115,594,494.58
期末基金份額淨值	1.402
3.1.3 累計期末指標	報告期末(2022年6月30日)
基金份額累計淨值增長率	1,549.97%

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

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

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

3.2 基金淨值表現

3.2.1 基金份額淨值增長率及其與同期業績比較基準收益率的比較

階段	份額淨值增長率①	份額淨值增長率標準差②	業績比較基準收益率③	業績比較基準收益率標準差④	①－③	②－④
過去一個月	4.78%	0.47%	0.12%	0.00%	4.66%	0.47%

過去三個月	5.10%	0.62%	0.37%	0.00%	4.73%	0.62%
過去六個月	-3.28%	0.75%	0.74%	0.00%	-4.02%	0.75%
過去一年	-17.77%	0.97%	1.50%	0.00%	-19.27%	0.97%
過去三年	35.53%	1.06%	4.50%	0.00%	31.03%	1.06%
自基金合同生效起至今	1,549.97%	1.02%	44.42%	0.00%	1,505.55%	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 2022 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、境內首只 ETF 基金管理人、境內首只滬港通 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，形成了覆蓋大盤藍籌、寬基指數、中小創指數、主題指數、行業指數、Smart Beta 策略、海外市場指數、信用債指數、商品指數等較為完整的產品線。

華夏基金以深入的投資研究為基礎，盡力捕捉市場機會，為投資者謀求良好的回報。根據銀河證券基金研究中心《中國基金業績評價報告》，截至 2022 年 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：在偏股型基金(股票上限 95%)(A 類)中華夏興和混合排序第 1/188、華夏興華混合(A 類)排序第 16/188；在養老目標日期 FOF(2040)(A 類)中華夏養老 2040 三年持有混合（FOF）排序第 2/14；在定開偏股型基金(A 類)中華夏磐利一年定開混合(A 類)排序第 2/77、華夏磐銳一年定開混合(A 類)排序第 10/77、華夏磐益一年定開混合排序第 11/77、華夏成長精選 6 個月定開混合(A 類)排序第 24/77；在醫藥醫療健康行業偏股型基金(股票上下限 60%-95%)(A 類)中華夏逸享健康混合(A 類)排序第 9/52；在消費行業偏股型基金(股票上下限 60%-95%)(A 類)中華夏網購精選混合(A 類)排序第 10/53；在偏股型基金(股票上限 80%)(A 類)中華夏經典混合排序第 22/134；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 29/905、華夏產業升級混合(A 類)排序第 55/905、華夏盛世混合排序第 67/905；在標準股票型基金(A 類)中華夏智勝價值成長股票(A 類)排序第 59/286；在靈活配置型基金(基準股票比例 60%-100%)(A 類)中華夏圓和混合(A 類)排序第 74/436。

固收與固收+產品：在 QDII 債券型基金(A 類)中華夏大中華信用債券（QDII）(A 類)排序第 1/25；在信用債指數債券型基金(A 類)中華夏亞債中國指數(A 類)排序第 3/13；在利率債指數債券型基金(A 類)中華夏中債 3-5 年政金債指數(A 類)排序第 7/98；在中短期純債債券型基金(A 類)中華夏中短債債券(A 類)排序第 21/84；在長期純債債券型基金(A 類)中華夏鼎航債券(A 類)排序第 28/642；在偏債型基金(A 類)中華夏磐泰混合（LOF）(A 類)排序第 32/350、華夏睿磐泰盛混合排序第 36/350、華夏永康添福混合(A 類)排序第 46/350、華夏睿磐泰利混合(A 類)排序第 63/350。

指數與量化產品：在 QDII 跨境股票 ETF 基金中華夏納斯達克 100ETF（QDII）排序第 4/19；在規模指數股票 ETF 基金中華夏中證 1000ETF 排序第 3/116、華夏中證 500ETF 排序第 18/116；在主

題指數股票 ETF 聯接基金(A 類)中華夏中證四川國改 ETF 聯接(A 類)排序第 3/60、華夏中證央企 ETF 聯接(A 類)排序第 15/60；在行業指數股票 ETF 聯接基金(A 類)中華夏中證全指房地產 ETF 聯接(A 類)排序第 4/24、華夏中證銀行 ETF 聯接(A 類)排序第 6/24；在行業指數股票 ETF 基金中華夏中證全指房地產 ETF 排序第 7/41、華夏中證銀行 ETF 排序第 10/41；在規模指數股票 ETF 聯接基金(A 類)中華夏中證 500ETF 聯接(A 類)排序第 15/80；在主題指數股票 ETF 基金中華夏中證新能源 ETF 排序第 14/169、華夏中證四川國改 ETF 排序第 17/169、華夏中證新能源汽車 ETF 排序第 24/169。

在證券時報主辦的第十七屆中國基金業明星基金獎評選活動上，在最具含金量、最能體現基金公司綜合實力的“年度十大明星基金公司獎”評選中，華夏基金憑藉在多項業務中的優異中長期表現，成功獲獎。此外，憑藉 QDII 基金的良好業績表現，以及在境內外市場的持續布局，華夏基金還獲得“三年海外投資明星基金公司獎”。

在客戶服務方面，2022 年上半年，華夏基金繼續以客戶需求為導向，努力提高客戶使用的便利性和服務體驗：（1）華夏基金直銷上線北京銀行、廣發銀行快捷等支付方式，拓展支付管道的同時交易額度也得到進一步提升，滿足客戶支付需求；（2）華夏基金管家用戶端優化資料上傳、定投收益展示等功能，增加客戶操作便利性；（3）與蘭州銀行、九江銀行、晉商銀行、九州證券等代銷機構合作，拓展更加豐富的客戶理財管道；（4）開展“壓歲錢手賬”、“基金視力表”、“與乾飯人靈魂相認”、“童言童語話理財”、“FOF 產品不是小透明”等活動，為客戶提供了多樣化的投資者教育和關懷服務。

4.1.2 基金經理（或基金經理小組）及基金經理助理的簡介

姓名	職務	任本基金的基金經理 （助理）期限		證券從業 年限	說明
		任職日期	離任日期		
季新星	本基金的基金經理	2021-11-02	-	13 年	碩士。曾任申萬菱信基金管理有限公司權益投資部研究員、申萬菱信消費增長混合型證券投資基金基金經理、申萬菱信新動力混合型證券投資基金基金經理。2020 年 7 月加入華夏基金管理有限公司。
陽琨	本基金的基金經理、公司投資總監、投委會成員	2021-11-02	-	27 年	碩士。曾任寶盈基金基金經理助理，益民基金投資部部門經理，中國對外經濟貿易信託投資有限公司財務部部門經理等。2006 年 8 月加入華夏基金管理有限公司。歷任策略研究員、股票投資部副總經理、興和證券投資基

