

華夏興華混合型證券投資基金

2023 年中期報告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：華夏基金管理有限公司

基金託管人：中國建設銀行股份有限公司

報告送出日期：二〇二三年八月三十日

華夏興華混合型證券投資基金（“本基金”）

2023 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，除華夏興華混合型證券投資基金和華夏回報證券投資基金外，其他基金在香港未獲證監會認可及並非供香港居民投資。

補充披露部分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 2023 年半年度報告一併閱覽。

華夏基金（香港）有限公司

香港代表

二〇二三年八月三十日

§1 重要提示及目錄

1.1 重要提示

基金管理人的董事會、董事保證本報告所載資料不存在虛假記載、誤導性陳述或重大遺漏，並對其內容的真實性、準確性和完整性承擔個別及連帶的法律責任。本中期報告已經三分之二以上獨立董事簽字同意，並由董事長簽發。

基金託管人中國建設銀行股份有限公司根據本基金合同規定，於 2023 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 2023 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.....	13
6.4 報表附注.....	15
§7 投資組合報告.....	37
7.1 期末基金資產組合情況.....	37
7.2 報告期末按行業分類的股票投資組合.....	38
7.3 期末按公允價值佔基金資產淨值比例大小排序的所有股票投資明細.....	38
7.4 報告期內股票投資組合的重大變動.....	41
7.5 期末按債券品種分類的債券投資組合.....	43
7.6 期末按公允價值佔基金資產淨值比例大小排序的前五名債券投資明細.....	43
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.....	43
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.....	43
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.....	43
7.10 本基金投資股指期貨的投資政策.....	44
7.11 報告期末本基金投資的國債期貨交易情況說明.....	44
7.12 投資組合報告附注.....	44
§8 基金份額持有人信息.....	45
§9 開放式基金份額變動.....	45
§10 重大事件披露.....	45
§11 影響投資者決策的其他重要信息.....	48
§12 備查文件目錄.....	48
§13 補充披露.....	49

§2 基金簡介

2.1 基金基本情况

基金名稱	華夏興華混合型證券投資基金
基金簡稱	華夏興華混合
基金主代碼	519908
交易代碼	519908
基金運作方式	契約型開放式
基金合同生效日	2013 年 4 月 12 日
基金管理人	華夏基金管理有限公司
基金託管人	中國建設銀行股份有限公司
報告期末基金份額總額	279,432,609.02 份
基金合同存續期	不定期

注：投資者通過中國內地的銷售機構申購基金份額時僅可申購 A 類基金份額（519908）。投資者通過香港的銷售機構申購基金份額時僅可申購 H 類基金份額（960004）。

2.2 基金產品說明

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

2.3 基金管理人和基金託管人

項目		基金管理人	基金託管人
名稱		華夏基金管理有限公司	中國建設銀行股份有限公司
信息披露 負責人	姓名	李彬	王小飛
	聯絡電話	400-818-6666	021-6063 7103
	電子郵箱	service@ChinaAMC.com	wangxiaofei.zh@ccb.com
客戶服務電話		400-818-6666	021-60637228
傳真		010-63136700	021-60635778
註冊地址		北京市順義區安慶大街甲3號院	北京市西城區金融大街25號
辦公地址		北京市西城區金融大街33號通泰大廈B座8層	北京市西城區鬧市口大街1號院1號樓
郵政編碼		100033	100033
法定代表人		楊明輝	田國立

2.5 信息披露方式

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

2.6 其他相關資料

項目	名稱	辦公地址
註冊登記機構	中國證券登記結算有限責任公司	北京市西城區太平橋大街 17 號

§3 主要財務指標和基金淨值表現

3.1 主要會計資料和財務指標

金額單位：人民幣元

3.1.1 期間資料和指標	報告期（2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日）
本期已實現收益	-58,551,363.33
本期利潤	-68,382,615.56
加權平均基金份額本期利潤	-0.2248
本期加權平均淨值利潤率	-7.00%
本期基金份額淨值增長率	-6.56%
3.1.2 期末資料和指標	報告期末(2023年6月30日)
期末可供分配利潤	593,860,132.40
期末可供分配基金份額利潤	2.1252
期末基金資產淨值	859,370,120.74
期末基金份額淨值	3.075
3.1.3 累計期末指標	報告期末(2023年6月30日)
基金份額累計淨值增長率	228.55%

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	2.91%	1.05%	0.95%	0.61%	1.96%	0.44%
過去三個	-4.27%	1.11%	-3.18%	0.58%	-1.09%	0.53%

月						
過去六個月	-6.56%	1.01%	0.20%	0.59%	-6.76%	0.42%
過去一年	-15.71%	1.13%	-9.04%	0.69%	-6.67%	0.44%
過去三年	42.43%	1.58%	-1.34%	0.84%	43.77%	0.74%
自基金轉型起至今	228.55%	1.63%	61.07%	0.98%	167.48%	0.65%

3.2.2 自基金轉型以來基金份額累計淨值增長率變動及其與同期業績比較基準收益率變動的比較

華夏興華混合型證券投資基金

份額累計淨值增長率與業績比較基準收益率歷史走勢對比圖

(2013 年 4 月 12 日至 2023 年 6 月 30 日)



注：本基金自 2013 年 4 月 12 日起由“興華證券投資基金”轉型而來。

§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、瀋陽設有分公司，在香港、深圳、上海設有子公司。公司是首批全國社保基金管理人、首批企業年金基金管理人、境內首批 QDII 基金管理人、境內首隻 ETF 基金管理人、境內首隻滬港通 ETF 基金管理人、首批內地與香港基金互認基金管理人、首批基本養老保險基金投資管理人資格、首家加入聯合國責任投資原則組織的公募基金公司、首批公募 FOF 基金管理人、首批公募養老目標基金管理人、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 2023 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：在養老目標風險 FOF(權益資產 0-30%)(A 類)中，華夏保守養老一年持有混合 (FOF) (A 類)排名第 1/59；在對沖策略絕對收益目標基金(A 類)中，華夏安泰對沖策略 3 個月定開混合排名第 1/22；在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 1/11；在低碳環保行業股票型基金(A 類)中，華夏節能環保股票(A 類)排名第 2/10；在消費行業偏股型基金(A 類)中，華夏網購精選混合(A 類)排名第 2/66、華夏新興消費混合(A 類)排名第 9/66；在 QDII 混合基金(A 類)中，華夏全球科技先鋒混合 (QDII) 排名第 3/43；在偏債型基金(A 類)中，華夏磐泰混合 (LOF) (A 類)排名前 2%(13/619)、華夏睿磐泰盛混合排名前 3%(19/619)、華夏永利一年持有混合(A 類)排名前 10%(61/619)；在靈活配置型基金(基準股票比例 30%-60%)(A 類)中，華夏穩增混合排名前 3%(14/440)、華夏新錦繡混合(A 類)排名前 4%(18/440)；在標準股票型基金(A 類)中，華夏智勝先鋒股票 (LOF) (A 類)排名前 4%(13/317)、華夏智勝價值成長股票(A 類)排名前 6%(20/317)；在偏股型基金(股票上限 95%)(A 類)中，華夏磐利一年定開混合(A 類)排名前 5%(11/214)、華夏磐銳一年定開混合(A 類)排名前 10%(21/214)；在偏股型基金(股票上下限 60%-95%)(A 類)中，華夏核心製造混合(A 類)排名前 9%(126/1403)、華夏價值精選混合排名前 9%(133/1403)。

