

# 華夏回報證券投資基金

2024 年中期報告

2024 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：二〇二四年八月三十日

華夏回報證券投資基金（“本基金”）

2024 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 2024 年半年度報告一併閱覽。

華夏基金（香港）有限公司

香港代表

二〇二四年八月三十日

## §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 2024 年 8 月 28 日覆核了本報告中的財務指標、淨值表現、利潤分配情況、財務會計報告、投資組合報告等內容，保證覆核內容不存在虛假記載、誤導性陳述或者重大遺漏。

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

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

本報告中財務資料未經審計。

本報告期自 2024 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 主要會計數據和財務指標.....	4
3.2 基金淨值表現.....	4
§4 管理人報告.....	5
§5 託管人報告.....	9
§6 中期報告財務會計報告（未經審計）.....	10
6.1 資產負債表.....	10
6.2 利潤表.....	11
6.3 淨資產變動表.....	12
6.4 報表附注.....	14
§7 投資組合報告.....	32
7.1 期末基金資產組合情況.....	32
7.2 報告期末按行業分類的股票投資組合.....	33
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.....	33
7.4 報告期內股票投資組合的重大變動.....	38
7.5 期末按債券品種分類的債券投資組合.....	40
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.....	40
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.....	40
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.....	40
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.....	40
7.10 本基金投資股指期貨的投資政策.....	40
7.11 報告期末本基金投資的國債期貨交易情況說明.....	40
7.12 投資組合報告附注.....	41
§8 基金份額持有人信息.....	41
§9 開放式基金份額變動.....	42
§10 重大事件披露.....	42
§11 影響投資者決策的其他重要信息.....	45
§12 備查文件目錄.....	45
§13 補充披露.....	46

## §2 基金簡介

### 2.1 基金基本情況

基金名稱	華夏回報證券投資基金	
基金簡稱	華夏回報混合	
基金主代碼	002001	
交易代碼	002001(前端)	002002(後端)
基金運作方式	契約型開放式	
基金合同生效日	2003 年 9 月 5 日	
基金管理人	華夏基金管理有限公司	
基金託管人	中國銀行股份有限公司	
報告期末基金份額總額	8,236,615,502.15 份	
基金合同存續期	不定期	

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

### 2.2 基金產品說明

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

### 2.3 基金管理人和基金託管人

項目		基金管理人	基金託管人
名稱		華夏基金管理有限公司	中國銀行股份有限公司
信息披露 負責人	姓名	李彬	許俊
	聯絡電話	400-818-6666	010-66596688
	電子郵箱	service@ChinaAMC.com	fxjd_hq@bank-of-china.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		張佑君	葛海蛟

### 2.4 信息披露方式

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

### 2.5 其他相關資料

項目	名稱	辦公地址
註冊登記機構	華夏基金管理有限公司	北京市西城區金融大街 33 號通泰大廈 B 座 8 層

## §3 主要財務指標和基金淨值表現

### 3.1 主要會計數據和財務指標

金額單位：人民幣元

3.1.1 期間數據和指標	報告期（2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日）
本期已實現收益	-490,225,199.50
本期利潤	-374,168,332.36
加權平均基金份額本期利潤	-0.0448
本期加權平均淨值利潤率	-3.95%
本期基金份額淨值增長率	-3.91%
3.1.2 期末數據和指標	報告期末(2024年6月30日)
期末可供分配利潤	-851,183,404.23
期末可供分配基金份額利潤	-0.1033
期末基金資產淨值	9,113,652,245.50
期末基金份額淨值	1.106
3.1.3 累計期末指標	報告期末(2024年6月30日)
基金份額累計淨值增長率	1,201.61%

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

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

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

### 3.2 基金淨值表現

#### 3.2.1 基金份額淨值增長率及其與同期業績比較基準收益率的比較

階段	份額淨值增長率①	份額淨值增長率標準差②	業績比較基準收益率③	業績比較基準收益率標準差④	①-③	②-④
過去一個月	-5.06%	0.45%	0.12%	0.00%	-5.18%	0.45%
過去三個月	-2.64%	0.71%	0.37%	0.00%	-3.01%	0.71%

過去六個月	-3.91%	0.85%	0.75%	0.00%	-4.66%	0.85%
過去一年	-13.25%	0.75%	1.50%	0.00%	-14.75%	0.75%
過去三年	-35.13%	0.77%	4.50%	0.00%	-39.63%	0.77%
自基金合同生效起至今	1,201.61%	0.99%	47.42%	0.00%	1,154.19%	0.99%

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 2024 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、青島、武漢及瀋陽設有分公司，在香港、深圳、上海、北京設有子公司。公司是首批全國社保基金管理人、首批企業年金基金管理人、境內首批 QDII 基金管理人、境內首隻 ETF 基金管理人、境內首隻滬港通 ETF 基

金管理人、首批內地與香港基金互認基金管理人、首批基本養老保險基金投資管理人資格、首家加入聯合國責任投資原則組織的公募基金公司、首批公募 FOF 基金管理人、首批公募養老目標基金管理人、首批個人養老金基金管理人、境內首批中日互通 ETF 基金管理人、首批商品期貨 ETF 基金管理人、首批公募 MOM 基金管理人、首批納入互聯互通 ETF 基金管理人、首批北交所主題基金管理人以及特定客戶資產管理人、保險資金投資管理人、公募 REITs 管理人，國內首家承諾“碳中和”具體目標和路徑的公募基金公司，香港子公司是首批 RQFII 基金管理人。華夏基金是業務領域最廣泛的基金管理公司之一。

華夏基金是境內 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、SmartBeta 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 2024 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：在北交所主題偏股型基金(A 類)中華夏北交所創新中小企業精選兩年定開混合發起式排名第 1/10；在對沖策略絕對收益目標基金(A 類)華夏安泰對沖策略 3 個月定開混合排名第 1/22；在 QDII 混合基金(A 類)中華夏全球科技先鋒混合(QDII)排名第 2/48；在汽車主題行業偏股型基金(A 類)中華夏新能源車龍頭混合發起式(A 類)排名第 3/17；在消費行業偏股型基金(A 類)中華夏網購精選混合(A 類)排名第 3/78、華夏消費臻選混合發起式(A 類)排名第 7/78。

固收與固收+產品：在 QDII 債券型基金(A 類)中華夏收益債券 (QDII) (A 類)排名第 1/24、華夏大中華信用債券 (QDII) (A 類)排名第 2/24；在信用債指數債券型基金(A 類)中華夏亞債中國指數(A 類)排名第 2/18；在定開純債債券型基金(A 類)中華夏鼎華一年定開債券排名第 5/616、華夏鼎成一年定開債券排名第 14/616；在普通債券型基金(可投轉債)(A 類)中華夏穩定雙利債券(A 類)排名第 12/241；在長期純債債券型基金(A 類)中華夏鼎航債券(A 類)排名第 7/793、華夏鼎茂債券(A 類)排名第 19/793、華夏鼎英債券(A 類)排名第 25/793、華夏鼎隆債券(A 類)排名第 26/793、華夏鼎信債券(A 類)排名第 52/793；在普通債券型基金(二級)(A 類)中華夏穩享增利 6 個月債券(A 類)排名第 13/416、華夏鼎源債券(A 類)排名第 27/416、華夏希望債券(A 類)排名第 29/416。

在《中國證券報》第二十屆中國基金業金牛獎評選中，華夏基金榮獲“金牛獎 20 週年特別貢獻公司”，連續 8 年榮獲“被動投資金牛基金公司”，產品層面華夏創新前沿股票榮獲“五年期開放式股票型持續優勝金牛基金”，華夏中證 5G 通信主題 ETF 榮獲“開放式指數型金牛基金”。在證券時報主辦的第十八屆中國基金業明星基金獎評選活動上，華夏基金將兩大獎項收入囊中：公司層面，華夏基

金榮獲“三年期海外投資明星基金公司”；產品層面，華夏滬深 300ETF 榮獲“三年持續回報指數型明星基金獎”。在《上海證券報》主辦的第二十屆“金基金”獎評選活動上，華夏基金將三大金基金獎項收入囊中：公司層面，華夏基金榮獲“金基金·被動投資基金管理公司獎”；產品層面，華夏創新前沿股票榮獲“金基金·股票型基金五年期獎”，華夏行業景氣混合榮獲“金基金·偏股混合型基金五年期獎”。

在客戶服務方面，2024 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) 華夏基金直銷管道繼續優化頁面顯示，升級搜索及查詢等功能，給客戶更方便直觀的使用體驗；(2) 華夏基金管家用戶端上線親子帳戶，通過親子帳戶客戶可以為子女創建專屬理財帳戶，管理和儲備孩子的零花錢、教育資金，從客戶投資需求出發，進一步提升操作體驗；(3) 與常熟農商銀行等代銷機構合作，拓展更加豐富的客戶理財管道；(4) 開展“送你長期主義的花朵”、“領定制戶口本”、“打工人又愛又怕的一天要來了”、“希望高考也這麼簡單”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		
王君正	本基金的基金經理	2023-05-04	-	16 年	碩士。曾任泰達宏利基金管理有限公司研究部研究員，工銀瑞信基金管理有限公司研究員、研究部副總經理、基金經理等。2022 年 10 月加入華夏基金管理有限公司。
周飛	本基金的基金經理助理	2024-06-25	-	14 年	碩士。2010 年 7 月加入華夏基金管理有限公司。歷任交易管理部交易員、現金管理部基金經理助理。