					金基金經理（2009 年 1 月 1 日至 2012 年 1 月 12 日期間）、興華證券投資基金基金經理（2007 年 6 月 12 日至 2013 年 4 月 11 日期間）、華夏盛世精選混合型證券投資基金基金經理（2009 年 12 月 18 日至 2015 年 9 月 1 日期間）、華夏大盤精選證券投資基金基金經理（2015 年 9 月 1 日至 2017 年 5 月 2 日期間）、華夏大中華企業精選靈活配置混合型證券投資基金（QDII）基金經理（2016 年 1 月 20 日至 2018 年 10 月 11 日期間）、華夏新時代靈活配置混合型證券投資基金（QDII）基金經理（2018 年 5 月 30 日至 2019 年 7 月 15 日期間）等。
--	--	--	--	--	---

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 54 次，其中 3 次為投資策略需要所致，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；其餘均為指數量化投資組合因投資策略需要和其他組合發生的反向交易。

4.4 管理人對報告期內基金的投資策略和業績表現的說明

4.4.1 報告期內基金投資策略和運作分析

2022 年上半年，國內股票市場波動較大。年初受到俄烏衝突及國內疫情反復的影響，加上投資者擔心成長股估值偏高，股票市場出現了單邊下跌，跌速較快且幅度較深。在 5 月份以後，隨著國內疫情得到較好控制，加上國家穩經濟的政策漸次出台，投資者情緒明顯修復，市場也出現了快速的反彈。截至上半年期末，滬深 300 指數和創業板指數均相較前期的低點有了明顯反彈。以新能源車、光伏等成長類股票在本輪反彈中表現較突出，新能源車及光伏電池的銷售在今年上半年顯著超出市場預期，給投資者較強的信心，板塊內個股估值提升明顯。一季度相對抗跌的價值類股票在二季度反彈中相對平淡，投資者對國內房地產市場投資能否在近期企穩恢復的信心仍顯不足。一年多以來受益於商品價格上漲的煤炭、有色金屬類資源類股票也有較大的漲幅，但波動較大。上半年海外股票市場在經濟出現滯漲現象的壓力下普遍表現不佳，美聯儲承認前期低估了通脹的壓力，並明確提高了加息的力度。海外投資者預期大幅下調，市場擔心各央行較快的加息步伐可能導致發達經濟體進入衰退階段。

本基金在 2022 年一季度降低了組合股票持倉，以防禦經濟下行的風險。因此在二季度後半期的市場反彈中倉位元略顯不足，組合選股也偏重下行風險的考量，對成長性較好但波動性較大的股票略顯謹慎，基金淨值整體表現一般。

4.4.2 報告期內基金的業績表現

截至 2022 年 6 月 30 日，本基金份額淨值為 1.402 元，本報告期份額淨值增長率為 -3.28%，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

經過上半年的先跌後漲之後，我們預期國內股票市場轉向震盪。一方面國內經濟環境在度過上半年疫情的考驗後，在三季度可能迎來環比改善的機會。但成長類股票的快速反彈已經部分體現了投資者對新能源車、光伏等行業成長性的樂觀預期。從實體經濟的角度看，企業收入及盈利的全面好轉需要一個過程。客觀地說，在複雜的國際國內經濟環境下，穩增長的道路仍是錯綜複雜的。另一方面，海外主要經濟體面臨的經濟挑戰仍比較嚴峻，俄烏衝突以及新冠疫情給全球通脹帶來明顯的壓力。以美國為例，美聯儲大幅調高了加息及縮表的政策預期。較高的資金利率是對抗通脹的一

種方法，但也可能帶來對需求的壓制，從而對資產價格帶來不利影響。二季度，海外市場主要股票指數都出現了較明顯的下跌。展望未來，我們認為國內股票市場可能會進入震盪期，需要消化市場反彈後明顯上升的估值水準，並等待企業盈利情況的進一步驗證。從行業結構上看，我們依舊看好智慧電動車產業鏈、綠色能源產業鏈、半導體產業鏈以及軍工產業鏈中優質公司的成長機會。

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

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

4.6 管理人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 1 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：2022 年 6 月 30 日

單位：人民幣元

資產	附注號	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
資產：			
銀行存款	6.4.7.1	798,590,988.44	1,832,783,286.85
結算備付金		3,335,631.27	5,273,357.61
存出保證金		817,647.75	1,058,893.45
交易性金融資產	6.4.7.2	10,917,870,070.57	11,489,848,081.34
其中：股票投資		5,855,158,214.54	7,312,148,813.18
基金投資		-	-
債券投資		5,062,711,856.03	4,177,699,268.16
資產支持證券投資		-	-
貴金屬投資		-	-
其他投資		-	-
衍生金融資產	6.4.7.3	-	-
買入返售金融資產	6.4.7.4	1,500,167,808.21	491,421,327.71
應收清算款		-	72,384.29
應收股利		-	-
應收申購款		2,063,743.50	4,901,264.41
遞延所得稅資產		-	-
其他資產	6.4.7.5	-	71,289,794.98

資產總計		13,222,845,889.74	13,896,648,390.64
負債和淨資產	附注號	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
負債：			
短期借款		-	-
交易性金融負債		-	-
衍生金融負債	6.4.7.3	-	-
賣出回購金融資產款		-	-
應付清算款		50,740,012.69	-
應付贖回款		19,265,724.03	15,342,643.97
應付管理人報酬		15,723,729.12	17,940,723.86
應付託管費		2,620,621.53	2,990,120.65
應付銷售服務費		-	-
應付投資顧問費		-	-
應交稅費		78,863.73	78,727.76
應付利潤		-	-
遞延所得稅負債		-	-
其他負債	6.4.7.6	18,822,444.06	19,532,029.38
負債合計		107,251,395.16	55,884,245.62
淨資產：			
實收基金	6.4.7.7	9,356,487,820.12	9,444,816,091.35
未分配利潤	6.4.7.8	3,759,106,674.46	4,395,948,053.67
淨資產合計		13,115,594,494.58	13,840,764,145.02
負債和淨資產總計		13,222,845,889.74	13,896,648,390.64

注：①報告截止日 2022 年 6 月 30 日，基金份額淨值 1.402 元，基金份額總額 9,356,487,820.12 份。

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

6.2 利潤表

會計主體：華夏回報證券投資基金

本報告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

單位：人民幣元

項目	附注號	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期間 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
----	-----	--	---

一、營業總收入		-355,169,702.86	432,447,537.65
1.利息收入		4,162,210.81	76,145,042.29
其中：存款利息收入	6.4.7.9	2,322,364.23	2,973,187.05
債券利息收入		-	68,429,821.41
資產支持證券利息收入		-	-
買入返售金融資產收入		1,839,846.58	4,742,033.83
證券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投資收益（損失以“-”填列）		61,635,392.01	1,082,648,342.17
其中：股票投資收益	6.4.7.10	-76,134,458.91	1,037,764,841.50
基金投資收益		-	-
債券投資收益	6.4.7.11	80,022,029.49	5,919,388.36
資產支持證券投資收益	6.4.7.12	-	-
貴金屬投資收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	-	-
股利收益	6.4.7.14	57,747,821.43	38,964,112.31
其他投資收益		-	-
3.公允價值變動收益（損失以“-”號填列）	6.4.7.15	-422,248,977.12	-731,261,063.00
4.匯兌收益（損失以“-”號填列）		-	-
5.其他收入（損失以“-”號填列）	6.4.7.16	1,281,671.44	4,915,216.19
減：二、營業總支出		111,561,671.34	147,890,402.15
1.管理人報酬		95,498,226.63	120,640,954.18
2.託管費		15,916,371.10	20,106,825.66
3.銷售服務費		-	-
4.投資顧問費		-	-
5.利息支出		-	346,221.65
其中：賣出回購金融資產支出		-	346,221.65
6.信用減值損失	6.4.7.17	-	-
7.稅金及附加		216.72	420.69
8.其他費用	6.4.7.18	146,856.89	6,795,979.97
三、利潤總額（虧損總額以“-”號填列）		-466,731,374.20	284,557,135.50
減：所得稅費用		-	-
四、淨利潤（淨虧損以“-”號填列）		-466,731,374.20	284,557,135.50
五、其他綜合收益的稅後淨額		-	-
六、綜合收益總額		-466,731,374.20	284,557,135.50