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)排名第

1/24、华夏收益债券(QDII)(A類)排名第3/24；在短期純債債券型基金(A類)中，華夏30天滾動短債債券發起式(A類)排名第8/108；在長期純債債券型基金(A類)中，華夏鼎隆債券(A類)排名前6%(71/1228)、華夏鼎航債券(A類)排名前6%(76/1228)、華夏鼎英債券(A類)排名前7%(87/1228)；在普通債券型基金(可投轉債)(A類)中，華夏鼎祿三個月定開債券(A類)排名前9%(32/376)；在普通債券型基金(二級)(A類)中，華夏恒融債券排名前8%(30/368)。

指數與量化產品：在增強規模指數股票型基金(A類)中，華夏中證500指數增強(A類)排名第1/132、華夏中證500指數智選增強(A類)排名第2/132；在主題指數股票ETF联接基金(A類)中，華夏中證動漫遊戲ETF發起式联接(A類)排名第1/110；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2/16；在QDII跨境股票ETF基金中，華夏納斯達克100ETF(QDII)排名第2/33、華夏野村日經225ETF排名第7/33；在QDII跨境股票ETF联接基金(A類)中，華夏恒生ETF联接(A類)排名第3/10；在主題指數股票ETF基金中，華夏中證動漫遊戲ETF排名第1/313、華夏中證雲計算與大資料主題ETF排名第6/313、華夏中證大資料產業ETF排名前5%(15/313)、華夏中證文娛傳媒ETF排名前6%(18/313)、華夏中證金融科技主題ETF排名前10%(30/313)；在規模指數股票ETF基金中，華夏滬港通恒生ETF排名第4/136；在規模指數股票ETF联接基金(A類)中，華夏滬港通恒生ETF联接(A類)排名第4/102；在行業指數股票ETF联接基金(A類)中，華夏中證銀行ETF联接(A類)排名第6/30。

在《中國證券報》第十九屆中國基金業金牛獎評選中，華夏基金榮獲“被動投資金牛基金公司”，成為業內連續7年獲此殊榮的基金公司。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，華夏基金憑藉卓越的投資實力以及優秀的中長期業績回報，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》主辦的第十九屆“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，華夏能源革新股票榮獲“金基金·投資回報基金獎”，華夏滬深300ETF榮獲“金基金·指數基金三年期獎”。

在客戶服務方面，2023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)華夏基金直銷管道優化頁面顯示，升級搜索及查詢功能，給客戶更方便直觀的使用體驗；(2)華夏基金管家用戶端優化“忘記密碼”功能及定投模組，從客戶投資需求出發，進一步提升操作體驗；(3)與華潤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“幫你問了ChatGPT”、“華夏基金戶口本”、“指數攻防值來啦！”、“親子財商36計”等活動，為客戶提供了多樣化的投資者教育和關懷服務。

4.1.2 基金經理（或基金經理小組）及基金經理助理的簡介

姓名	職務	任本基金的基金經理 (助理) 期限		證券從業 年限	說明
		任職日期	離任日期		
陽琨	本基金的 基金經理、公司 投資總監、投委 會成員	2013-04-12	-	28 年	碩士。曾任寶盈基金基金經理助理，益民基金投資部部門經理，中國對外經濟貿易信託投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）、華夏成長證券投資基金基金經理（2021 年 2 月 22 日至 2022 年 4 月 11 日期間）等。

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 90 次，均為指數量化投資組合因投資策略需要和其他組合發生的反向交易。

4.4 管理人對報告期內基金的投資策略和業績表現的說明

4.4.1 報告期內基金投資策略和運作分析

2023 年上半年，國內股票市場隨投資者對經濟復蘇的預期波動而起伏，年初市場對國內經濟快速復蘇抱有較高期望，整體市場表現較好。但進入 3 月份後，由於高頻經濟資料不支援經濟強勁復蘇，投資者情緒轉向悲觀。同實體經濟相關度較高的金融地產、消費製造等行業出現了明顯股價回落。市場熱點聚焦於主題投資，人工智慧和“中特估”板塊吸引了大部分活躍資金的關注，相關個股價格震盪上行。上半年，海外主要經濟體的股票市場表現搶眼，美國股市在較好的就業資料刺激下大幅反彈，疊加投資者對以 ChatGPT 為代表的人工智慧產業可能迎來新一輪大發展普遍樂觀，美股納斯達克指數漲勢明顯。

本基金在上半年保持了較高的股票倉位元，持續進行結構調整。小幅減持了地產等傳統產業板塊，增持了汽車、電子等新興製造板塊。由於在主題投資方向暴露較少，基金淨值上半年表現一般。基金整體布局仍著眼於國內經濟週期性復蘇帶來的投資機會。

4.4.2 報告期內基金的業績表現

截至 2023 年 6 月 30 日，本基金份額淨值為 3.075 元，本報告期份額淨值增長率為 -6.56%，同期業績比較基準增長率為 0.20%。

4.5 管理人對宏觀經濟、證券市場及行業走勢的簡要展望

對於近期國內股票市場表現不佳，大部分人歸咎於實體經濟疲軟，但更準確的說法可能是前期投資者預期過於樂觀。事實上，23 年上半年的 GDP 增速並不算低。隨著國家進一步穩增長的政策措