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

②證券從業的含義遵從行業協會《證券基金經營機構董事、監事、高級管理人員及從業人員監督管理辦法》的相關規定。

#### 4.2 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 119 次，均為指數量化投資組合因投資策略需要發生的反向交易。

#### 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

2024 年上半年 A 股市場整體下行調整，上證指數下跌 0.25%，wind 全 A 下跌 8.01%。從風格表現看，表現較好的主要是高股息的紅利股，代表性指數紅利指數上半年上漲 11.29%，二是低估值高分紅個股，代表性指數 wind 低估值指數上半年上漲 11.5%；表現較差的主要集中在成長性高和估值偏高的中小個股，代表性指數科創 100 指數上半年下跌 25.29%，創業板綜合指數下跌 16.07%。

從行業表現看，上半年表現較好的是整體股息率高的行業，銀行上半年上漲 19.67%，公用事業上漲 15.77%，家電上漲 10.86%，交通運輸上漲 5.01%；上半年表現較差的是估值較高的科技板塊和基本面較差的地產產業鏈板塊，電腦上半年下跌 24.88%，輕工製造下跌 23.82%，傳媒下跌 23.04%，社會服務下跌 22.73%。

從 2024 年上半年的市場整體、風格和行業表現看，反映的是對全市場整體盈利預期偏差，對成長個股作為一個整體未來盈利增長下調的一種展望，所以市場更青睞低估值高分紅個股，而許多小市值個股沒有業績支撐跌幅較大。

報告期內，本基金堅持自下而上的選股方式，主要投資了醫藥醫療、消費、地產金融、科技、高端製造各細分板塊中競爭格局良好、壁壘較高、具有長期優勢的優質公司，但回過頭來看，其中大部分板塊與宏觀經濟的相關性，尤其是與國內需求的相關性較強，在國內需求預期偏弱、外需韌性較強的背景下，投資業績並不理想。

##### 4.4.2 報告期內基金的業績表現

截至 2024 年 6 月 30 日，本基金份額淨值為 1.106 元，本報告期份額淨值增長率為-3.91%，同期

業績比較基準增長率為 0.75%。

#### 4.5 管理人對宏觀經濟、證券市場及行業走勢的簡要展望

展望 2024 年下半年及以後更長時間框架，雖然國內需求在短期面臨一些壓力，但在高品質發展的指引下，我們對中國經濟長期轉型升級成功仍然抱有堅定的信心。具體而言，對於科技創新和綠色發展驅動的中國經濟增長，將帶來人工智慧、機器人、生物醫藥、新能源等新興領域的投資機會；中國經濟的穩健增長及老齡化社會的逐步來臨，將為醫療和養老服務、物業服務等服務領域，以及更廣泛的消費領域帶來投資機會；在以房地產和銀行、建築建材等為代表的傳統板塊經過長達 3 年的深度調整後，我們認為行業調整已經進入後半場，競爭格局的出清和改善有望迎來曙光，對於剩者為王的優質企業，我們認為長期也有較好的投資機會。

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

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

#### 4.6 管理人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

本基金本報告期末進行利潤分配，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）、投資組合報告等數據真實、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：2024 年 6 月 30 日

單位：人民幣元

資產	附注號	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
<b>資產：</b>			
貨幣資金	6.4.7.1	873,943,081.38	822,298,990.60
結算備付金		2,368,301.68	2,025,719.16
存出保證金		478,007.55	286,587.91
交易性金融資產	6.4.7.2	8,281,986,524.15	8,986,145,913.31
其中：股票投資		6,235,407,703.69	6,934,199,278.46
基金投資		-	-
債券投資		2,046,578,820.46	2,051,946,634.85
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	-	-
應收清算款		6,130.24	3,463,607.66

應收股利		-	-
應收申購款		1,876,657.11	1,762,766.50
遞延所得稅資產		-	-
其他資產	6.4.7.5	-	-
資產總計		9,160,658,702.11	9,815,983,585.14
<b>負債和淨資產</b>	<b>附注號</b>	<b>本期末 2024年6月30日</b>	<b>上年度末 2023年12月31日</b>
<b>負債：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融負債		-	-
衍生金融負債	6.4.7.3	-	-
賣出回購金融資產款		-	-
應付清算款		14,656,999.17	2,793,103.58
應付贖回款		7,165,235.10	14,570,792.23
應付管理人報酬		9,307,476.82	9,963,510.86
應付託管費		1,551,246.15	1,660,585.14
應付銷售服務費		-	-
應付投資顧問費		-	-
應交稅費		78,498.16	80,822.54
應付利潤		-	-
遞延所得稅負債		-	-
其他負債	6.4.7.6	14,247,001.21	13,026,379.91
負債合計		47,006,456.61	42,095,194.26
<b>淨資產：</b>			
實收基金	6.4.7.7	8,236,615,502.15	8,491,684,471.48
未分配利潤	6.4.7.8	877,036,743.35	1,282,203,919.40
淨資產合計		9,113,652,245.50	9,773,888,390.88
負債和淨資產總計		9,160,658,702.11	9,815,983,585.14

注：報告截止日 2024 年 6 月 30 日，基金份額淨值 1.106 元，基金份額總額 8,236,615,502.15

份。

## 6.2 利潤表

會計主體：華夏回報證券投資基金

本報告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

單位：人民幣元

項目	附注號	本期 2024年1月1日至 2024年6月30日	上年度可比期間 2023年1月1日至2023 年6月30日
一、營業總收入		-308,168,220.39	-217,995,777.38
1.利息收入		1,211,827.88	2,432,129.39
其中：存款利息收入	6.4.7.9	1,093,011.07	1,346,283.02

債券利息收入		-	-
資產支持證券利息收入		-	-
買入返售金融資產收入		118,816.81	1,085,846.37
其他利息收入		-	-
<b>2.投資收益（損失以“-”填列）</b>		<b>-426,114,887.41</b>	<b>89,134,443.04</b>
其中：股票投資收益	6.4.7.10	-548,571,850.82	-38,417,064.31
基金投資收益	6.4.7.11	-	-
債券投資收益	6.4.7.12	22,303,580.30	28,145,669.06
資產支持證券投資收益	6.4.7.13	-	-
貴金屬投資收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	100,153,383.11	99,405,838.29
3.公允價值變動收益（損失以“-”號填列）	6.4.7.17	116,056,867.14	-310,501,362.57
4.匯兌收益（損失以“-”號填列）		-	-
5.其他收入（損失以“-”號填列）	6.4.7.18	677,972.00	939,012.76
<b>減：二、營業總支出</b>		<b>66,000,111.97</b>	<b>103,612,584.37</b>
1.管理人報酬		56,447,353.06	88,579,036.59
2.託管費		9,407,892.20	14,763,172.78
3.銷售服務費		-	-
4.投資顧問費		-	-
5.利息支出		-	114,140.41
其中：賣出回購金融資產支出		-	114,140.41
6.信用減值損失	6.4.7.20	-	-
7.稅金及附加		522.56	1,716.87
8.其他費用	6.4.7.21	144,344.15	154,517.72
<b>三、利潤總額（虧損總額以“-”號填列）</b>		<b>-374,168,332.36</b>	<b>-321,608,361.75</b>
減：所得稅費用		-	-
<b>四、淨利潤（淨虧損以“-”號填列）</b>		<b>-374,168,332.36</b>	<b>-321,608,361.75</b>
<b>五、其他綜合收益的稅後淨額</b>		<b>-</b>	<b>-</b>
<b>六、綜合收益總額</b>		<b>-374,168,332.36</b>	<b>-321,608,361.75</b>

### 6.3 淨資產變動表

會計主體：華夏回報證券投資基金

本報告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

單位：人民幣元

項目	本期		
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		
	實收基金	未分配利潤	淨資產合計