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

6.3 淨資產（基金淨值）變動表

會計主體：華夏回報證券投資基金

本報告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

單位：人民幣元

項目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	實收基金	其他綜合 收益（若有）	未分配利潤	淨資產合計
一、上期期末淨資產（基金淨值）	9,444,816,091.35	-	4,395,948,053.67	13,840,764,145.02
二、本期期初淨資產（基金淨值）	9,444,816,091.35	-	4,395,948,053.67	13,840,764,145.02
三、本期增減變動額（減少以“-”號填列）	-88,328,271.23	-	-636,841,379.21	-725,169,650.44
（一）、綜合收益總額	-	-	-466,731,374.20	-466,731,374.20
（二）、本期基金份額交易產生的基金淨值變動數（淨值減少以“-”號填列）	-88,328,271.23	-	-28,820,541.24	-117,148,812.47
其中：1.基金申購款	642,314,385.94	-	235,535,492.08	877,849,878.02
2.基金贖回款	-730,642,657.17	-	-264,356,033.32	-994,998,690.49
（三）、本期向基金份額持有人分配利潤產生的基金淨值變動（淨值減少以“-”號填列）	-	-	-141,289,463.77	-141,289,463.77
四、本期期末淨資產（基金淨值）	9,356,487,820.12	-	3,759,106,674.46	13,115,594,494.58
項目	上年度可比期間 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日			
	實收基金	其他綜合 收益（若有）	未分配利潤	淨資產合計
一、上期期末淨資產（基金淨值）	7,957,194,040.08	-	8,348,062,996.12	16,305,257,036.20

二、本期期初淨資產（基金淨值）	7,957,194,040.08	-	8,348,062,996.12	16,305,257,036.20
三、本期增減變動額（減少以“-”號填列）	537,962,478.90	-	-165,202,371.26	372,760,107.64
（一）、綜合收益總額	-	-	284,557,135.50	284,557,135.50
（二）、本期基金份額交易產生的基金淨值變動數（淨值減少以“-”號填列）	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
（三）、本期向基金份額持有人分配利潤產生的基金淨值變動（淨值減少以“-”號填列）	-	-	-979,523,162.80	-979,523,162.80
四、本期期末淨資產（基金淨值）	8,495,156,518.98	-	8,182,860,624.86	16,678,017,143.84

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淨資產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

除下述變更後的會計政策外，本基金報告期所採用的其他會計政策、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

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

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

年 12 月 31 日及 2022 年 1 月 1 日，本基金均沒有指定為以公允價值計量且其變動計入當期損益的金融資產。

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

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

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

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

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

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

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、債券的差價收入免征增值稅，暫不徵收企業所得稅。
- (4) 存款利息收入不徵收增值稅。
- (5) 國債、地方政府債利息收入，金融同業往來利息收入免征增值稅。
- (6) 對基金取得的債券的利息收入及其他收入，暫不徵收企業所得稅。
- (7) 基金作為流通股股東在股權分置改革過程中收到由非流通股股東支付的股份、現金等對價暫免徵收印花稅、企業所得稅和個人所得稅。
- (8) 對基金在境內取得的股票的股息、紅利收入，由上市公司在向基金派發股息、紅利收入時代扣代繳 20% 的個人所得稅，暫不徵收企業所得稅。基金在境內從上市公司分配取得的股息紅利所得，持股期限在 1 個月以內（含 1 個月）的，全額計入應納稅所得額，持股期限在 1 個月以上至 1 年（含 1 年）的，減按 50% 計入應納稅所得額，持股期限超過 1 年的，暫免徵收個人所得稅。對基

金通過滬港通/深港通投資香港聯交所上市 H 股取得的股息紅利，H 股公司應向中國證券登記結算有限責任公司(以下簡稱“中國結算”)提出申請，由中國結算向 H 股公司提供內地個人投資者名冊，H 股公司按照 20%的稅率代扣個人所得稅。基金通過滬港通/深港通投資香港聯交所上市的非 H 股取得的股息紅利，由中國結算按照 20%的稅率代扣個人所得稅。對香港市場投資者取得的股息、紅利收入按照 10%的稅率代扣所得稅。

(9) 基金在境內賣出股票按 0.1%的稅率繳納股票交易印花稅，買入股票不徵收股票交易印花稅。基金通過滬港通/深港通買賣、繼承、贈與聯交所上市股票，按照香港特別行政區現行稅法規定繳納印花稅。

(10) 基金在境外證券交易所進行交易或取得的源自境外證券市場的收益，其涉及的稅收政策，按照相關國家或地區稅收法律和法規執行。

(11) 本基金分別按實際繳納的增值稅額的 7%、3%、2%繳納城市維護建設稅、教育費附加和地方教育費附加。

6.4.7 重要財務報表專案的說明

6.4.7.1 銀行存款

單位：人民幣元

項目	本期末 2022 年 6 月 30 日
活期存款	798,590,988.44
等於：本金	798,459,340.37
加：應計利息	131,648.07
定期存款	-
等於：本金	-
加：應計利息	-
其中：存款期限 1 個月以內	-
存款期限 1-3 個月	-
存款期限 3 個月以上	-
其他存款	-
等於：本金	-
加：應計利息	-
合計	798,590,988.44

6.4.7.2 交易性金融資產

單位：人民幣元

項目	本期末 2022 年 6 月 30 日
----	------------------------

		成本	應計利息	公允價值	公允價值變動
股票		5,008,604,239.29	-	5,855,158,214.54	846,553,975.25
貴金屬投資-金交所黃金合約		-	-	-	-
債券	交易所市場	19,822,000.00	11,072.74	30,880,552.74	11,047,480.00
	銀行間市場	4,964,765,056.08	67,924,803.29	5,031,831,303.29	-858,556.08
	合計	4,984,587,056.08	67,935,876.03	5,062,711,856.03	10,188,923.92
資產支持證券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合計		9,993,191,295.37	67,935,876.03	10,917,870,070.57	856,742,899.17

6.4.7.3 衍生金融資產/負債

6.4.7.3.1 衍生金融資產/負債期末餘額

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 2022 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	1,500,167,808.21	-
合計	1,500,167,808.21	-