施陸續推出，實體經濟呈現出溫和復蘇的態勢。22 年底中央經濟工作會議曾重點指出，我們的經濟不搞強刺激，不搞大水漫灌，要追求高品質發展。因此，對於經濟在政策刺激下強勁反彈的預期本身就存在不合理的地方。我們相信，隨著汽車、光伏、半導體等高端製造業自身短週期調整接近週期底部，國內經濟有望在 23 年下半年見底反彈。隨著時間推移，實體經濟向好可望得到逐步驗證，市場熱點可能重新回到以業績為核心的軌道中來。鑒於當前複雜的國際國內形勢，我們認為本輪經濟復蘇的力度可能比較溫和，大部分順週期產業盈利彈性不大。相比較而言，我們看好國內有世界競爭力的新興產業持續成長，它們可能成為本輪經濟復蘇的主要推動力量。以 AI 為代表的創新領域也在萌發新的機遇，但要轉化為有基本面支援的投資機會尚需要時間進一步觀察。

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

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

4.6 管理人對報告期內基金估值協議協議程序等事項的說明

根據中國證監會相關規定及基金合同約定，本基金管理人為準確、及時進行基金估值和份額淨值計價，制定了基金估值和份額淨值計價的業務管理制度，建立了估值委員會，使用可靠的估值業務系統，設有完善的風險監測、控制和報告機制。本基金託管人審閱本基金管理人採用的估值原則及技術，並覆核、審查基金資產淨值和基金份額申購、贖回價格。會計師事務所在估值調整導致基金資產淨值的變化在 0.25% 以上時對所採用的相關估值技術、假設及輸入值的適當性發表專業意見。定價服務機構按照商業合同約定提供定價服務。

4.7 管理人對報告期內基金利潤分配情況的說明

本基金本報告期未進行利潤分配，符合相關法規及基金合同的規定。

4.8 報告期內管理人對本基金持有人數或基金資產淨值預警情形的說明

報告期內，本基金未出現連續二十個工作日基金份額持有人數量不滿二百人或者基金資產淨值低於五千萬元的情形。

§5 託管人報告

5.1 報告期內本基金託管人遵規守信情況聲明

本報告期，中國建設銀行股份有限公司在本基金的託管過程中，嚴格遵守了《證券投資基金法》、

基金合同、託管協議和其他有關規定，不存在損害基金份額持有人利益的行為，完全盡職盡責地履行了基金託管人應盡的義務。

5.2 託管人對報告期內本基金投資運作遵規守信、淨值計算、利潤分配等情況的說明

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

報告期內，本基金利潤分配情況符合法律法規和基金合同的相關約定。

5.3 託管人對本中期報告中財務信息等內容的真實、準確和完整發表意見

本託管人覆核審查了本報告中的財務指標、淨值表現、利潤分配情況、財務會計報告、投資組合報告等內容，保證覆核內容不存在虛假記載、誤導性陳述或者重大遺漏。

§6 中期報告財務會計報告（未經審計）

6.1 資產負債表

會計主體：華夏興華混合型證券投資基金

報告截止日：2023 年 6 月 30 日

單位：人民幣元

資產	附注號	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
資產：			
銀行存款	6.4.7.1	34,067,080.47	75,218,536.17
結算備付金		969,611.10	3,224,581.17
存出保證金		312,481.03	374,634.66
交易性金融資產	6.4.7.2	836,904,463.62	968,066,868.40
其中：股票投資		794,482,756.83	927,633,615.96
基金投資		-	-
債券投資		42,421,706.79	40,433,252.44
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		663,374.69	900,643.35
應收股利		-	-
應收申購款		16,782.90	1,106,450.87
遞延所得稅資產		-	-

其他資產	6.4.7.5	218,378.00	218,378.00
資產總計		873,152,171.81	1,049,110,092.62
負債和淨資產	附注號	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
負債：			
短期借款		-	-
交易性金融負債		-	-
衍生金融負債	6.4.7.3	-	-
賣出回購金融資產款		-	-
應付清算款		-	793,360.26
應付贖回款		350,538.38	193,476.80
應付管理人報酬		1,044,890.61	1,343,418.48
應付託管費		174,148.44	223,903.08
應付銷售服務費		-	-
應付投資顧問費		-	-
應交稅費		783,428.03	783,415.34
應付利潤		-	-
遞延所得稅負債		-	-
其他負債	6.4.7.6	11,429,045.61	11,964,263.13
負債合計		13,782,051.07	15,301,837.09
淨資產：			
實收基金	6.4.7.7	265,509,988.34	298,487,830.32
未分配利潤	6.4.7.8	593,860,132.40	735,320,425.21
淨資產合計		859,370,120.74	1,033,808,255.53
負債和淨資產總計		873,152,171.81	1,049,110,092.62

注：報告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份額淨值 3.075 元，基金份額總額 279,432,609.02

份。

6.2 利潤表

會計主體：華夏興華混合型證券投資基金

本報告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

單位：人民幣元

項目	附注號	本期 2023年1月1日至 2023年6月30日	上年度可比期間 2022年1月1日至2022 年6月30日
一、營業總收入		-59,757,869.62	-57,092,535.46
1.利息收入		122,239.22	230,878.15
其中：存款利息收入	6.4.7.9	122,239.22	230,878.15
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		-	-

證券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投資收益（損失以“-”填列）		-50,227,590.69	30,527,279.35
其中：股票投資收益	6.4.7.10	-56,400,700.96	27,108,590.89
基金投資收益		-	-
債券投資收益	6.4.7.11	336,210.27	200.67
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	5,836,900.00	3,418,487.79
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	-9,831,252.23	-87,873,280.98
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	178,734.08	22,588.02
減：二、營業總支出		8,624,745.94	8,554,886.42
1.管理人報酬		7,291,449.04	7,231,593.50
2.託管費		1,215,241.54	1,205,265.56
3.銷售服務費		-	-
4.投資顧問費		-	-
5.利息支出		-	-
其中：賣出回購金融資產支出		-	-
6.信用減值損失	6.4.7.17	-	-
7.稅金及附加		3.53	0.70
8.其他費用	6.4.7.18	118,051.83	118,026.66
三、利潤總額（虧損總額以“-”號填列）		-68,382,615.56	-65,647,421.88
減：所得稅費用		-	-
四、淨利潤（淨虧損以“-”號填列）		-68,382,615.56	-65,647,421.88
五、其他綜合收益的稅後淨額		-	-
六、綜合收益總額		-68,382,615.56	-65,647,421.88

6.3 淨資產（基金淨值）變動表

會計主體：華夏興華混合型證券投資基金

本報告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

單位：人民幣元

項目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	實收基金	其他綜合 收益（若	未分配利潤	淨資產合計