一、上期期末淨資產	8,491,684,471.48	1,282,203,919.40	9,773,888,390.88
二、本期期初淨資產	8,491,684,471.48	1,282,203,919.40	9,773,888,390.88
三、本期增減變動額（減少以“-”號填列）	-255,068,969.33	-405,167,176.05	-660,236,145.38
（一）、綜合收益總額	-	-374,168,332.36	-374,168,332.36
（二）、本期基金份額交易產生的淨資產變動數（淨資產減少以“-”號填列）	-255,068,969.33	-30,998,843.69	-286,067,813.02
其中：1.基金申購款	215,982,013.13	27,932,574.29	243,914,587.42
2.基金贖回款	-471,050,982.46	-58,931,417.98	-529,982,400.44
（三）、本期向基金份額持有人分配利潤產生的淨資產變動（淨資產減少以“-”號填列）	-	-	-
四、本期期末淨資產	8,236,615,502.15	877,036,743.35	9,113,652,245.50
項目	上年度可比期間		
	2023年1月1日至2023年6月30日		
	實收基金	未分配利潤	淨資產合計
一、上期期末淨資產	9,103,914,367.54	2,833,230,022.13	11,937,144,389.67
二、本期期初淨資產	9,103,914,367.54	2,833,230,022.13	11,937,144,389.67
三、本期增減變動額（減少以“-”號填列）	-220,294,671.36	-388,743,247.95	-609,037,919.31
（一）、綜合收益總額	-	-321,608,361.75	-321,608,361.75
（二）、本期基金份額交易產生的淨資產變動數（淨資產減少以“-”號填列）	-220,294,671.36	-67,134,886.20	-287,429,557.56
其中：1.基金申購款	342,748,517.94	111,104,210.34	453,852,728.28

2.基金贖回款	-563,043,189.30	-178,239,096.54	-741,282,285.84
(三)、本期向基金份額持有人分配利潤產生的淨資產變動(淨資產減少以“-”號填列)	-	-	-
四、本期期末淨資產	8,883,619,696.18	2,444,486,774.18	11,328,106,470.36

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：張佑君，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(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

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

#### 6.4.5 會計政策和會計估計變更以及差錯更正的說明

##### 6.4.5.1 會計政策變更的說明

本基金本報告期無會計政策變更。

##### 6.4.5.2 會計估計變更的說明

本基金本報告期無會計估計變更。

##### 6.4.5.3 差錯更正的說明

本基金本報告期無重大會計差錯的內容和更正金額。

#### 6.4.6 稅項

根據財稅[2004]78 號《關於證券投資基金稅收政策的通知》、財稅[2005]103 號《關於股權分置試點改革有關稅收政策問題的通知》、財稅[2008]1 號《關於企業所得稅若干優惠政策的通知》、財稅[2012]85 號《關於實施上市公司股息紅利差別化個人所得稅政策有關問題的通知》、財稅[2014]81 號《關於滬港股票市場交易互聯互通機制試點有關稅收政策的通知》、財稅[2015]101 號《關於上市公司股息紅利差別化個人所得稅政策有關問題的通知》、財稅[2015]125 號《財政部、國家稅務總局、證監會關於內地與香港基金互認有關稅收政策的通知》、財稅[2016]36 號《關於全面推開營業稅改征增值稅試點的通知》、財稅[2016]46 號《財政部、國家稅務總局關於進一步明確全面推開營改增試點金融業有關政策的通知》、財稅[2016]70 號《財政部、國家稅務總局關於金融機構同業往來等增值稅政策的補充通知》、財稅[2016]127 號《財政部國家稅務總局證監會關於深港股票市場交易互聯互通機制試點有關稅收政策的通知》、財稅[2016]140 號《關於明確金融房地產開發 教育輔助服務等增值稅政策的通知》、財稅[2017]2 號《關於資管產品增值稅政策有關問題的補充通知》、財稅[2017]56 號《關於資管產品增值稅有關問題的通知》、財稅[2017]90 號《關於租入固定資產進項稅額抵扣等增值稅政策的通知》、財稅[2023]39 號《關於減半徵收證券交易印花稅的公告》及其他相關財稅法規和實

務操作，主要稅項列示如下：

- (1) 以發行基金方式募集資金不屬於增值稅徵收範圍，不徵收增值稅。
- (2) 資管產品運營過程中發生的增值稅應稅行為，以資管產品管理人為增值稅納稅人。資管產品管理人運營資管產品過程中發生的增值稅應稅行為，暫適用簡易計稅方法，按照 3% 的徵收率繳納增值稅。
- (3) 基金買賣股票、債券的差價收入免徵增值稅，暫不徵收企業所得稅。
- (4) 存款利息收入不徵收增值稅。
- (5) 國債、地方政府債利息收入，金融同業往來利息收入免徵增值稅。
- (6) 對基金取得的債券的利息收入及其他收入，暫不徵收企業所得稅。
- (7) 基金作為流通股股東在股權分置改革過程中收到由非流通股股東支付的股份、現金等對價暫免徵收印花稅、企業所得稅和個人所得稅。
- (8) 對基金在境內取得的股票的股息、紅利收入，由上市公司在向基金派發股息、紅利收入時代扣代繳 20% 的個人所得稅，暫不徵收企業所得稅。基金在境內從上市公司分配取得的股息紅利所得，持股期限在 1 個月以內（含 1 個月）的，全額計入應納稅所得額，持股期限在 1 個月以上至 1 年（含 1 年）的，減按 50% 計入應納稅所得額，持股期限超過 1 年的，暫免徵收個人所得稅。對基金通過滬港通/深港通投資香港聯交所上市 H 股取得的股息紅利，H 股公司應向中國證券登記結算有限責任公司（以下簡稱“中國結算”）提出申請，由中國結算向 H 股公司提供內地個人投資者名冊，H 股公司按照 20% 的稅率代扣個人所得稅。基金通過滬港通/深港通投資香港聯交所上市的非 H 股取得的股息紅利，由中國結算按照 20% 的稅率代扣個人所得稅。對香港市場投資者取得的股息、紅利收入按照 10% 的稅率代扣所得稅。
- (9) 基金在境內賣出股票按 0.1% 的稅率繳納股票交易印花稅，買入股票不徵收股票交易印花稅。基金通過滬港通/深港通買賣、繼承、贈與聯交所上市股票，按照香港特別行政區現行稅法規定繳納印花稅。自 2023 年 8 月 28 日起，證券交易印花稅實施減半徵收。
- (10) 基金在境外證券交易所進行交易或取得的源自境外證券市場的收益，其涉及的稅收政策，按照相關國家或地區稅收法律和法規執行。
- (11) 本基金分別按實際繳納的增值稅額的 7%、3%、2% 繳納城市維護建設稅、教育費附加和地方教育費附加。

#### 6.4.7 重要財務報表項目的說明

##### 6.4.7.1 貨幣資金

單位：人民幣元

項目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	873,943,081.38
等於：本金	873,851,871.35
加：應計利息	91,210.03
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	873,943,081.38

#### 6.4.7.2 交易性金融資產

單位：人民幣元

項目	本期末 2024 年 6 月 30 日				
	成本	應計利息	公允價值	公允價值變動	
股票	7,160,772,958.85	-	6,235,407,703.69	-925,365,255.16	
貴金屬投資-金交所黃金合約	-	-	-	-	
債券	交易所市場	1,000.00	3.62	1,080.12	76.50
	銀行間市場	2,029,604,044.66	14,042,740.34	2,046,577,740.34	2,930,955.34
	合計	2,029,605,044.66	14,042,743.96	2,046,578,820.46	2,931,031.84
資產支持證券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合計	9,190,378,003.51	14,042,743.96	8,281,986,524.15	-922,434,223.32	

#### 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

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 其他資產

無。

#### 6.4.7.6 其他負債

單位：人民幣元

項目	本期末 2024年6月30日
應付券商交易單元保證金	500,000.00
應付贖回費	26,965.47
應付證券出借違約金	-
應付交易費用	13,510,637.36
其中：交易所市場	13,500,779.90
銀行間市場	9,857.46
應付利息	-
預提費用	209,398.38
合計	14,247,001.21

#### 6.4.7.7 實收基金

金額單位：人民幣元

項目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份額（份）	帳面金額
上年度末	8,491,684,471.48	8,491,684,471.48
本期申購	215,982,013.13	215,982,013.13
本期贖回（以“-”號填列）	-471,050,982.46	-471,050,982.46
本期末	8,236,615,502.15	8,236,615,502.15

#### 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
上年度末	-380,977,659.52	1,663,181,578.92	1,282,203,919.40
本期期初	-380,977,659.52	1,663,181,578.92	1,282,203,919.40
本期利潤	-490,225,199.50	116,056,867.14	-374,168,332.36
本期基金份額交易產生的變動數	20,019,454.79	-51,018,298.48	-30,998,843.69
其中：基金申購款	-16,878,477.39	44,811,051.68	27,932,574.29
基金贖回款	36,897,932.18	-95,829,350.16	-58,931,417.98
本期已分配利潤	-	-	-
本期末	-851,183,404.23	1,728,220,147.58	877,036,743.35

#### 6.4.7.9 存款利息收入

單位：人民幣元

項目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
活期存款利息收入	1,068,553.13
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	21,594.15
其他	2,863.79
合計	1,093,011.07

#### 6.4.7.10 股票投資收益

單位：人民幣元

項目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
賣出股票成交總額	2,535,795,169.37
減：賣出股票成本總額	3,078,773,144.34
減：交易費用	5,593,875.85
買賣股票差價收入	-548,571,850.82