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 其他資產

無。

6.4.7.6 其他負債

單位：人民幣元

項目	本期末 2022 年 6 月 30 日
應付券商交易單元保證金	500,000.00
應付贖回費	72,526.68
應付證券出借違約金	-
應付交易費用	18,040,821.44
其中：交易所市場	18,020,621.51

銀行間市場	20,199.93
應付利息	-
預提費用	209,095.94
合計	18,822,444.06

6.4.7.7 實收基金

金額單位：人民幣元

項目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份額（份）	帳面金額
上年度末	9,444,816,091.35	9,444,816,091.35
本期申購	642,314,385.94	642,314,385.94
本期贖回（以“-”號填列）	-730,642,657.17	-730,642,657.17
本期末	9,356,487,820.12	9,356,487,820.12

6.4.7.8 未分配利潤

單位：人民幣元

項目	已實現部分	未實現部分	未分配利潤合計
本期期初	125,100,145.20	4,270,847,908.47	4,395,948,053.67
本期利潤	-44,482,397.08	-422,248,977.12	-466,731,374.20
本期基金份額交易產生的變動數	1,435,713.08	-30,256,254.32	-28,820,541.24
其中：基金申購款	-3,414,801.92	238,950,294.00	235,535,492.08
基金贖回款	4,850,515.00	-269,206,548.32	-264,356,033.32
本期已分配利潤	-141,289,463.77	-	-141,289,463.77
本期末	-59,236,002.57	3,818,342,677.03	3,759,106,674.46

6.4.7.9 存款利息收入

單位：人民幣元

項目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	2,283,329.79
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	32,334.16
其他	6,700.28
合計	2,322,364.23

6.4.7.10 股票投資收益

單位：人民幣元

項目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
賣出股票成交總額	4,481,312,522.88

減：賣出股票成本總額	4,545,701,639.44
減：交易費用	11,745,342.35
買賣股票差價收入	-76,134,458.91

6.4.7.11 債券投資收益

6.4.7.11.1 債券投資收益項目構成

單位：人民幣元

項目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
債券投資收益——利息收入	75,154,586.57
債券投資收益——買賣債券（債轉股及債券到期兌付）差價收入	4,867,442.92
債券投資收益——贖回差價收入	-
債券投資收益——申購差價收入	-
合計	80,022,029.49

6.4.7.11.2 債券投資收益——買賣債券差價收入

單位：人民幣元

項目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
賣出債券（債轉股及債券到期兌付）成交總額	6,551,110,054.13
減：賣出債券（債轉股及債券到期兌付）成本總額	6,496,503,608.41
減：應計利息總額	49,690,827.75
減：交易費用	48,175.05
買賣債券差價收入	4,867,442.92

6.4.7.12 資產支持證券投資收益

無。

6.4.7.13 衍生工具收益

6.4.7.13.1 衍生工具收益——買賣權證差價收入

無。

6.4.7.13.2 衍生工具收益——其他投資收益

無。

6.4.7.14 股利收益

單位：人民幣元

項目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投資產生的股利收益	57,747,821.43
其中：證券出借權益補償收入	-
基金投資產生的股利收益	-
合計	57,747,821.43

6.4.7.15 公允價值變動收益

單位：人民幣元

項目名稱	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
1.交易性金融資產	-422,248,977.12
——股票投資	-427,535,967.37
——債券投資	5,286,990.25
——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	-422,248,977.12

6.4.7.16 其他收入

單位：人民幣元

項目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
基金贖回費收入	1,281,671.44
基金申購費收入	-
合計	1,281,671.44

6.4.7.17 信用減值損失

無。

6.4.7.18 其他費用

單位：人民幣元

項目	本期 2022年1月1日至2022年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	19,160.95
銀行間帳戶維護費	18,000.00
其他	600.00
合計	146,856.89

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 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期間 2021年1月1日至2021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	297,235,311.14	3.73%	813,538,226.83	18.10%

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 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期間 2021年1月1日至2021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

		券成交總額的比例		成交總額的比例
中信證券	-	-	338,896.70	100.00%

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

金額單位：人民幣元

關聯方名稱	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 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	276,807.22	4.26%	276,807.22	1.54%
關聯方名稱	上年度可比期間 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%

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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期間 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
當期發生的基金應支付的管理費	95,498,226.63	120,640,954.18
其中：支付銷售機構的客戶維護費	23,077,094.52	29,711,399.89

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專案。

6.4.10.2.2 基金託管費

單位：人民幣元

項目	本期	上年度可比期間
	2022年1月1日至2022年6月30日	2021年1月1日至2021年6月30日
當期發生的基金應支付的託管費	15,916,371.10	20,106,825.66

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

關聯方名稱	本期		上年度可比期間	
	2022年1月1日至2022年6月30日		2021年1月1日至2021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	798,590,988.44	2,283,329.79	833,212,485.47	2,938,278.76

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					
2022 年 1 月 1 日至 2022 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	600938	中國海油	新股發行	120,005	1,296,054.00
中信證券	688223	晶科能源	新股發行	213,000	1,065,000.00
中信證券	688326	經緯恒潤	新股發行	6,832	826,672.00
中信證券	301200	大族數控	新股發行	8,566	655,812.96
中信證券	688302	海創藥業	新股發行	13,082	561,479.44
中信證券	301109	軍信股份	新股發行	12,250	426,422.50
中信證券	301302	華如科技	新股發行	4,651	241,991.53
中信證券	688150	萊特光電	新股發行	5,626	124,053.30
中信證券	688290	景業智能	新股發行	3,040	103,025.60
中信證券	603132	金徽股份	新股發行	1,342	14,493.60
中信證券	603191	望變電氣	新股發行	1,149	13,627.14
中信證券	603209	興通股份	新股發行	595	12,804.40
中信證券	001266	宏英智慧	新股發行	247	9,536.67
中信證券	603215	比依股份	新股發行	575	7,187.50
中信證券	603051	鹿山新材	新股發行	272	7,014.88
上年度可比期間 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 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

注：本期“網上申購”和“網下申購”兩種發行方式合併披露為“新股發行”。

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	2022-01-13	2022-01-13	0.150	46,528,460.1 3	94,761,003.6 4	141,289,463 .77	-
合 計			0.150	46,528,460.1 3	94,761,003.6 4	141,289,463 .77	-

6.4.12 期末（2022 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	受限 期	流通 受限 類型	認購 價格	期末估 值單價	數量(股)	期末 成本 總額	期末 估值總額	備註
6880 52	納芯 微	2022- 04-14	6 個月	新發 流通 受限	230.00	350.81	6,090	1,400, 700.00	2,136,432 .90	-
6009 38	中國 海油	2022- 04-14	6 個月	新發 流通 受限	10.80	15.86	84,004	907,24 3.20	1,332,303 .44	-
6881 20	華海 清科	2022- 05-30	6 個月	新發 流通 受限	136.66	217.12	4,822	658,97 4.52	1,046,952 .64	-
6881 53	唯捷 創芯	2022- 04-01	6 個月	新發 流通 受限	66.60	44.24	7,674	511,08 8.40	339,497.7 6	-
6883 22	奧比 中光	2022- 06-30	1 個月 內 (含)	新發 流通 受限	30.99	30.99	8,529	264,31 3.71	264,313.7 1	-
3011 39	元道 通信	2022- 06-30	1 個月 內 (含)	新發 流通 受限	38.46	38.46	5,085	195,56 9.10	195,569.1 0	-