		有)		
一、上期期末淨資產（基金淨值）	298,487,830.32	-	735,320,425.21	1,033,808,255.53
二、本期期初淨資產（基金淨值）	298,487,830.32	-	735,320,425.21	1,033,808,255.53
三、本期增減變動額（減少以“-”號填列）	-32,977,841.98	-	-141,460,292.81	-174,438,134.79
（一）、綜合收益總額	-	-	-68,382,615.56	-68,382,615.56
（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）	-32,977,841.98	-	-73,077,677.25	-106,055,519.23
其中：1.基金申購款	21,408,744.87	-	54,467,127.62	75,875,872.49
2.基金贖回款	-54,386,586.85	-	-127,544,804.87	-181,931,391.72
（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）	-	-	-	-
四、本期期末淨資產（基金淨值）	265,509,988.34	-	593,860,132.40	859,370,120.74
	上年度可比期間			
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
項目	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）	267,819,025.96	-	831,833,169.72	1,099,652,195.68
二、本期期初淨資產（基金淨值）	267,819,025.96	-	831,833,169.72	1,099,652,195.68
三、本期增減變動額（減少以“-”號填列）	12,814,574.72	-	-34,977,973.92	-22,163,399.20
（一）、綜合收益總額	-	-	-65,647,421.88	-65,647,421.88
（二）、本期基金份額交易產生的基金淨值變動數（淨值減少以“-”	12,814,574.72	-	30,669,447.96	43,484,022.68

號填列)				
其中：1.基金申購款	24,734,964.71	-	62,549,170.72	87,284,135.43
2.基金贖回款	-11,920,389.99	-	-31,879,722.76	-43,800,112.75
(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)	-	-	-	-
四、本期期末淨資產(基金淨值)	280,633,600.68	-	796,855,195.80	1,077,488,796.48

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

根據原興華證券投資基金(以下簡稱“基金興華”)基金份額持有人大會審議通過的《關於興華證券投資基金轉型有關事項的議案》，並經中國證券監督管理委員會(以下簡稱“中國證監會”)證監許可[2013]277 號《關於核准興華證券投資基金基金份額持有人大會有關轉換基金運作方式決議的批覆》及上海證券交易所上證基字[2013]95 號《關於終止興華證券投資基金上市的決定》的同意，基金興華於 2013 年 4 月 11 日進行終止上市權利登記，2013 年 4 月 12 日終止上市。原《興華證券投資基金基金合同》於終止上市日起失效，《華夏興華混合型證券投資基金基金合同》於同日起生效，同時基金興華更名為華夏興華混合型證券投資基金(以下簡稱“本基金”)。本基金為契約型開放式，存續期限為不定期。本基金的基金管理人為華夏基金管理有限公司，基金託管人為中國建設銀行股份有限公司。根據基金管理人 2015 年 7 月 2 日刊登的《華夏基金管理有限公司關於修訂華夏興華混合型證券投資基金基金合同的公告》，本基金自 2015 年 7 月 2 日起增加 H 類基金份額類別。

根據《華夏興華混合型證券投資基金招募說明書》，基金管理人華夏基金管理有限公司確定 2013 年 5 月 15 日為基金興華基金份額折算基準日。經本基金管理人計算並經基金託管人覆核的折算前基金份額淨值為 1.052 元，精確到小數點後第 9 位為 1.052420524 元(第 10 位舍去)，本基金管理人按照 1.052420524 的折算比例對原興華證券投資基金進行了基金份額折算，折算後的基金份額淨值為 1.000 元，折算後的基金份額為折算前的基金份額乘以折算比例，採用截尾法保留到整數位元，所產生的誤差歸入基金財產。折算前原興華證券投資基金份額總額為 20 億份，折算後基金份額總額為 2,104,814,287 份。

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

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

6.4.2 會計報表的編製基礎

本基金的財務報表按照財政部頒布和修訂的《企業會計準則—基本準則》、各項具體會計準則、《資產管理產品相關會計處理規定》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

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

6.4.5 會計政策和會計估計變更以及差錯更正的說明

6.4.5.1 會計政策變更的說明

本基金本報告期無會計政策變更。

6.4.5.2 會計估計變更的說明

本基金本報告期無會計估計變更。

6.4.5.3 差錯更正的說明

本基金本報告期無重大會計差錯的內容和更正金額。

6.4.6 稅項

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

- (1) 以發行基金方式募集資金不屬於增值稅徵收範圍，不徵收增值稅。
- (2) 資管產品運營過程中發生的增值稅應稅行為，以資管產品管理人為增值稅納稅人。資管產品管理人運營資管產品過程中發生的增值稅應稅行為，暫適用簡易計稅方法，按照 3% 的徵收率繳納增值稅。
- (3) 基金買賣股票、債券的差價收入免征增值稅，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 重要財務報表項目的說明

6.4.7.1 銀行存款

單位：人民幣元

項目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	34,067,080.47
等於：本金	34,061,116.63
加：應計利息	5,963.84
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	34,067,080.47

6.4.7.2 交易性金融資產

單位：人民幣元

項目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	成本	應計利息	公允價值	公允價值變動
股票	789,061,710.58	-	794,482,756.83	5,421,046.25
貴金屬投資-金交所黃金合約	-	-	-	-

債券	交易所市場	1,416,700.00	663.78	1,811,120.49	393,756.71
	銀行間市場	39,992,600.00	618,586.30	40,610,586.30	-600.00
	合計	41,409,300.00	619,250.08	42,421,706.79	393,156.71
資產支持證券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合計		830,471,010.58	619,250.08	836,904,463.62	5,814,202.96

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

單位：人民幣元

項目	本期末 2023 年 6 月 30 日
應收利息	-
其他應收款	218,378.00
待攤費用	-
合計	218,378.00

6.4.7.6 其他負債

單位：人民幣元

項目	本期末 2023 年 6 月 30 日
應付券商交易單元保證金	500,000.00
應付贖回費	414.92
應付證券出借違約金	-
應付交易費用	10,749,451.74
其中：交易所市場	10,749,451.74
銀行間市場	-
應付利息	-
預提費用	179,178.95

合計	11,429,045.61
----	---------------

6.4.7.7 實收基金

金額單位：人民幣元

項目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份額（份）	帳面金額
上年度末	314,137,835.12	298,487,830.32
本期申購	22,531,058.93	21,408,744.87
本期贖回（以“-”號填列）	-57,236,285.03	-54,386,586.85
本期末	279,432,609.02	265,509,988.34