#### 6.4.7.11 基金投資收益

無。

#### 6.4.7.12 債券投資收益

##### 6.4.7.12.1 債券投資收益項目構成

單位：人民幣元

項目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
債券投資收益——利息收入	20,178,888.20
債券投資收益——買賣債券（債轉股及債券到期兌付）差價收入	2,124,692.10
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	22,303,580.30

##### 6.4.7.12.2 債券投資收益——買賣債券差價收入

單位：人民幣元

項目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
賣出債券（債轉股及債券到期兌付）成交總額	4,886,153,684.28

減：賣出債券（債轉股及債券到期兌付） 成本總額	4,843,688,949.70
減：應計利息總額	40,308,160.91
減：交易費用	31,881.57
買賣債券差價收入	2,124,692.10

6.4.7.13 資產支持證券投資收益

無。

6.4.7.14 貴金屬投資收益

無。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——買賣權證差價收入

無。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投資收益

無。

6.4.7.16 股利收益

單位：人民幣元

項目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
股票投資產生的股利收益	100,153,383.11
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	100,153,383.11

6.4.7.17 公允價值變動收益

單位：人民幣元

項目名稱	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
1.交易性金融資產	116,056,867.14
——股票投資	115,568,621.20
——債券投資	488,245.94
——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	116,056,867.14

6.4.7.18 其他收入

單位：人民幣元

項目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
基金贖回費收入	677,972.00
合計	677,972.00

6.4.7.19 持有基金產生的費用

無。

6.4.7.20 信用減值損失

無。

6.4.7.21 其他費用

單位：人民幣元

項目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
審計費用	49,726.04
信息披露費	59,672.34
證券出借違約金	-
銀行費用	16,345.77
銀行間帳戶維護費	18,000.00
其他	600.00
合計	144,344.15

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 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期間 2023年1月1日至2023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	1,709,631,093.74	35.63%	4,649,510,024.50	46.67%

##### 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 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期間 2023年1月1日至2023年6月30日	
	成交金額	佔當期債券成交總額的比例	成交金額	佔當期債券成交總額的比例
中信證券	1,867,334.95	21.94%	609,069,768.04	48.58%

##### 6.4.10.1.4 債券回購交易

金額單位：人民幣元

關聯方名稱	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期間 2023年1月1日至2023年6月30日	
	成交金額	佔當期債券回購成交總額的比例	成交金額	佔當期債券回購成交總額的比例
中信證券	-	-	908,258,000.00	100.00%

##### 6.4.10.1.5 基金交易

無。

##### 6.4.10.1.6 應支付關聯方的佣金

金額單位：人民幣元

關聯方名稱	本期
-------	----

	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	當期 佣金	佔當期佣金 總量的比例	期末應付佣金餘額	佔期末應付佣金 總額的比例
中信證券	1,583,680.32	39.41%	1,384,756.49	10.26%
關聯方名稱	上年度可比期間 2023年1月1日至2023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	4,330,060.94	49.84%	1,225,170.67	7.27%

注：上述佣金按市場佣金率計算，以扣除由中國證券登記結算有限責任公司收取證管費、經手費和由券商承擔的證券結算風險基金後的淨額列示。該類佣金協議的服務範圍還包括佣金收取方為本基金提供的證券投資研究成果和市場訊息服務。

#### 6.4.10.2 關聯方報酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理費

單位：人民幣元

項目	本期	上年度可比期間
	2024年1月1日至2024年6月 30日	2023年1月1日至2023年6月30 日
當期發生的基金應支付的管理費	56,447,353.06	88,579,036.59
其中：應支付銷售機構的客戶維護費	13,677,031.57	21,473,858.22
應支付基金管理人的淨管理費	42,770,321.49	67,105,178.37

注：①支付基金管理人的基金管理人報酬按前一日基金資產淨值 1.20%的年費率計提，逐日累計至每月月底，按月支付。

②基金管理人報酬計算公式為：日基金管理人報酬=前一日基金資產淨值×1.20%/當年天數。

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

##### 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
	2024年1月1日至2024年6月 30日	2023年1月1日至2023年6月30 日
當期發生的基金應支付的託管費	9,407,892.20	14,763,172.78

注：①支付基金託管人的基金託管費按前一日基金資產淨值 0.20%的年費率計提，逐日累計至每月月底，按月支付。

②基金託管費計算公式為：日基金託管費=前一日基金資產淨值×0.20%/當年天數。

6.4.10.2.3 銷售服務費

無。

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 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期間 2023年1月1日至2023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	873,943,081.38	1,068,553.13	241,418,877.74	1,263,044.09

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

6.4.10.7 本基金在承銷期內參與關聯方承銷證券的情況

金額單位：人民幣元

本期 2024年1月1日至2024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	601033	永興股份	新股發行	12,577	203,747.40
中信證券	688584	上海合晶	新股發行	8,659	196,212.94
中信證券	001359	平安電工	新股發行	1,833	31,875.87
上年度可比期間 2023年1月1日至2023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	688343	雲天勵飛	新股發行	24,961	1,096,287.12
中信證券	688146	中船特氣	新股發行	10,101	365,151.15
中信證券	001286	陝西能源	新股發行	37,667	361,603.20
中信證券	688581	安傑思	新股發行	1,629	204,928.20
中信證券	688539	高華科技	新股發行	5,334	203,865.48
中信證券	688522	納睿雷達	新股發行	4,299	200,677.32
中信證券	301439	泓淋電力	新股發行	9,486	189,625.14
中信證券	688523	航太環宇	新股發行	4,717	103,113.62
中信證券	301293	三博腦科	新股發行	3,324	98,390.40
中信證券	301323	新萊福	新股發行	2,277	88,939.62
中信證券	688631	萊斯信息	新股發行	3,357	84,864.96
中信證券	301170	錫南科技	新股發行	2,496	84,864.00
中信證券	301157	華塑科技	新股發行	1,498	84,637.00
中信證券	601133	柏誠股份	新股發行	6,632	77,329.12
中信證券	301261	恒工精密	新股發行	1,973	72,803.70
中信證券	603281	江瀚新材	新股發行	863	30,714.17
中信證券	001367	海森藥業	新股發行	549	24,419.52
中信證券	001324	長青科技	新股發行	1,131	21,353.28
中信證券	603162	海通發展	新股發行	523	19,481.75

#### 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（2024 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
688717	艾羅能源	2023-12-26	6 個月	新發流通受限	55.66	47.02	11,303	629,124.98	531,467.06	-
301589	諾瓦星雲	2024-02-01	6 個月	新發流通受限	126.89	188.01	1,244	87,680.99	233,884.44	含證券

										送配
688692	達夢數據	2024-06-04	6 個月	新發流通受限	86.96	174.93	175	15,218.00	30,612.75	-
603285	鏈邦股份	2024-06-28	1 個月內 (含)	新發流通受限	18.65	18.65	1,158	21,596.70	21,596.70	-
601033	永興股份	2024-01-11	6 個月	新發流通受限	16.20	15.96	1,258	20,379.60	20,077.68	-
603350	安乃達	2024-06-26	1 個月內 (含)	新發流通受限	20.56	20.56	945	19,429.20	19,429.20	-
301536	星宸科技	2024-03-20	6 個月	新發流通受限	16.16	32.27	481	7,772.96	15,521.87	-
688584	上海合晶	2024-02-01	6 個月	新發流通受限	22.66	15.89	866	19,623.56	13,760.74	-
301538	駿鼎達	2024-03-13	6 個月	新發流通受限	55.82	91.24	150	5,972.74	13,686.00	含證券送配
301565	中倫新材	2024-06-13	6 個月	新發流通受限	11.88	18.98	711	8,446.68	13,494.78	-
603341	龍旗科技	2024-02-23	6 個月	新發流通受限	26.00	37.49	298	7,748.00	11,172.02	-
688691	燦芯股份	2024-04-02	6 個月	新發流通受限	19.86	42.51	247	4,905.42	10,499.97	-
301566	達利凱普	2023-12-22	6 個月	新發流通受限	8.90	16.97	576	5,126.40	9,774.72	-
301392	匯成真空	2024-05-28	6 個月	新發流通受限	12.20	41.66	219	2,671.80	9,123.54	-
301591	肯特股份	2024-02-20	6 個月	新發流通受限	19.43	36.98	219	4,255.17	8,098.62	-
301587	中瑞	2024-	6 個月	新發	21.73	25.26	306	6,649.38	7,729.56	-