688150	萊特光電	2022-03-10	6 個月	新發流通受限	22.05	19.60	5,626	124,053.30	110,269.60	-
688283	坤恒順維	2022-02-08	6 個月	新發流通受限	33.80	45.41	1,595	53,911.00	72,428.95	-
301236	軟通動力	2022-03-08	6 個月	新發流通受限	72.88	31.38	2,076	100,865.92	65,144.88	含證券送配
301219	騰遠鈷業	2022-03-10	6 個月	新發流通受限	173.98	87.82	578	55,847.58	50,759.96	含證券送配
301200	大族數控	2022-02-18	6 個月	新發流通受限	76.56	51.92	857	65,611.92	44,495.44	-
301206	三元生物	2022-01-26	6 個月	新發流通受限	109.30	45.69	945	68,859.00	43,177.05	含證券送配
301150	中一科技	2022-04-14	6 個月	新發流通受限	163.56	82.76	404	43,997.64	33,435.04	含證券送配
301109	軍信股份	2022-04-06	6 個月	新發流通受限	34.81	16.14	1,838	42,642.25	29,665.32	含證券送配
301302	華如科技	2022-06-16	6 個月	新發流通受限	52.03	56.42	466	24,245.98	26,291.72	-
301268	銘利達	2022-03-29	6 個月	新發流通受限	28.50	34.87	641	18,268.50	22,351.67	-
301139	元道通信	2022-06-30	6 個月	新發流通受限	38.46	38.46	566	21,768.36	21,768.36	-
3011	採納	2022-	6 個月	新發	50.31	70.37	301	15,143	21,181.37	-

22	股份	01-19		流通 受限				.31		
3011 02	兆訊 傳媒	2022- 03-15	6 個月	新發 流通 受限	39.88	31.09	642	25,602 .96	19,959.78	-
3011 62	國能 日新	2022- 04-19	6 個月	新發 流通 受限	45.13	54.11	334	15,073 .42	18,072.74	-
3011 23	奕東 電子	2022- 01-14	6 個月	新發 流通 受限	37.23	25.39	656	24,422 .88	16,655.84	-
3011 03	何氏 眼科	2022- 03-14	6 個月	新發 流通 受限	42.50	32.02	507	16,575 .00	16,234.14	含 證 券 送 配
3012 86	僑源 股份	2022- 06-06	6 個月	新發 流通 受限	16.91	19.79	784	13,257 .44	15,515.36	-
3012 48	傑創 智能	2022- 04-13	6 個月	新發 流通 受限	39.07	29.87	472	18,441 .04	14,098.64	-
3012 12	聯盛 化學	2022- 04-07	6 個月	新發 流通 受限	29.67	33.28	416	12,342 .72	13,844.48	-
3012 98	東利 機械	2022- 05-27	6 個月	新發 流通 受限	12.68	20.83	634	8,039. 12	13,206.22	-
3011 48	嘉戎 技術	2022- 04-14	6 個月	新發 流通 受限	38.39	23.90	516	19,809 .24	12,332.40	-
3012 59	艾布 魯	2022- 04-18	6 個月	新發 流通 受限	18.39	24.94	483	8,882. 37	12,046.02	-
3010 97	天益 醫療	2022- 03-25	6 個月	新發 流通 受限	52.37	47.83	249	13,040 .13	11,909.67	-
3012 20	亞香 股份	2022- 06-15	6 個月	新發 流通 受限	35.98	39.15	285	10,254 .30	11,157.75	-
3012 37	和順 科技	2022- 03-16	6 個月	新發 流通 受限	56.69	41.86	261	14,796 .09	10,925.46	-
3011	唯科	2022-	6 個月	新發	64.08	37.52	271	17,365	10,167.92	-

96	科技	01-04		流通 受限				.68		
3011 25	騰亞 精工	2022- 05-27	6 個月	新發 流通 受限	22.49	27.42	327	7,354. 23	8,966.34	-
3011 63	宏德 股份	2022- 04-11	6 個月	新發 流通 受限	26.27	32.33	277	7,276. 79	8,955.41	-
3011 30	西點 藥業	2022- 02-16	6 個月	新發 流通 受限	22.55	37.70	237	5,344. 35	8,934.90	-
3011 35	瑞德 智能	2022- 04-01	6 個月	新發 流通 受限	31.98	26.26	338	10,809 .24	8,875.88	-
3011 81	標榜 股份	2022- 02-11	6 個月	新發 流通 受限	40.25	30.59	257	10,344 .25	7,861.63	-
3012 28	實樸 檢測	2022- 01-21	6 個月	新發 流通 受限	20.08	20.34	373	7,489. 84	7,586.82	-
3012 79	金道 科技	2022- 04-06	6 個月	新發 流通 受限	31.20	22.81	296	9,235. 20	6,751.76	-

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

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

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

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

⑤基金可使用以基金名義開設的股票帳戶，選擇網上或者網下一種方式進行新股申購。其中基金參與網下申購獲得的新股或作為戰略投資者參與配售獲得的新股，在新股上市後的約定期限內不

能自由轉讓；基金參與網上申購獲配的新股，從新股獲配日至新股上市日之間不能自由轉讓。

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，本基金主要投資于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準的風險指標，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 2022 年 6 月 30 日	1 年以內	1-5 年	5 年以上	合計
銀行存款	798,590,988.44	-	-	798,590,988.44
結算備付金	3,335,631.27	-	-	3,335,631.27
結算保證金	817,647.75	-	-	817,647.75
債券投資	2,918,109,960.14	2,144,601,895.89	-	5,062,711,856.03
資產支持證券	-	-	-	-

買入返售金融資產	1,500,167,808.21	-	-	1,500,167,808.21
應收直銷申購款	-	-	-	-
賣出回購金融資產款	-	-	-	-
上年度末 2021 年 12 月 31 日	1 年以內	1-5 年	5 年以上	合計
銀行存款	1,832,783,286.85	-	-	1,832,783,286.85
結算備付金	5,273,357.61	-	-	5,273,357.61
結算保證金	1,058,893.45	-	-	1,058,893.45
債券投資	1,668,746,268.16	2,508,953,000.00	-	4,177,699,268.16
資產支持證券	-	-	-	-
買入返售金融資產	491,421,327.71	-	-	491,421,327.71
應收直銷申購款	-	-	-	-
賣出回購金融資產款	-	-	-	-

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

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 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
	利率下降 25 個基點	13,554,517.17	13,393,320.92
	利率上升 25 個基點	-13,470,834.17	-13,288,298.04

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	上年度末
----	-----	------

	2022 年 6 月 30 日		2021 年 12 月 31 日	
	公允價值	佔基金資產 淨值比例 (%)	公允價值	佔基金資產淨 值比例 (%)
交易性金融資產－股票投資	5,855,158,214.54	44.64	7,312,148,813.18	52.83
交易性金融資產－基金投資	-	-	-	-
交易性金融資產－債券投資	30,880,552.74	0.24	1,268.16	0.00
交易性金融資產－貴金屬投資	-	-	-	-
衍生金融資產－權證投資	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合計	5,886,038,767.28	44.88	7,312,150,081.34	52.83