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	838,540,861.46	-103,220,436.25	735,320,425.21
本期利潤	-58,551,363.33	-9,831,252.23	-68,382,615.56
本期基金份額交易產生的變動數	-88,447,279.75	15,369,602.50	-73,077,677.25
其中：基金申購款	59,697,835.19	-5,230,707.57	54,467,127.62
基金贖回款	-148,145,114.94	20,600,310.07	-127,544,804.87
本期已分配利潤	-	-	-
本期末	691,542,218.38	-97,682,085.98	593,860,132.40

6.4.7.9 存款利息收入

單位：人民幣元

項目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	活期存款利息收入	103,069.78
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	15,125.94	
其他	4,043.50	
合計	122,239.22	

6.4.7.10 股票投資收益

單位：人民幣元

項目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	賣出股票成交總額	1,244,609,461.42
減：賣出股票成本總額	1,297,690,972.87	
減：交易費用	3,319,189.51	
買賣股票差價收入	-56,400,700.96	

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 2023年1月1日至2023年6月30日
債券投資收益——利息收入	336,210.27
債券投資收益——買賣債券（債轉股及債券到期兌付）差價收入	-
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	336,210.27

6.4.7.11.2 債券投資收益——買賣債券差價收入

無。

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 2023年1月1日至2023年6月30日
股票投資產生的股利收益	5,836,900.00
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	5,836,900.00

6.4.7.15 公允價值變動收益

單位：人民幣元

項目名稱	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
1.交易性金融資產	-9,831,252.23

——股票投資	-10,228,109.70
——債券投資	396,857.47
——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	-9,831,252.23

6.4.7.16 其他收入

單位：人民幣元

項目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
基金贖回費收入	178,734.08
合計	178,734.08

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 2023年1月1日至2023年6月30日
審計費用	39,671.58
信息披露費	59,507.37
證券出借違約金	-
銀行費用	272.88
銀行間帳戶維護費	18,000.00
其他	600.00
合計	118,051.83

6.4.8 或有事項、資產負債表日後事項的說明

6.4.8.1 或有事項

截至資產負債表日，本基金無或有事項。

6.4.8.2 資產負債表日後事項

根據本基金管理人於 2023 年 7 月 8 日發布《華夏基金管理有限公司關於調低旗下部分基金費率並修訂基金合同的公告》，自 2023 年 7 月 10 日起本基金管理人調低了本基金的管理費率和/或託管

費率。

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

根據華夏基金管理有限公司於 2023 年 1 月 6 日發佈的公告，華夏基金管理有限公司股權結構變更為中信證券（出資比例 62.2%）、MACKENZIE FINANCIAL CORPORATION（出資比例 27.8%）、天津海鵬科技諮詢有限公司（出資比例 10%）。

6.4.9.2 本報告期與基金發生關聯交易的各關聯方

關聯方名稱	與本基金的關係
華夏基金管理有限公司	基金管理人
中國建設銀行股份有限公司（“中國建設銀行”）	基金託管人
中信證券股份有限公司（“中信證券”）	基金管理人股東

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

無。

6.4.10.1.2 債券交易

無。

6.4.10.1.3 債券回購交易

無。

6.4.10.1.4 應支付關聯方的佣金佣金

無。

6.4.10.2 關聯方報酬

6.4.10.2.1 基金管理費

單位：人民幣元

項目	本期 2023年1月1日至2023年6月 30日	上年度可比期間 2022年1月1日至2022年6月30 日
當期發生的基金應支付的管理費	7,291,449.04	7,231,593.50
其中：支付銷售機構的客戶維護費	736,737.69	655,223.72

注：①支付基金管理人的基金管理人報酬按前一日基金資產淨值 1.50%的年費率計提，逐日累計至每月月底，按月支付。

②基金管理人報酬計算公式為：日基金管理人報酬=前一日基金資產淨值×1.50%/當年天數。

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

6.4.10.2.2 基金託管費

單位：人民幣元

項目	本期	上年度可比期間
	2023年1月1日至2023年6月30日	2022年1月1日至2022年6月30日
當期發生的基金應支付的託管費	1,215,241.54	1,205,265.56

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	
	2023年1月1日至2023年6月30日		2022年1月1日至2022年6月30日	
	期末餘額	當期利息收入	期末餘額	當期利息收入
中國建設銀行活期存款	34,067,080.47	103,069.78	240,335,427.54	216,706.46

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

6.4.10.7 本基金在承銷期內參與關聯方承銷證券的情況

金額單位：人民幣元

本期 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	14,977	657,789.84
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
上年度可比期間 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	136,462	682,310.00
中信證券	688302	海創藥業	新股發行	13,082	561,479.44
中信證券	301200	大族數控	新股發行	6,396	489,677.76
中信證券	688326	經緯恒潤	新股發行	3,871	468,391.00
中信證券	301109	軍信股份	新股發行	11,699	407,242.19
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

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（2023 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
301486	致尚科技	2023-06-30	1 個月內(含)	新發流通受限	57.66	57.66	4,338	250,129.08	250,129.08	-
301395	仁信新材	2023-06-21	1 個月內(含)	新發流通受限	26.68	26.68	4,676	124,755.68	124,755.68	-
688249	晶合集成	2023-04-24	6 個月	新發流通受限	19.86	18.06	6,035	119,855.10	108,992.10	-
301292	海科新源	2023-06-29	1 個月內(含)	新發流通受限	19.99	19.99	5,241	104,767.59	104,767.59	-
301488	豪恩汽電	2023-06-26	1 個月內(含)	新發流通受限	39.78	39.78	2,356	93,721.68	93,721.68	-
301202	朗威股份	2023-06-28	1 個月內(含)	新發流通受限	25.82	25.82	2,754	71,108.28	71,108.28	-
301358	湖南裕能	2023-02-01	6 個月	新發流通受限	23.77	42.89	1,615	38,388.55	69,267.35	-
688603	天承科技	2023-06-30	1 個月內(含)	新發流通受限	55.00	55.00	1,251	68,805.00	68,805.00	-