	股份	03-27		流通 受限						
001389	廣合 科技	2024- 03-26	6 個月	新發 流通 受限	17.43	34.56	222	3,869.46	7,672.32	-
301539	宏鑫 科技	2024- 04-03	6 個月	新發 流通 受限	10.64	19.82	361	3,841.04	7,155.02	-
688695	中創 股份	2024- 03-06	6 個月	新發 流通 受限	22.43	31.55	186	4,171.98	5,868.30	-
688530	歐萊 新材	2024- 04-29	6 個月	新發 流通 受限	9.60	16.10	344	3,302.40	5,538.40	-
301588	美新 科技	2024- 03-06	6 個月	新發 流通 受限	14.50	21.25	257	3,726.50	5,461.25	-
301502	華陽 智能	2024- 01-26	6 個月	新發 流通 受限	28.01	37.83	138	3,865.38	5,220.54	-
603325	博隆 技術	2024- 01-03	6 個月	新發 流通 受限	72.46	68.06	66	4,782.36	4,491.96	-
603381	永臻 股份	2024- 06-19	6 個月	新發 流通 受限	23.35	25.13	178	4,156.30	4,473.14	-
001359	平安 電工	2024- 03-19	6 個月	新發 流通 受限	17.39	20.60	184	3,199.76	3,790.40	-
603312	西典 新能	2024- 01-04	6 個月	新發 流通 受限	29.02	25.36	130	3,772.60	3,296.80	-
603082	北自 科技	2024- 01-23	6 個月	新發 流通 受限	21.28	29.49	107	2,276.96	3,155.43	-
001379	騰達 科技	2024- 01-11	6 個月	新發 流通 受限	16.98	13.48	213	3,616.74	2,871.24	-
603375	盛景 微	2024- 01-17	6 個月	新發 流通 受限	38.18	38.90	72	2,748.96	2,800.80	-
603285	鍵邦 股份	2024- 06-28	6 個月	新發 流通 受限	18.65	18.65	129	2,405.85	2,405.85	-

603350	安乃達	2024-06-26	6 個月	新發 流通 受限	20.56	20.56	106	2,179.36	2,179.36	-
--------	-----	------------	------	----------------	-------	-------	-----	----------	----------	---

注：①根據中國證監會《上市公司證券發行註冊管理辦法》，基金參與上市公司向特定物件發行股票所獲得的股票，自發行結束之日起 6 個月內不得轉讓。

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

③根據《上海證券交易所科創板上市公司股東以向特定機構投資者詢價轉讓和配售方式減持股份實施細則》，基金通過詢價轉讓受讓的股份，在受讓後 6 個月內不得轉讓。

④基金可使用以基金名義開設的股票帳戶，選擇網上或者網下一種方式進行新股申購。其中基金參與網下申購獲得的設定限售期的新股或作為戰略投資者參與配售獲得的新股，在新股上市後的約定期限內不能自由轉讓；基金參與網上申購獲配的新股，從新股獲配日至新股上市日之間不能自由轉讓。

#### 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數據，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 2024 年 6 月 30 日	1 年以內	1-5 年	5 年以上	合計
貨幣資金	873,943,081.38	-	-	873,943,081.38
結算備付金	2,368,301.68	-	-	2,368,301.68
結算保證金	478,007.55	-	-	478,007.55
債券投資	1,976,140,812.24	70,438,008.22	-	2,046,578,820.46
資產支持證券	-	-	-	-
買入返售金融資產	-	-	-	-
應收直銷申購款	-	-	-	-
賣出回購金融資產款	-	-	-	-
上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 年以內	1-5 年	5 年以上	合計
貨幣資金	822,298,990.60	-	-	822,298,990.60
結算備付金	2,025,719.16	-	-	2,025,719.16
結算保證金	286,587.91	-	-	286,587.91
債券投資	1,867,845,487.31	184,101,147.54	-	2,051,946,634.85
資產支持證券	-	-	-	-
買入返售金融資產	-	-	-	-
應收直銷申購款	-	-	-	-
賣出回購金融資產款	-	-	-	-

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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
	利率下降 25 個基點	3,007,550.38	2,231,699.14
	利率上升 25 個基點	-2,995,552.52	-2,225,199.71

#### 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 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 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	6,235,407,703.69	68.42	6,934,199,278.46	70.95
交易性金融資產－基金投資	-	-	-	-
交易性金融資產－債券投資	1,080.12	0.00	8,824,712.97	0.09
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	6,235,408,783.81	68.42	6,943,023,991.43	71.04

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由於四餘五入的原因，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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
	-5%	-370,286,730.90	-351,850,466.14
+5%	370,286,730.90	351,850,466.14	

#### 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 2024 年 6 月 30 日
第一層次	6,234,382,248.07
第二層次	2,046,623,351.45
第三層次	980,924.63
合計	8,281,986,524.15

##### 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。本基金政策以導致各層次之間轉換的事項發生日作為確定金融工具公允價值層次之間轉換的時點。

##### 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 2024 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	6,235,407,703.69	68.07
	其中：股票	6,235,407,703.69	68.07

2	基金投資	-	-
3	固定收益投資	2,046,578,820.46	22.34
	其中：債券	2,046,578,820.46	22.34
	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	876,311,383.06	9.57
8	其他各項資產	2,360,794.90	0.03
9	合計	9,160,658,702.11	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	-	-
B	採礦業	45,772,152.86	0.50
C	製造業	4,287,569,168.69	47.05
D	電力、熱力、燃氣及水生產和供應業	6,236,544.00	0.07
E	建築業	175,620,709.80	1.93
F	批發和零售業	10,331,739.90	0.11
G	交通運輸、倉儲和郵政業	-	-
H	住宿和餐飲業	-	-
I	信息傳輸、軟件和信息技術服務業	25,783,713.83	0.28
J	金融業	761,227,249.31	8.35
K	房地產業	764,249,324.16	8.39
L	租賃和商務服務業	31,292,773.90	0.34
M	科學研究和技術服務業	94,941,247.56	1.04
N	水利、環境和公共設施管理業	30,967.68	0.00
O	居民服務、修理和其他服務業	-	-
P	教育	-	-
Q	衛生和社會工作	32,352,112.00	0.35
R	文化、體育和娛樂業	-	-
S	綜合	-	-
	合計	6,235,407,703.69	68.42

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

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	488,164	716,326,971.96	7.86
2	600048	保利發展	73,464,445	643,548,538.20	7.06
3	300750	寧德時代	3,162,620	569,366,478.60	6.25
4	600926	杭州銀行	25,991,178	339,184,872.90	3.72
5	600276	恒瑞醫藥	7,618,202	292,996,048.92	3.21
6	601668	中國建築	33,073,580	175,620,709.80	1.93
7	600919	江蘇銀行	23,457,735	174,290,971.05	1.91
8	600862	中航高科	7,258,831	136,320,846.18	1.50
9	600557	康緣藥業	8,499,440	133,441,208.00	1.46
10	600809	山西汾酒	622,560	131,285,452.80	1.44
11	002572	索菲亞	7,813,900	119,787,087.00	1.31
12	600522	中天科技	7,491,740	118,744,079.00	1.30
13	603816	顧家家居	3,468,972	112,013,105.88	1.23
14	300628	億聯網絡	2,903,084	106,746,398.68	1.17
15	002043	兔寶寶	10,129,871	105,046,762.27	1.15
16	002142	寧波銀行	4,718,014	104,079,388.84	1.14
17	000999	華潤三九	2,216,864	94,394,069.12	1.04
18	002371	北方華創	295,014	94,372,028.46	1.04
19	002179	中航光電	2,357,091	89,687,312.55	0.98
20	300760	邁瑞醫療	307,377	89,419,043.07	0.98
21	002594	比亞迪	355,680	89,008,920.00	0.98
22	300274	陽光電源	1,382,235	85,740,037.05	0.94
23	300034	鋼研高納	5,201,140	82,646,114.60	0.91
24	603369	今世緣	1,776,111	82,056,328.20	0.90
25	000596	古井貢酒	375,154	79,183,754.78	0.87
26	002966	蘇州銀行	9,938,676	74,540,070.00	0.82
27	000738	航發控制	3,608,059	72,413,744.13	0.79
28	688012	中微公司	499,726	70,591,294.76	0.77
29	688120	華海清科	284,280	53,893,802.40	0.59
30	600007	中國國貿	2,435,300	53,479,188.00	0.59
31	300724	捷佳偉創	962,639	51,992,132.39	0.57
32	603198	迎駕貢酒	876,952	50,424,740.00	0.55
33	001914	招商積餘	5,029,108	50,391,662.16	0.55
34	688235	百濟神州	415,892	48,176,929.28	0.53
35	002025	航太電器	948,451	43,989,157.38	0.48
36	603833	歐派家居	714,244	38,254,908.64	0.42
37	300347	泰格醫藥	750,700	36,484,020.00	0.40
38	300073	當升科技	1,032,617	35,429,089.27	0.39
39	600887	伊利股份	1,344,200	34,734,128.00	0.38
40	002436	興森科技	3,193,458	32,956,486.56	0.36
41	600153	建發股份	3,504,230	31,292,773.90	0.34
42	601088	中國神華	703,400	31,209,858.00	0.34
43	600559	老白乾酒	1,679,200	30,527,856.00	0.33