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

②由於四捨五入的原因，分項之和與合計項之間可能存在尾數差異。

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 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
	-5%	-294,099,495.76	-405,193,896.85
	+5%	294,099,495.76	405,193,896.85

6.4.14 公允價值

6.4.14.1 金融工具公允價值計量的方法

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

第一層次：相同資產或負債在活躍市場上未經調整的報價；

第二層次：除第一層次輸入值外相關資產或負債直接或間接可觀察的輸入值；

第三層次：相關資產或負債的不可觀察輸入值。

6.4.14.2 持續的以公允價值計量的金融工具

6.4.14.2.1 各層次金融工具的公允價值

單位：人民幣元

公允價值計量結果所屬的層次	本期末 2022 年 6 月 30 日
第一層次	5,879,928,669.21
第二層次	5,032,312,954.46

第三層次	5,628,446.90
合計	10,917,870,070.57

6.4.14.2.2 公允價值所屬層次間的重大變動

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

6.4.14.3 非持續的以公允價值計量的金融工具的說明

截至 2022 年 6 月 30 日止，本基金未持有非持續的以公允價值計量的金融資產。

6.4.14.4 不以公允價值計量的金融工具的相關說明

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

6.4.15 有助於理解和分析會計報表需要說明的其他事項

截至資產負債表日本基金無需要說明的其他重要事項。

§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	5,855,158,214.54	44.28
	其中：股票	5,855,158,214.54	44.28
2	基金投資	-	-
3	固定收益投資	5,062,711,856.03	38.29
	其中：債券	5,062,711,856.03	38.29
	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	1,500,167,808.21	11.35
	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	801,926,619.71	6.06

8	其他各項資產	2,881,391.25	0.02
9	合計	13,222,845,889.74	100.00

7.2 報告期末按行業分類的股票投資組合

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	31,178,945.00	0.24
B	採礦業	1,332,303.44	0.01
C	製造業	3,994,851,382.46	30.46
D	電力、熱力、燃氣及水生產和供應業	20,496,192.15	0.16
E	建築業	-	-
F	批發和零售業	46,227,283.00	0.35
G	交通運輸、倉儲和郵政業	175,011,410.70	1.33
H	住宿和餐飲業	-	-
I	信息傳輸、軟件和信息技術服務業	633,100,300.08	4.83
J	金融業	96,466,187.83	0.74
K	房地產業	852,121,991.90	6.50
L	租賃和商務服務業	19,959.78	0.00
M	科學研究和技術服務業	7,586.82	0.00
N	水利、環境和公共設施管理業	4,328,437.24	0.03
O	居民服務、修理和其他服務業	-	-
P	教育	-	-
Q	衛生和社會工作	16,234.14	0.00
R	文化、體育和娛樂業	-	-
S	綜合	-	-
	合計	5,855,158,214.54	44.64

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	600519	貴州茅台	562,564	1,150,443,380.00	8.77
2	600941	中國移動	7,968,875	482,116,937.50	3.68
3	002304	洋河股份	2,515,479	460,709,978.85	3.51
4	600048	保利發展	24,491,367	427,619,267.82	3.26
5	300750	寧德時代	777,171	415,009,314.00	3.16
6	600383	金地集團	26,974,657	362,539,390.08	2.76
7	600009	上海機場	3,086,621	175,011,410.70	1.33
8	600862	中航高科	5,572,796	156,595,567.60	1.19
9	600456	寶鈦股份	2,570,000	152,658,000.00	1.16
10	600406	國電南瑞	5,496,900	148,416,300.00	1.13
11	600438	通威股份	2,470,707	147,896,521.02	1.13
12	300034	鋼研高納	3,219,500	135,798,510.00	1.04

13	002025	航太電器	1,845,151	128,828,442.82	0.98
14	600893	航發動力	2,764,464	125,810,756.64	0.96
15	600887	伊利股份	3,218,000	125,341,100.00	0.96
16	600741	華域汽車	5,387,070	123,902,610.00	0.94
17	600801	華新水泥	5,670,416	110,629,816.16	0.84
18	600585	海螺水泥	3,043,124	107,361,414.72	0.82
19	002179	中航光電	1,684,319	106,651,079.08	0.81
20	601318	中國平安	2,064,304	96,382,353.76	0.73
21	300450	先導智能	1,502,080	94,901,414.40	0.72
22	000893	亞鉀國際	2,184,200	75,158,322.00	0.57
23	603986	兆易創新	480,620	68,348,970.20	0.52
24	000792	鹽湖股份	2,087,600	62,544,496.00	0.48
25	001979	招商蛇口	4,613,800	61,963,334.00	0.47
26	000887	中鼎股份	2,762,320	50,384,716.80	0.38
27	600153	建發股份	3,536,900	46,227,283.00	0.35
28	603712	七一二	1,347,100	42,433,650.00	0.32
29	000513	麗珠集團	660,300	23,909,463.00	0.18
30	000661	長春高新	100,602	23,482,518.84	0.18
31	300760	邁瑞醫療	68,400	21,422,880.00	0.16
32	300395	菲利華	428,400	19,278,000.00	0.15
33	300498	溫氏股份	765,700	16,301,753.00	0.12
34	603477	巨星農牧	620,400	14,877,192.00	0.11
35	300767	震安科技	200,492	11,664,624.56	0.09
36	600163	中閩能源	1,331,147	11,248,192.15	0.09
37	002311	海大集團	172,822	10,371,048.22	0.08
38	600900	長江電力	400,000	9,248,000.00	0.07
39	603486	科沃斯	73,300	8,934,537.00	0.07
40	605117	德業股份	22,400	6,269,536.00	0.05
41	600323	瀚藍環境	208,507	4,274,393.50	0.03
42	600031	三一重工	200,000	3,812,000.00	0.03
43	002916	深南電路	39,973	3,745,869.83	0.03
44	000012	南玻 A	468,400	3,475,528.00	0.03
45	300685	艾德生物	106,560	3,409,920.00	0.03
46	603587	地素時尚	200,000	3,170,000.00	0.02
47	600111	北方稀土	88,400	3,108,144.00	0.02
48	603529	愛瑪科技	58,940	3,087,277.20	0.02
49	688052	納芯微	6,090	2,136,432.90	0.02
50	300433	藍思科技	180,000	1,992,600.00	0.02
51	600938	中國海油	84,004	1,332,303.44	0.01
52	688120	華海清科	4,822	1,046,952.64	0.01
53	688153	唯捷創芯	7,674	339,497.76	0.00
54	688322	奧比中光	8,529	264,313.71	0.00
55	301139	元道通信	5,651	217,337.46	0.00