301261	恒工精密	2023-06-29	1 個月內 (含)	新發 流通 受限	36.90	36.90	1,775	65,497.50	65,497.50	-
688472	阿特斯	2023-06-02	6 個月	新發 流通 受限	11.10	17.04	3,798	42,157.80	64,717.92	-
688469	中芯集成	2023-04-28	6 個月	新發 流通 受限	5.69	5.41	10,060	57,241.40	54,424.60	-
688485	九州一軌	2023-01-11	6 個月	新發 流通 受限	17.47	15.17	3,580	62,542.60	54,308.60	-
688361	中科飛測	2023-05-12	6 個月	新發 流通 受限	23.60	64.67	831	19,611.60	53,740.77	-
301260	格力博	2023-01-20	6 個月	新發 流通 受限	30.85	23.63	1,972	60,836.20	46,598.36	-
688531	日聯科技	2023-03-24	6 個月	新發 流通 受限	152.38	135.97	329	50,133.02	44,734.13	-
301325	曼恩斯特	2023-05-04	6 個月	新發 流通 受限	76.80	107.95	364	27,955.20	39,293.80	-
688146	中船特氣	2023-04-13	6 個月	新發 流通 受限	36.15	38.13	1,011	36,547.65	38,549.43	-
688484	南芯科技	2023-03-28	6 個月	新發 流通 受限	39.99	36.71	989	39,550.11	36,306.19	-
001286	陝西能源	2023-03-31	6 個月	新發 流通 受限	9.60	9.41	3,767	36,163.20	35,447.47	-
301291	明陽電氣	2023-06-21	6 個月	新發 流通 受限	38.13	31.03	1,068	40,722.84	33,140.04	-
001287	中電港	2023-03-30	6 個月	新發 流通 受限	11.88	21.02	1,386	16,465.68	29,133.72	-
301246	宏源藥業	2023-03-10	6 個月	新發 流通 受限	50.00	30.71	931	46,550.00	28,591.01	-
688352	頤中科技	2023-04-11	6 個月	新發 流通	12.10	12.07	2,361	28,568.10	28,497.27	-

				受限						
301486	致尚科技	2023-06-30	6 個月	新發 流通 受限	57.66	57.66	482	27,792.12	27,792.12	-
688507	索辰科技	2023-04-10	6 個月	新發 流通 受限	245.56	122.11	222	36,834.00	27,108.42	含 證 券 送 配
301310	鑫宏業	2023-05-26	6 個月	新發 流通 受限	67.28	65.43	409	27,517.52	26,760.87	-
688582	芯動聯科	2023-06-21	6 個月	新發 流通 受限	26.74	40.68	648	17,327.52	26,360.64	-
301293	三博腦科	2023-04-25	6 個月	新發 流通 受限	29.60	71.42	333	9,856.80	23,782.86	-
301303	真蘭儀錶	2023-02-13	6 個月	新發 流通 受限	26.80	22.32	1,058	28,354.40	23,614.56	-
688552	航太南湖	2023-05-08	6 個月	新發 流通 受限	21.17	23.50	956	20,238.52	22,466.00	-
688570	天瑪智控	2023-05-29	6 個月	新發 流通 受限	30.26	25.33	884	26,749.84	22,391.72	-
301307	美利信	2023-04-14	6 個月	新發 流通 受限	32.34	31.86	687	22,217.58	21,887.82	-
688543	國科軍工	2023-06-14	6 個月	新發 流通 受限	43.67	53.05	410	17,904.70	21,750.50	-
301322	綠通科技	2023-02-27	6 個月	新發 流通 受限	131.11	53.24	392	34,219.71	20,870.08	含 證 券 送 配
688458	美芯晟	2023-05-15	6 個月	新發 流通 受限	75.00	90.76	221	16,575.00	20,057.96	-
688581	安傑思	2023-05-12	6 個月	新發 流通 受限	125.80	118.03	163	20,505.40	19,238.89	-

301317	鑫磊股份	2023-01-12	6 個月	新發 流通 受限	20.67	26.17	694	14,344.98	18,161.98	-
301262	海看股份	2023-06-13	6 個月	新發 流通 受限	30.22	25.50	692	20,912.24	17,646.00	-
301383	天鍵股份	2023-05-31	6 個月	新發 流通 受限	46.16	35.72	493	22,756.88	17,609.96	-
688562	航太軟件	2023-05-15	6 個月	新發 流通 受限	12.68	22.31	726	9,205.68	16,197.06	-
301439	泓淋電力	2023-03-10	6 個月	新發 流通 受限	19.99	16.90	949	18,970.51	16,038.10	-
688623	雙元科技	2023-05-31	6 個月	新發 流通 受限	125.88	86.79	178	22,406.64	15,448.62	-
301332	德爾瑪	2023-05-09	6 個月	新發 流通 受限	14.81	13.73	1,122	16,616.82	15,405.06	-
301399	英特科技	2023-05-16	6 個月	新發 流通 受限	43.99	51.57	293	12,889.07	15,110.01	-
301305	朗坤環境	2023-05-15	6 個月	新發 流通 受限	25.25	19.69	753	19,013.25	14,826.57	-
301397	溯聯股份	2023-06-15	6 個月	新發 流通 受限	53.27	40.20	362	19,283.74	14,552.40	-
301387	光大同創	2023-04-10	6 個月	新發 流通 受限	58.32	45.36	307	17,904.24	13,925.52	-
301395	仁信新材	2023-06-21	6 個月	新發 流通 受限	26.68	26.68	520	13,873.60	13,873.60	-
301210	金楊股份	2023-06-21	6 個月	新發 流通 受限	57.88	49.17	281	16,264.28	13,816.77	-
688512	慧智微	2023-05-08	6 個月	新發 流通 受限	20.92	19.16	721	15,083.32	13,814.36	-
301382	蜂助手	2023-05-09	6 個月	新發 流通	23.80	32.84	408	9,710.40	13,398.72	-