44	300759	康龍化成	1,480,601	27,509,566.58	0.30
45	600893	航發動力	733,800	26,820,390.00	0.29
46	000858	五糧液	193,100	24,724,524.00	0.27
47	300014	億緯鋰能	563,800	22,506,896.00	0.25
48	688266	澤璟製藥	398,639	21,614,206.58	0.24
49	300395	菲利華	700,117	21,528,597.75	0.24
50	688382	益方生物	2,933,024	21,205,763.52	0.23
51	601577	長沙銀行	2,452,200	20,058,996.00	0.22
52	688062	邁威生物	625,861	18,112,417.34	0.20
53	300015	愛爾眼科	1,697,900	17,522,328.00	0.19
54	603848	好太太	1,379,700	17,370,423.00	0.19
55	600535	天士力	1,364,995	17,171,637.10	0.19
56	601939	建設銀行	2,316,400	17,141,360.00	0.19
57	301333	諾思格	481,180	16,172,459.80	0.18
58	688506	百利天恒	88,624	16,076,393.60	0.18
59	603801	志邦家居	1,163,320	15,216,225.60	0.17
60	002415	海康威視	492,066	15,209,760.06	0.17
61	600546	山煤國際	996,053	14,562,294.86	0.16
62	002475	立訊精密	369,861	14,539,235.91	0.16
63	688443	智翔金泰	480,759	14,297,772.66	0.16
64	603027	千禾味業	1,061,100	14,112,630.00	0.15
65	000736	中交地產	1,585,800	14,081,904.00	0.15
66	000516	國際醫學	2,917,800	13,655,304.00	0.15
67	002230	科大訊飛	308,400	13,245,780.00	0.15
68	002422	科倫藥業	423,700	12,850,821.00	0.14
69	601825	滬農商行	1,662,751	11,173,686.72	0.12
70	300723	一品紅	538,100	10,573,665.00	0.12
71	002920	德賽西威	118,300	10,302,747.00	0.11
72	301257	普蕊斯	329,160	9,298,770.00	0.10
73	600036	招商銀行	269,800	9,224,462.00	0.10
74	600566	濟川藥業	268,300	8,507,793.00	0.09
75	688336	三生國健	386,628	7,867,879.80	0.09
76	601689	拓普集團	122,500	6,567,225.00	0.07
77	688351	微電生理	297,642	6,560,029.68	0.07
78	600905	三峽能源	1,430,400	6,236,544.00	0.07
79	300661	聖邦股份	75,157	6,221,496.46	0.07
80	002738	中礦資源	230,200	6,169,360.00	0.07
81	300308	中際旭創	41,160	5,675,140.80	0.06
82	603127	昭衍新藥	375,534	4,983,336.18	0.05
83	601838	成都銀行	310,500	4,716,495.00	0.05
84	688197	首藥控股	106,788	4,662,364.08	0.05
85	601077	渝農商行	915,300	4,594,806.00	0.05
86	603233	大參林	318,727	4,557,796.10	0.05

87	600941	中國移動	41,220	4,431,150.00	0.05
88	603939	益豐藥房	150,096	3,684,856.80	0.04
89	688488	艾迪藥業	337,797	3,452,285.34	0.04
90	603998	方盛製藥	325,200	3,339,804.00	0.04
91	688111	金山辦公	13,990	3,182,725.00	0.03
92	300832	新產業	38,800	2,616,672.00	0.03
93	688256	寒武紀	11,663	2,317,088.21	0.03
94	603659	璞泰來	138,200	1,952,766.00	0.02
95	300558	貝達藥業	58,621	1,908,113.55	0.02
96	001979	招商蛇口	215,220	1,891,783.80	0.02
97	300059	東方財富	136,405	1,440,436.80	0.02
98	300181	佐力藥業	91,900	1,389,528.00	0.02
99	000963	華東醫藥	47,700	1,326,537.00	0.01
100	688658	悅康藥業	57,363	1,023,355.92	0.01
101	300765	新諾威	36,120	911,307.60	0.01
102	000977	浪潮信息	23,200	843,784.00	0.01
103	601318	中國平安	18,900	781,704.00	0.01
104	300413	芒果超媒	37,270	778,943.00	0.01
105	000568	瀘州老窖	5,400	774,846.00	0.01
106	600976	健民集團	15,100	762,550.00	0.01
107	002262	恩華藥業	31,900	757,306.00	0.01
108	603506	南都物業	89,300	748,334.00	0.01
109	603606	東方電纜	12,800	624,768.00	0.01
110	300990	同飛股份	22,100	621,231.00	0.01
111	688503	聚和材料	21,786	612,186.60	0.01
112	600602	雲賽智聯	53,000	585,120.00	0.01
113	300782	卓勝微	7,200	559,728.00	0.01
114	301239	普瑞眼科	15,800	558,214.00	0.01
115	301267	華廈眼科	26,550	550,116.00	0.01
116	688331	榮昌生物	12,369	534,340.80	0.01
117	688717	艾羅能源	11,303	531,467.06	0.01
118	002756	永興材料	13,900	497,342.00	0.01
119	688238	和元生物	106,500	493,095.00	0.01
120	002271	東方雨虹	37,810	466,575.40	0.01
121	300454	深信服	9,200	464,876.00	0.01
122	600771	廣譽遠	24,100	453,803.00	0.00
123	603039	泛微網絡	13,600	431,936.00	0.00
124	002850	科達利	5,344	408,174.72	0.00
125	301050	雷電微力	8,400	404,544.00	0.00
126	002409	雅克科技	6,200	390,042.00	0.00
127	002812	恩捷股份	11,210	354,796.50	0.00
128	688236	春立醫療	22,030	312,385.40	0.00
129	603927	中科軟	16,048	290,308.32	0.00

130	688428	諾誠健華	34,472	279,567.92	0.00
131	600129	太極集團	9,198	266,006.16	0.00
132	002709	天賜材料	14,740	258,834.40	0.00
133	301589	諾瓦星雲	1,244	233,884.44	0.00
134	603486	科沃斯	4,800	226,464.00	0.00
135	603501	韋爾股份	2,200	218,614.00	0.00
136	300373	揚傑科技	4,800	186,720.00	0.00
137	002603	以嶺藥業	11,215	171,925.95	0.00
138	601058	賽輪輪胎	10,000	140,000.00	0.00
139	002648	衛星化學	6,600	118,668.00	0.00
140	603197	保隆科技	3,595	113,242.50	0.00
141	600161	天壇生物	4,535	110,654.00	0.00
142	301360	榮旗科技	2,540	109,855.00	0.00
143	603650	彤程新材	3,300	97,515.00	0.00
144	000513	麗珠集團	2,243	83,462.03	0.00
145	688085	三友醫療	4,748	80,241.20	0.00
146	603806	福斯特	4,900	72,030.00	0.00
147	002901	大博醫療	2,700	69,741.00	0.00
148	600266	城建發展	18,600	69,564.00	0.00
149	002044	美年健康	17,500	66,150.00	0.00
150	001301	尚太科技	1,200	51,864.00	0.00
151	688117	聖諾生物	2,060	50,552.40	0.00
152	603711	香飄飄	3,500	48,475.00	0.00
153	603456	九洲藥業	3,400	46,648.00	0.00
154	603296	華勤技術	830	45,840.90	0.00
155	600211	西藏藥業	1,300	42,354.00	0.00
156	600325	華發股份	5,900	38,350.00	0.00
157	688692	達夢數據	175	30,612.75	0.00
158	603285	鏈邦股份	1,287	24,002.55	0.00
159	603350	安乃達	1,051	21,608.56	0.00
160	001311	多利科技	844	20,407.92	0.00
161	601033	永興股份	1,258	20,077.68	0.00
162	688082	盛美上海	212	17,916.12	0.00
163	301303	真蘭儀錶	1,481	17,061.12	0.00
164	301536	星辰科技	481	15,521.87	0.00
165	688584	上海合晶	866	13,760.74	0.00
166	301538	駿鼎達	150	13,686.00	0.00
167	301565	中倫新材	711	13,494.78	0.00
168	603341	龍旗科技	298	11,172.02	0.00
169	000888	峨眉山 A	1,000	10,890.00	0.00
170	688691	燦芯股份	247	10,499.97	0.00
171	301566	達利凱普	576	9,774.72	0.00
172	301392	匯成真空	219	9,123.54	0.00