56	688150	萊特光電	5,626	110,269.60	0.00
57	688246	嘉和美康	3,364	89,684.24	0.00
58	300059	東方財富	3,132	79,552.80	0.00
59	688283	坤恒順維	1,595	72,428.95	0.00
60	301236	軟通動力	2,076	65,144.88	0.00
61	301219	騰遠鈷業	578	50,759.96	0.00
62	301200	大族數控	857	44,495.44	0.00
63	301206	三元生物	945	43,177.05	0.00
64	601089	福元醫藥	1,749	36,816.45	0.00
65	301150	中一科技	404	33,435.04	0.00
66	301109	軍信股份	1,838	29,665.32	0.00
67	301302	華如科技	466	26,291.72	0.00
68	301268	銘利達	641	22,351.67	0.00
69	603833	歐派家居	144	21,697.92	0.00
70	301122	採納股份	301	21,181.37	0.00
71	301102	兆訊傳媒	642	19,959.78	0.00
72	301162	國能日新	334	18,072.74	0.00
73	301123	奕東電子	656	16,655.84	0.00
74	301103	何氏眼科	507	16,234.14	0.00
75	600600	青島啤酒	152	15,795.84	0.00
76	301286	僑源股份	784	15,515.36	0.00
77	301248	傑創智能	472	14,098.64	0.00
78	301097	天益醫療	286	13,863.27	0.00
79	301212	聯盛化學	416	13,844.48	0.00
80	301298	東利機械	634	13,206.22	0.00
81	301148	嘉戎技術	516	12,332.40	0.00
82	301259	艾布魯	483	12,046.02	0.00
83	001268	聯合精密	409	11,337.48	0.00
84	000333	美的集團	187	11,292.93	0.00
85	301220	亞香股份	285	11,157.75	0.00
86	301237	和順科技	261	10,925.46	0.00
87	301196	唯科科技	271	10,167.92	0.00
88	301125	騰亞精工	327	8,966.34	0.00
89	301163	宏德股份	277	8,955.41	0.00
90	301130	西點藥業	237	8,934.90	0.00
91	301135	瑞德智能	338	8,875.88	0.00
92	301181	標榜股份	257	7,861.63	0.00
93	301228	實樸檢測	373	7,586.82	0.00
94	301279	金道科技	296	6,751.76	0.00
95	600885	宏發股份	157	6,570.45	0.00
96	601336	新華保險	133	4,281.27	0.00
97	002050	三花智控	48	1,319.04	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	600941	中國移動	499,213,867.55	3.61
2	600048	保利發展	394,204,474.69	2.85
3	600383	金地集團	348,237,943.20	2.52
4	600009	上海機場	156,554,625.80	1.13
5	600741	華域汽車	130,164,480.99	0.94
6	600456	寶鈦股份	128,670,462.39	0.93
7	600893	航發動力	126,773,653.08	0.92
8	600862	中航高科	126,163,445.33	0.91
9	300034	鋼研高納	126,128,006.87	0.91
10	300059	東方財富	125,922,127.13	0.91
11	600887	伊利股份	124,826,716.53	0.90
12	300750	寧德時代	124,753,777.64	0.90
13	002025	航太電器	123,630,338.47	0.89
14	600406	國電南瑞	123,199,543.28	0.89
15	600585	海螺水泥	123,075,381.85	0.89
16	600801	華新水泥	122,917,520.53	0.89
17	601318	中國平安	94,725,522.59	0.68
18	300450	先導智能	66,347,411.76	0.48
19	603986	兆易創新	64,198,098.45	0.46
20	000792	鹽湖股份	62,523,305.00	0.45

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	601888	中國中免	685,791,925.04	4.95
2	002304	洋河股份	576,111,412.44	4.16
3	300122	智飛生物	556,696,544.77	4.02
4	300015	愛爾眼科	479,215,248.53	3.46
5	600600	青島啤酒	369,906,930.71	2.67
6	603613	國聯股份	196,864,146.50	1.42
7	600570	恒生電子	191,547,015.04	1.38
8	600438	通威股份	180,026,707.30	1.30
9	000858	五糧液	163,658,355.94	1.18
10	300059	東方財富	143,737,091.63	1.04

11	600519	貴州茅台	126,552,997.00	0.91
12	300151	昌紅科技	85,267,109.70	0.62
13	002390	信邦製藥	79,202,335.37	0.57
14	002594	比亞迪	71,926,106.60	0.52
15	300628	億聯網路	55,841,343.06	0.40
16	000568	瀘州老窖	53,916,347.00	0.39
17	002415	海康威視	45,611,019.92	0.33
18	600153	建發股份	38,050,822.57	0.27
19	000596	古井貢酒	36,949,795.18	0.27
20	601799	星宇股份	34,848,398.30	0.25

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

單位：人民幣元

買入股票成本（成交）總額	3,516,247,008.17
賣出股票收入（成交）總額	4,481,312,522.88

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	409,257,863.01	3.12
2	央行票據	-	-
3	金融債券	4,617,491,852.06	35.21
	其中：政策性金融債	4,617,491,852.06	35.21
4	企業債券	-	-
5	企業短期融資券	5,081,588.22	0.04
6	中期票據	-	-
7	可轉債（可交換債）	30,880,552.74	0.24
8	同業存單	-	-
9	其他	-	-
10	合計	5,062,711,856.03	38.60

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	220201	22 國開 01	6,200,000	626,557,731.51	4.78
2	210411	21 農發 11	5,000,000	508,258,904.11	3.88

3	180204	18 國開 04	4,700,000	485,016,178.08	3.70
4	210218	21 國開 18	4,700,000	480,364,594.52	3.66
5	210015	21 附息國 債 15	4,000,000	409,257,863.01	3.12

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 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 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，中國農業發展銀行、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	817,647.75
2	應收清算款	-
3	應收股利	-
4	應收利息	-
5	應收申購款	2,063,743.50
6	其他應收款	-
7	待攤費用	-
8	其他	-

9	合計	2,881,391.25
---	----	--------------

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
1,043,911	8,962.92	50,446,365.73	0.54%	9,306,041,454.39	99.46%

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	1,704,800.34	0.02%

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	10~50
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（2003 年 9 月 5 日）基金份額總額	3,796,885,823.40
本報告期期初基金份額總額	9,444,816,091.35
本報告期基金總申購份額	642,314,385.94
減：本報告期基金總贖回份額	730,642,657.17
本報告期基金拆分變動份額	-
本報告期期末基金份額總額	9,356,487,820.12

§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

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

本報告期內，本基金託管人的專門基金託管部門未發生重大人事變動。

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	
長江證券	2	2,505,595,222.57	31.43%	2,333,448.08	35.94%	-
國都證券	1	2,370,393,544.76	29.74%	1,733,472.25	26.70%	-
川財證券	1	1,436,807,118.34	18.03%	1,050,749.49	16.18%	-
廣發證券	2	517,620,417.77	6.49%	482,068.89	7.42%	-
中天證券	1	472,668,587.	5.93%	345,662.97	5.32%	-

		91				
興業證券	2	370,583,642.46	4.65%	271,010.17	4.17%	-
中信證券	4	297,235,311.14	3.73%	276,807.22	4.26%	-