				受限						
688433	華曙 高科	2023- 04-07	6 個月	新發 流通 受限	26.66	31.50	418	11,143.88	13,167.00	-
301360	榮旗 科技	2023- 04-17	6 個月	新發 流通 受限	71.88	92.60	134	9,631.92	12,408.40	-
301345	濤濤 車業	2023- 03-10	6 個月	新發 流通 受限	73.45	46.64	266	19,537.70	12,406.24	-
301292	海科 新源	2023- 06-29	6 個月	新發 流通 受限	19.99	19.99	583	11,654.17	11,654.17	-
688523	航太 環宇	2023- 05-26	6 個月	新發 流通 受限	21.86	23.85	472	10,317.92	11,257.20	-
603135	中重 科技	2023- 03-29	6 個月	新發 流通 受限	17.80	17.89	628	11,178.40	11,234.92	-
301141	中科 磁業	2023- 03-27	6 個月	新發 流通 受限	41.20	42.69	262	10,794.40	11,184.78	-
301225	恒勃 股份	2023- 06-08	6 個月	新發 流通 受限	35.66	33.26	333	11,874.78	11,075.58	-
301429	森泰 股份	2023- 04-10	6 個月	新發 流通 受限	28.75	21.02	499	14,346.25	10,488.98	-
301488	豪恩 汽電	2023- 06-26	6 個月	新發 流通 受限	39.78	39.78	262	10,422.36	10,422.36	-
601065	江鹽 集團	2023- 03-31	6 個月	新發 流通 受限	10.36	11.84	875	9,065.00	10,360.00	-
688631	萊斯 信息	2023- 06-19	6 個月	新發 流通 受限	25.28	29.87	336	8,494.08	10,036.32	-
688479	友車 科技	2023- 05-04	6 個月	新發 流通 受限	33.99	29.49	332	11,284.68	9,790.68	-
301232	飛沃 科技	2023- 06-08	6 個月	新發 流通 受限	72.50	58.42	165	11,962.50	9,639.30	-
301376	致歐	2023-	6 個月	新發	24.66	22.51	420	10,357.20	9,454.20	-

	科技	06-14		流通受限						
301355	南王科技	2023-06-02	6 個月	新發流通受限	17.55	16.75	563	9,880.65	9,430.25	-
301357	北方長龍	2023-04-11	6 個月	新發流通受限	50.00	48.39	190	9,500.00	9,194.10	-
301386	未來電器	2023-03-21	6 個月	新發流通受限	29.99	23.79	378	11,336.22	8,992.62	-
301323	新萊福	2023-05-29	6 個月	新發流通受限	39.06	39.36	228	8,905.68	8,974.08	-
688429	時創能源	2023-06-20	6 個月	新發流通受限	19.20	25.53	346	6,643.20	8,833.38	-
301170	錫南科技	2023-06-16	6 個月	新發流通受限	34.00	34.93	250	8,500.00	8,732.50	-
301281	科源製藥	2023-03-28	6 個月	新發流通受限	44.18	25.10	338	10,647.38	8,483.80	含證券送配
688535	華海誠科	2023-03-28	6 個月	新發流通受限	35.00	51.23	161	5,635.00	8,248.03	-
601133	柏誠股份	2023-03-31	6 個月	新發流通受限	11.66	12.26	664	7,742.24	8,140.64	-
301157	華塑科技	2023-03-01	6 個月	新發流通受限	56.50	52.93	150	8,475.00	7,939.50	-
301202	朗威股份	2023-06-28	6 個月	新發流通受限	25.82	25.82	306	7,900.92	7,900.92	-
301295	美碩科技	2023-06-19	6 個月	新發流通受限	37.40	36.07	215	8,041.00	7,755.05	-
301203	國泰環保	2023-03-28	6 個月	新發流通受限	46.13	34.40	225	10,379.25	7,740.00	-
688603	天承	2023-	6 個月	新發	55.00	55.00	140	7,700.00	7,700.00	-

	科技	06-30		流通受限						
300804	廣康生化	2023-06-15	6 個月	新發流通受限	42.45	32.97	226	9,593.70	7,451.22	-
301261	恒工精密	2023-06-29	6 個月	新發流通受限	36.90	36.90	198	7,306.20	7,306.20	-
301337	亞華電子	2023-05-16	6 個月	新發流通受限	32.60	30.37	232	7,563.20	7,045.84	-
301428	世紀恒通	2023-05-10	6 個月	新發流通受限	26.35	30.60	229	6,034.15	7,007.40	-
001380	華緯科技	2023-05-09	6 個月	新發流通受限	28.84	30.78	170	4,902.80	5,232.60	-
603125	常青科技	2023-03-30	6 個月	新發流通受限	25.98	24.53	160	4,156.80	3,924.80	-
001328	登康口腔	2023-03-29	6 個月	新發流通受限	20.68	25.49	145	2,998.60	3,696.05	-
001282	三聯鍛造	2023-05-15	6 個月	新發流通受限	27.93	33.03	105	2,932.65	3,468.15	-
001360	南礦集團	2023-03-31	6 個月	新發流通受限	15.38	14.87	177	2,722.26	2,631.99	-
001324	長青科技	2023-05-12	6 個月	新發流通受限	18.88	19.60	114	2,152.32	2,234.40	-
001367	海森藥業	2023-03-30	6 個月	新發流通受限	44.48	39.48	55	2,446.40	2,171.40	-
603172	萬豐股份	2023-04-28	6 個月	新發流通受限	14.58	16.13	122	1,778.76	1,967.86	-

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 2023 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	合計
銀行存款	34,067,080.47	-	-	34,067,080.47
結算備付金	969,611.10	-	-	969,611.10
結算保證金	312,481.03	-	-	312,481.03
債券投資	42,421,706.79	-	-	42,421,706.79
資產支持證券	-	-	-	-
買入返售金融資產	-	-	-	-
應收直銷申購款	3,456.52	-	-	3,456.52
賣出回購金融資產 款	-	-	-	-
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	合計
銀行存款	75,218,536.17	-	-	75,218,536.17
結算備付金	3,224,581.17	-	-	3,224,581.17
結算保證金	374,634.66	-	-	374,634.66
債券投資	40,433,252.44	-	-	40,433,252.44
資產支持證券	-	-	-	-
買入返售金融資產	-	-	-	-
應收直銷申購款	4,695.02	-	-	4,695.02
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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	利率下降 25 個基點	8,885.51	58,267.07
	利率上升 25 個基點	-8,881.62	-58,098.59

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 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 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	794,482,756.83	92.45	927,633,615.96	89.73
交易性金融資產－基金投資	-	-	-	-
交易性金融資產－債券投資	1,811,120.49	0.21	249,888.06	0.02
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	796,293,877.32	92.66	927,883,504.02	89.75

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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	-5%	-35,929,118.15	-38,909,471.89
	+5%	35,929,118.15	38,909,471.89

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 2023 年 6 月 30 日
第一層次	793,878,659.67
第二層次	41,476,020.48
第三層次	1,549,783.47
合計	836,904,463.62