173	301591	肯特股份	219	8,098.62	0.00
174	688031	星環科技	217	7,966.07	0.00
175	301587	中瑞股份	306	7,729.56	0.00
176	001389	廣合科技	222	7,672.32	0.00
177	301429	森泰股份	499	7,634.70	0.00
178	301539	宏鑫科技	361	7,155.02	0.00
179	688695	中創股份	186	5,868.30	0.00
180	688530	歐萊新材	344	5,538.40	0.00
181	301588	美新科技	257	5,461.25	0.00
182	301502	華陽智能	138	5,220.54	0.00
183	603325	博隆技術	66	4,491.96	0.00
184	603381	永臻股份	178	4,473.14	0.00
185	001359	平安電工	184	3,790.40	0.00
186	603312	西典新能	130	3,296.80	0.00
187	603082	北自科技	107	3,155.43	0.00
188	001379	騰達科技	213	2,871.24	0.00
189	603375	盛景微	72	2,800.80	0.00
190	688352	頤中科技	242	2,761.22	0.00
191	688339	億華通	53	1,588.94	0.00
192	603712	七一二	64	1,164.16	0.00
193	688023	安恒信息	21	840.21	0.00
194	688200	華峰測控	4	367.00	0.00
195	688180	君實生物	11	319.55	0.00
196	688121	卓然股份	2	24.04	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	600809	山西汾酒	166,918,079.63	1.71
2	600048	保利發展	149,397,301.43	1.53
3	600919	江蘇銀行	118,578,673.28	1.21
4	002043	兔寶寶	108,407,179.61	1.11
5	600557	康緣藥業	104,503,080.58	1.07
6	600276	恒瑞醫藥	97,968,075.04	1.00
7	001914	招商積餘	70,904,448.00	0.73
8	002966	蘇州銀行	70,381,804.42	0.72
9	002466	天齊鋰業	66,625,436.05	0.68
10	300274	陽光電源	61,451,665.94	0.63
11	002572	索菲亞	58,037,375.00	0.59
12	603198	迎駕貢酒	51,643,453.92	0.53
13	300759	康龍化成	47,210,733.42	0.48

14	688506	百利天恒	46,974,162.86	0.48
15	000516	國際醫學	44,483,641.00	0.46
16	603816	顧家家居	44,027,887.00	0.45
17	300347	泰格醫藥	42,576,642.86	0.44
18	688120	華海清科	42,187,400.91	0.43
19	688382	益方生物	37,855,425.42	0.39
20	002262	恩華藥業	37,494,682.06	0.38

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	601668	中國建築	208,332,399.40	2.13
2	600048	保利發展	177,416,051.64	1.82
3	600919	江蘇銀行	110,966,860.80	1.14
4	300059	東方財富	102,530,669.02	1.05
5	600519	貴州茅台	96,907,324.00	0.99
6	603259	藥明康德	71,601,580.83	0.73
7	603105	芯能科技	59,594,233.52	0.61
8	000568	瀘州老窖	57,692,746.89	0.59
9	001979	招商蛇口	56,403,166.00	0.58
10	300760	邁瑞醫療	54,638,512.86	0.56
11	688506	百利天恒	53,647,650.05	0.55
12	000516	國際醫學	53,268,895.00	0.55
13	002262	恩華藥業	52,843,600.00	0.54
14	600085	同仁堂	47,549,901.23	0.49
15	600862	中航高科	47,427,648.98	0.49
16	002466	天齊鋰業	46,386,058.91	0.47
17	002025	航太電器	45,483,801.00	0.47
18	002179	中航光電	43,621,188.69	0.45
19	600522	中天科技	37,759,711.00	0.39
20	688012	中微公司	32,694,891.05	0.33

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	2,264,412,948.37
賣出股票收入（成交）總額	2,535,795,169.37

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	349,712,519.23	3.84
2	央行票據	-	-
3	金融債券	1,696,865,221.11	18.62
	其中：政策性金融債	1,626,427,212.89	17.85
4	企業債券	-	-
5	企業短期融資券	-	-
6	中期票據	-	-
7	可轉債（可交換債）	1,080.12	0.00
8	同業存單	-	-
9	其他	-	-
10	合計	2,046,578,820.46	22.46

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	240301	24 進出 01	10,800,000	1,091,769,639.34	11.98
2	240401	24 農發 01	3,500,000	352,365,655.74	3.87
3	249922	24 貼現國債 22	3,000,000	299,776,153.85	3.29
4	2202002QF	22 國開綠債 02 清發	1,800,000	182,291,917.81	2.00
5	212400004	24 光大銀行小微債	700,000	70,438,008.22	0.77

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 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	478,007.55
2	應收清算款	6,130.24
3	應收股利	-
4	應收利息	-
5	應收申購款	1,876,657.11
6	其他應收款	-
7	待攤費用	-
8	其他	-
9	合計	2,360,794.90

#### 7.12.4 期末持有的處於轉股期的可轉換債券明細

金額單位：人民幣元

序號	債券代碼	債券名稱	公允價值	佔基金資產淨值比例 (%)
1	113655	歐 22 轉債	1,080.12	0.00

#### 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

由於四餘五入的原因，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
870,849	9,458.14	36,479,960.48	0.44%	8,200,135,541.67	99.56%

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	3,516,777.75	0.04%

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	>100

## §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	8,491,684,471.48
本報告期基金總申購份額	215,982,013.13
減：本報告期基金總贖回份額	471,050,982.46
本報告期基金拆分變動份額	-
本報告期期末基金份額總額	8,236,615,502.15

## §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，本基金管理人未發生重大人事變動。

本報告期內，經中國銀行股份有限公司研究決定，郭德秋先生不再擔任中國銀行股份有限公司託管業務部總經理職務。上述人事變動已按相關規定備案、公告。

10.3 涉及基金管理人、基金財產、基金託管業務的訴訟

本報告期未發生影響基金管理人經營或基金運營業務的訴訟。

本報告期無涉及基金財產、基金託管業務的訴訟。

#### 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

##### 10.6.1 管理人及其高級管理人員受稽查或處罰等情況

本基金管理人及其高級管理人員在本報告期內無受稽查或處罰等情況。

##### 10.6.2 託管人及其高級管理人員受稽查或處罰等情況

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

#### 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	
中信證券	4	1,709,631,093.74	35.63%	1,583,680.32	39.41%	-
興業證券	2	626,032,078.82	13.05%	516,836.01	12.86%	-
中天證券	1	532,317,600.39	11.09%	393,841.03	9.80%	-
長江證券	2	318,275,913.34	6.63%	143,224.19	3.56%	-
中國銀河證券	1	306,894,885.99	6.40%	290,289.68	7.22%	-
德邦證券	1	271,803,930.23	5.66%	202,740.94	5.05%	-
恒泰證券	1	266,479,232.98	5.55%	198,769.89	4.95%	-
廣發證券	2	247,306,011.96	5.15%	233,925.27	5.82%	-
國泰君安證券	1	229,735,300.97	4.79%	217,306.72	5.41%	-
西部證券	1	111,425,600.72	2.32%	83,111.89	2.07%	-
海通證券	2	107,118,047.80	2.23%	101,323.32	2.52%	-
國都證券	1	71,459,996.67	1.49%	53,302.56	1.33%	-

注：①為了貫徹中國證監會的有關規定，我公司制定了選擇券商的標準，即：

- i 經營行為規範。
- ii 公司財務狀況良好。
- iii 有良好的內控制度，在業內有良好的聲譽。

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

v 建立了廣泛的信息網絡，能及時提供準確的信息資訊和服務。

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，本基金還選擇了財通證券、川財證券、東方證券、國投證券、瑞銀證券、申萬宏源證券、西南證券、信達證券、招商證券、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
中信證券	1,867,334.95	21.94%	-	-	-	-	-	-
興業證券	-	-	-	-	-	-	-	-
中天證券	-	-	-	-	-	-	-	-
長江證券	6,642,837.18	78.06%	-	-	-	-	-	-
中國銀河證券	-	-	-	-	-	-	-	-
德邦證券	-	-	-	-	-	-	-	-
恒泰證券	-	-	-	-	-	-	-	-
廣發證券	-	-	-	-	-	-	-	-
國泰君安	-	-	-	-	-	-	-	-

證券								
西部證券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通證券	-	-	-	-	-	-	-	-
國都證券	-	-	-	-	-	-	-	-

### 10.8 其他重大事件

序號	公告事項	法定披露方式	法定披露日期
1	華夏基金管理有限公司關於旗下基金投資關聯方承銷證券的公告	中國證監會指定報刊及網站	2024-02-03
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	2024-03-21

## §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，投資者可於合理時間內取得備查文件的複製件或複印本。

## §13 補充披露

補充披露 1：期末基金資產組合情況

名稱	數量（股）	公允價值（人民幣元）
<b>(1) 股票投資</b>		
上市投資		
中國(100%)		
貴州茅台	488,164	716,326,971.96
保利發展	73,464,445	643,548,538.20
寧德時代	3,162,620	569,366,478.60
杭州銀行	25,991,178	339,184,872.90
恒瑞醫藥	7,618,202	292,996,048.92
中國建築	33,073,580	175,620,709.80
江蘇銀行	23,457,735	174,290,971.05
中航高科	7,258,831	136,320,846.18
康緣藥業	8,499,440	133,441,208.00
山西汾酒	622,560	131,285,452.80
索菲亞	7,813,900	119,787,087.00
中天科技	7,491,740	118,744,079.00
顧家家居	3,468,972	112,013,105.88
億聯網絡	2,903,084	106,746,398.68
兔寶寶	10,129,871	105,046,762.27
寧波銀行	4,718,014	104,079,388.84
華潤三九	2,216,864	94,394,069.12
北方華創	295,014	94,372,028.46
中航光電	2,357,091	89,687,312.55
邁瑞醫療	307,377	89,419,043.07
比亞迪	355,680	89,008,920.00
陽光電源	1,382,235	85,740,037.05
鋼研高納	5,201,140	82,646,114.60
今世緣	1,776,111	82,056,328.20
古井貢酒	375,154	79,183,754.78
蘇州銀行	9,938,676	74,540,070.00
航發控制	3,608,059	72,413,744.13
中微公司	499,726	70,591,294.76
華海清科	284,280	53,893,802.40
中國國貿	2,435,300	53,479,188.00
捷佳偉創	962,639	51,992,132.39
迎駕貢酒	876,952	50,424,740.00
招商積餘	5,029,108	50,391,662.16
百濟神州	415,892	48,176,929.28
航太電器	948,451	43,989,157.38