注：①為了貫徹中國證監會的有關規定，我公司制定了選擇券商的標準，即：

i 經營行為規範。

ii 公司財務狀況良好。

iii 有良好的內控制度，在業內有良好的聲譽。

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

v 建立了廣泛的信息網路，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 本基金管理人根據上述標準進行評估並確定選用的券商。

ii 本基金管理人與被選擇的券商簽訂交易單元租用協議/證券經紀服務協議。

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

④本報告期內，本基金租用的券商交易單元未發生變更。

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		債券回購交易		權證交易		基金交易	
	成交金額	佔當期債券成交總額的比例	成交金額	佔當期債券回購成交總額的比例	成交金額	佔當期權證成交總額的比例	成交金額	佔當期基金成交總額的比例
長江證券	-	-	-	-	-	-	-	-
國都證券	1,188.36	100.00%	-	-	-	-	-	-
川財證券	-	-	-	-	-	-	-	-

廣發證券	-	-	-	-	-	-	-	-
中天證券	-	-	-	-	-	-	-	-
興業證券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信證券	-	-	-	-	-	-	-	-

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

§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。在支付工本費後，投資者可在合理時間內取得備查文件的複製件或複印本。

§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%)		
貴州茅台	562,564	1,150,443,380.00
中國移動	7,968,875	482,116,937.50
洋河股份	2,515,479	460,709,978.85
保利發展	24,491,367	427,619,267.82
寧德時代	777,171	415,009,314.00
金地集團	26,974,657	362,539,390.08
上海機場	3,086,621	175,011,410.70
中航高科	5,572,796	156,595,567.60
寶鈦股份	2,570,000	152,658,000.00
國電南瑞	5,496,900	148,416,300.00

通威股份	2,470,707	147,896,521.02
鋼研高納	3,219,500	135,798,510.00
航太電器	1,845,151	128,828,442.82
航發動力	2,764,464	125,810,756.64
伊利股份	3,218,000	125,341,100.00
華域汽車	5,387,070	123,902,610.00
華新水泥	5,670,416	110,629,816.16
海螺水泥	3,043,124	107,361,414.72
中航光電	1,684,319	106,651,079.08
中國平安	2,064,304	96,382,353.76
先導智能	1,502,080	94,901,414.40
亞鉀國際	2,184,200	75,158,322.00
兆易創新	480,620	68,348,970.20
鹽湖股份	2,087,600	62,544,496.00
招商蛇口	4,613,800	61,963,334.00
中鼎股份	2,762,320	50,384,716.80
建發股份	3,536,900	46,227,283.00
七一二	1,347,100	42,433,650.00
麗珠集團	660,300	23,909,463.00
長春高新	100,602	23,482,518.84
邁瑞醫療	68,400	21,422,880.00
菲利華	428,400	19,278,000.00
溫氏股份	765,700	16,301,753.00
巨星農牧	620,400	14,877,192.00
震安科技	200,492	11,664,624.56
中閩能源	1,331,147	11,248,192.15
海大集團	172,822	10,371,048.22
長江電力	400,000	9,248,000.00
科沃斯	73,300	8,934,537.00
德業股份	22,400	6,269,536.00
瀚藍環境	208,507	4,274,393.50
三一重工	200,000	3,812,000.00
深南電路	39,973	3,745,869.83
南玻 A	468,400	3,475,528.00
艾德生物	106,560	3,409,920.00
地素時尚	200,000	3,170,000.00
北方稀土	88,400	3,108,144.00
愛瑪科技	58,940	3,087,277.20
納芯微	6,090	2,136,432.90
藍思科技	180,000	1,992,600.00
中國海油	84,004	1,332,303.44
華海清科	4,822	1,046,952.64
唯捷創芯	7,674	339,497.76

奧比中光	8,529	264,313.71
元道通信	5,651	217,337.46
萊特光電	5,626	110,269.60
嘉和美康	3,364	89,684.24
東方財富	3,132	79,552.80
坤恒順維	1,595	72,428.95
軟通動力	2,076	65,144.88
騰遠鈷業	578	50,759.96
大族數控	857	44,495.44
三元生物	945	43,177.05
福元醫藥	1,749	36,816.45
中一科技	404	33,435.04
軍信股份	1,838	29,665.32
華如科技	466	26,291.72
銘利達	641	22,351.67
歐派家居	144	21,697.92
採納股份	301	21,181.37
兆訊傳媒	642	19,959.78
國能日新	334	18,072.74
奕東電子	656	16,655.84
何氏眼科	507	16,234.14
青島啤酒	152	15,795.84
僑源股份	784	15,515.36
傑創智能	472	14,098.64
天益醫療	286	13,863.27
聯盛化學	416	13,844.48
東利機械	634	13,206.22
嘉戎技術	516	12,332.40
艾布魯	483	12,046.02
聯合精密	409	11,337.48
美的集團	187	11,292.93
亞香股份	285	11,157.75
和順科技	261	10,925.46
唯科科技	271	10,167.92
騰亞精工	327	8,966.34
宏德股份	277	8,955.41
西點藥業	237	8,934.90
瑞德智能	338	8,875.88
標榜股份	257	7,861.63
實樸檢測	373	7,586.82
金道科技	296	6,751.76
宏發股份	157	6,570.45
新華保險	133	4,281.27

三花智控	48	1,319.04
合計	136,443,072	5,855,158,214.54
(2)債券投資		
上市投資		
中國(100%)		
22 國開 01	6,200,000	626,557,731.51
21 農發 11	5,000,000	508,258,904.11
18 國開 04	4,700,000	485,016,178.08
21 國開 18	4,700,000	480,364,594.52
21 付息國債 15	4,000,000	409,257,863.01
21 進出 12	3,500,000	355,837,328.77
20 農發 07	3,000,000	311,269,726.03
16 農發 04	3,000,000	306,992,630.14
21 進出 03	3,000,000	306,192,739.73
22 國開 02	3,000,000	302,496,493.15
19 進出 08	2,000,000	205,229,972.60
22 國開綠債 02 清發	1,800,000	181,427,917.81
21 進出 22	1,500,000	153,592,561.64
22 農發 01	1,500,000	150,779,013.70
21 進出 08	1,400,000	141,787,704.11
21 進出 02	1,000,000	101,688,356.16
通 22 轉債	185,970	29,254,135.68
21 浦發集團 SCP005	50,000	5,081,588.22
巨星轉債	12,250	1,626,417.06
合計	49,548,220	5,062,711,856.03
(3)資產支持證券投資		
上市投資		
中國(-)		
合計	0	0.00
(4)買入返售金融資產		
銀行間同業市場買入返售金融資產		1,500,167,808.21
交易所市場買入返售金融資產		
合計		1,500,167,808.21
總投資資產		
銀行存款和結算備付金		801,926,619.71
其他各項資產		2,881,391.25
合計		13,222,845,889.74

補充披露 2：投資組合變動表

序號	證券類別	佔基金資產淨值的比例 (%)	佔基金資產淨值的比例 (%)
		2022 年 6 月 30 日	2021 年 12 月 31 日
1	股票	44.64	52.83
2	債券	38.60	30.18
3	資產支持證券	-	-
4	買入返售金融資產	11.44	3.55

華夏基金管理有限公司

二〇二二年八月三十日