歐派家居	714,244	38,254,908.64
泰格醫藥	750,700	36,484,020.00
當升科技	1,032,617	35,429,089.27
伊利股份	1,344,200	34,734,128.00
興森科技	3,193,458	32,956,486.56
建發股份	3,504,230	31,292,773.90
中國神華	703,400	31,209,858.00
老白乾酒	1,679,200	30,527,856.00
康龍化成	1,480,601	27,509,566.58
航發動力	733,800	26,820,390.00
五糧液	193,100	24,724,524.00
億緯鋰能	563,800	22,506,896.00
澤璟製藥	398,639	21,614,206.58
菲利華	700,117	21,528,597.75
益方生物	2,933,024	21,205,763.52
長沙銀行	2,452,200	20,058,996.00
邁威生物	625,861	18,112,417.34
愛爾眼科	1,697,900	17,522,328.00
好太太	1,379,700	17,370,423.00
天士力	1,364,995	17,171,637.10
建設銀行	2,316,400	17,141,360.00
諾思格	481,180	16,172,459.80
百利天恒	88,624	16,076,393.60
志邦家居	1,163,320	15,216,225.60
海康威視	492,066	15,209,760.06
山煤國際	996,053	14,562,294.86
立訊精密	369,861	14,539,235.91
智翔金泰	480,759	14,297,772.66
千禾味業	1,061,100	14,112,630.00
中交地產	1,585,800	14,081,904.00
國際醫學	2,917,800	13,655,304.00
科大訊飛	308,400	13,245,780.00
科倫藥業	423,700	12,850,821.00
滬農商行	1,662,751	11,173,686.72
一品紅	538,100	10,573,665.00
德賽西威	118,300	10,302,747.00
普蕊斯	329,160	9,298,770.00
招商銀行	269,800	9,224,462.00
濟川藥業	268,300	8,507,793.00
三生國健	386,628	7,867,879.80
拓普集團	122,500	6,567,225.00
微電生理	297,642	6,560,029.68
三峽能源	1,430,400	6,236,544.00

聖邦股份	75,157	6,221,496.46
中礦資源	230,200	6,169,360.00
中際旭創	41,160	5,675,140.80
昭衍新藥	375,534	4,983,336.18
成都銀行	310,500	4,716,495.00
首藥控股	106,788	4,662,364.08
渝農商行	915,300	4,594,806.00
大參林	318,727	4,557,796.10
中國移動	41,220	4,431,150.00
益豐藥房	150,096	3,684,856.80
艾迪藥業	337,797	3,452,285.34
方盛製藥	325,200	3,339,804.00
金山辦公	13,990	3,182,725.00
新產業	38,800	2,616,672.00
寒武紀	11,663	2,317,088.21
璞泰來	138,200	1,952,766.00
貝達藥業	58,621	1,908,113.55
招商蛇口	215,220	1,891,783.80
東方財富	136,405	1,440,436.80
佐力藥業	91,900	1,389,528.00
華東醫藥	47,700	1,326,537.00
悅康藥業	57,363	1,023,355.92
新諾威	36,120	911,307.60
浪潮信息	23,200	843,784.00
中國平安	18,900	781,704.00
芒果超媒	37,270	778,943.00
瀘州老窖	5,400	774,846.00
健民集團	15,100	762,550.00
恩華藥業	31,900	757,306.00
南都物業	89,300	748,334.00
東方電纜	12,800	624,768.00
同飛股份	22,100	621,231.00
聚和材料	21,786	612,186.60
雲賽智聯	53,000	585,120.00
卓勝微	7,200	559,728.00
普瑞眼科	15,800	558,214.00
華廈眼科	26,550	550,116.00
榮昌生物	12,369	534,340.80
艾羅能源	11,303	531,467.06
永興材料	13,900	497,342.00
和元生物	106,500	493,095.00
東方雨虹	37,810	466,575.40
深信服	9,200	464,876.00

廣譽遠	24,100	453,803.00
泛微網絡	13,600	431,936.00
科達利	5,344	408,174.72
雷電微力	8,400	404,544.00
雅克科技	6,200	390,042.00
恩捷股份	11,210	354,796.50
春立醫療	22,030	312,385.40
中科軟	16,048	290,308.32
諾誠健華	34,472	279,567.92
太極集團	9,198	266,006.16
天賜材料	14,740	258,834.40
諾瓦星雲	1,244	233,884.44
科沃斯	4,800	226,464.00
韋爾股份	2,200	218,614.00
揚傑科技	4,800	186,720.00
以嶺藥業	11,215	171,925.95
賽輪輪胎	10,000	140,000.00
衛星化學	6,600	118,668.00
保隆科技	3,595	113,242.50
天壇生物	4,535	110,654.00
榮旗科技	2,540	109,855.00
彤程新材	3,300	97,515.00
麗珠集團	2,243	83,462.03
三友醫療	4,748	80,241.20
福斯特	4,900	72,030.00
大博醫療	2,700	69,741.00
城建發展	18,600	69,564.00
美年健康	17,500	66,150.00
尚太科技	1,200	51,864.00
聖諾生物	2,060	50,552.40
香飄飄	3,500	48,475.00
九洲藥業	3,400	46,648.00
華勤技術	830	45,840.90
西藏藥業	1,300	42,354.00
華發股份	5,900	38,350.00
達夢數據	175	30,612.75
鏈邦股份	1,287	24,002.55
安乃達	1,051	21,608.56
多利科技	844	20,407.92
永興股份	1,258	20,077.68
盛美上海	212	17,916.12
真蘭儀錶	1,481	17,061.12
星辰科技	481	15,521.87

上海合晶	866	13,760.74
駿鼎達	150	13,686.00
中倫新材	711	13,494.78
龍旗科技	298	11,172.02
峨眉山 A	1,000	10,890.00
燦芯股份	247	10,499.97
達利凱普	576	9,774.72
匯成真空	219	9,123.54
肯特股份	219	8,098.62
星環科技	217	7,966.07
中瑞股份	306	7,729.56
廣合科技	222	7,672.32
森泰股份	499	7,634.70
宏鑫科技	361	7,155.02
中創股份	186	5,868.30
歐萊新材	344	5,538.40
美新科技	257	5,461.25
華陽智能	138	5,220.54
博隆技術	66	4,491.96
永臻股份	178	4,473.14
平安電工	184	3,790.40
西典新能	130	3,296.80
北自科技	107	3,155.43
騰達科技	213	2,871.24
盛景微	72	2,800.80
頤中科技	242	2,761.22
億華通	53	1,588.94
七一二	64	1,164.16
安恒信息	21	840.21
華峰測控	4	367.00
君實生物	11	319.55
卓然股份	2	24.04
<b>合計</b>	<b>309,931,568</b>	<b>6,235,407,703.69</b>
<b>(2)債券投資</b>		
<b>上市投資</b>		
<b>中國(100%)</b>		
24 進出 01	10,800,000	1,091,769,639.34
24 農發 01	3,500,000	352,365,655.74
24 貼現國債 22	3,000,000	299,776,153.85
22 國開綠債 02 清發	1,800,000	182,291,917.81
24 光大銀行小微債	700,000	70,438,008.22
24 貼現國債 06	500,000	49,936,365.38

歐 22 轉債	10	1,080.12
<b>合計</b>	<b>20,300,010</b>	<b>2,046,578,820.46</b>
<b>(3)資產支持證券投資</b>		
上市投資		
中國(-)		
<b>合計</b>	<b>0</b>	<b>0.00</b>
<b>(4)買入返售金融資產</b>		
銀行間同業市場買入返售金融資產		
交易所市場買入返售金融資產		
<b>合計</b>		<b>0.00</b>
<b>總投資資產</b>		<b>8,281,986,524.15</b>
<b>銀行存款和結算備付金</b>		<b>876,311,383.06</b>
<b>其他各項資產</b>		<b>2,360,794.90</b>
<b>合計</b>		<b>9,160,658,702.11</b>

補充披露 2：投資組合變動表

序號	證券類別	佔基金資產淨值的比例 (%)	佔基金資產淨值的比例 (%)
		2024 年 6 月 30 日	2023 年 12 月 31 日
1	股票	68.42	70.95
2	債券	22.46	20.99
3	資產支持證券	-	-
4	買入返售金融資產	-	-

華夏基金管理有限公司

二〇二四年八月三十日