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 2023 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	794,482,756.83	90.99
	其中：股票	794,482,756.83	90.99
2	基金投資	-	-
3	固定收益投資	42,421,706.79	4.86
	其中：債券	42,421,706.79	4.86
	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	35,036,691.57	4.01
8	其他各項資產	1,211,016.62	0.14
9	合計	873,152,171.81	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	-	-
C	製造業	645,741,990.32	75.14
D	電力、熱力、燃氣及水生產和供應業	35,447.47	0.00
E	建築業	8,140.64	0.00
F	批發和零售業	38,587.92	0.00
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	21,500,482.75	2.50
J	金融業	-	-
K	房地產業	126,886,049.70	14.77
L	租賃和商務服務業	-	-
M	科學研究和技術服務業	171,400.00	0.02
N	水利、環境和公共設施管理業	76,875.17	0.01
O	居民服務、修理和其他服務業	-	-
P	教育	-	-
Q	衛生和社會工作	23,782.86	0.00
R	文化、體育和娛樂業	-	-
S	綜合	-	-
	合計	794,482,756.83	92.45

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	300750	寧德時代	217,080	49,665,733.20	5.78
2	300395	菲利華	919,476	45,238,219.20	5.26
3	600325	華發股份	4,219,162	41,558,745.70	4.84
4	688072	拓荆科技	85,976	36,623,196.72	4.26
5	600048	保利發展	2,642,100	34,426,563.00	4.01
6	001979	招商蛇口	2,619,500	34,132,085.00	3.97
7	002879	長纜科技	2,010,540	33,113,593.80	3.85
8	002409	雅克科技	418,000	30,463,840.00	3.54

9	300782	卓勝微	280,734	27,127,326.42	3.16
10	300593	新雷能	1,137,777	26,066,471.07	3.03
11	601689	拓普集團	320,600	25,872,420.00	3.01
12	002594	比亞迪	96,941	25,036,952.07	2.91
13	688012	中微公司	158,250	24,758,212.50	2.88
14	300034	鋼研高納	627,241	24,707,022.99	2.88
15	605133	嶸泰股份	677,651	23,555,148.76	2.74
16	688601	力芯微	490,241	23,090,351.10	2.69
17	603239	浙江仙通	1,351,900	21,995,413.00	2.56
18	603986	兆易創新	202,305	21,494,906.25	2.50
19	688326	經緯恒潤	132,767	19,170,227.13	2.23
20	002371	北方華創	59,000	18,741,350.00	2.18
21	002965	祥鑫科技	335,100	18,658,368.00	2.17
22	301358	湖南裕能	412,654	18,159,093.74	2.11
23	002025	航太電器	278,572	17,772,893.60	2.07
24	688037	芯源微	99,110	16,942,854.50	1.97
25	600641	萬業企業	878,400	16,768,656.00	1.95
26	601633	長城汽車	539,609	13,581,958.53	1.58
27	300682	朗新科技	505,364	11,764,873.92	1.37
28	688766	普冉股份	104,516	11,164,399.12	1.30
29	688596	正帆科技	240,097	10,396,200.10	1.21
30	600166	福田汽車	2,912,900	9,903,860.00	1.15
31	688508	芯朋微	165,336	9,587,834.64	1.12
32	688082	盛美上海	81,801	9,030,830.40	1.05
33	301360	榮旗科技	82,834	8,636,364.40	1.00
34	002865	鈞達股份	55,800	8,511,174.00	0.99
35	603179	新泉股份	193,100	8,475,159.00	0.99
36	603997	繼峰股份	582,400	8,328,320.00	0.97
37	688678	福立旺	316,086	6,716,827.50	0.78
38	301291	明陽電氣	10,672	346,230.44	0.04
39	301486	致尚科技	4,820	277,921.20	0.03
40	301047	義翹神州	2,000	171,400.00	0.02
41	301397	溯聯股份	3,618	152,606.80	0.02
42	301210	金楊股份	2,801	143,168.37	0.02
43	301395	仁信新材	5,196	138,629.28	0.02
44	301292	海科新源	5,824	116,421.76	0.01
45	688249	晶合集成	6,035	108,992.10	0.01
46	301488	豪恩汽電	2,618	104,144.04	0.01
47	301202	朗威股份	3,060	79,009.20	0.01
48	300804	廣康生化	2,257	77,134.83	0.01
49	688603	天承科技	1,391	76,505.00	0.01
50	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	0.01
51	688472	阿特斯	3,798	64,717.92	0.01

52	301262	海看股份	2,117	57,189.75	0.01
53	688469	中芯集成	10,060	54,424.60	0.01
54	688485	九州一軌	3,580	54,308.60	0.01
55	688361	中科飛測	831	53,740.77	0.01
56	301260	格力博	1,972	46,598.36	0.01
57	688531	日聯科技	329	44,734.13	0.01
58	301325	曼恩斯特	364	39,293.80	0.00
59	688146	中船特氣	1,011	38,549.43	0.00
60	001311	多利科技	649	37,272.07	0.00
61	688484	南芯科技	989	36,306.19	0.00
62	001286	陝西能源	3,767	35,447.47	0.00
63	001287	中電港	1,386	29,133.72	0.00
64	301246	宏源藥業	931	28,591.01	0.00
65	688352	頤中科技	2,361	28,497.27	0.00
66	688507	索辰科技	222	27,108.42	0.00
67	301310	鑫宏業	409	26,760.87	0.00
68	688582	芯動聯科	648	26,360.64	0.00
69	301293	三博腦科	333	23,782.86	0.00
70	301303	真蘭儀錶	1,058	23,614.56	0.00
71	688552	航太南湖	956	22,466.00	0.00
72	688570	天瑪智控	884	22,391.72	0.00
73	301307	美利信	687	21,887.82	0.00
74	688543	國科軍工	410	21,750.50	0.00
75	301322	綠通科技	392	20,870.08	0.00
76	688458	美芯晟	221	20,057.96	0.00
77	688581	安傑思	163	19,238.89	0.00
78	301317	鑫磊股份	694	18,161.98	0.00
79	301383	天鍵股份	493	17,609.96	0.00
80	688562	航太軟件	726	16,197.06	0.00
81	301439	泓淋電力	949	16,038.10	0.00
82	688623	雙元科技	178	15,448.62	0.00
83	301332	德爾瑪	1,122	15,405.06	0.00
84	301399	英特科技	293	15,110.01	0.00
85	301305	朗坤環境	753	14,826.57	0.00
86	301387	光大同創	307	13,925.52	0.00
87	688512	慧智微	721	13,814.36	0.00
88	301382	蜂助手	408	13,398.72	0.00
89	300482	萬孚生物	500	13,315.00	0.00
90	688433	華曙高科	418	13,167.00	0.00
91	301345	濤濤車業	266	12,406.24	0.00
92	688523	航太環宇	472	11,257.20	0.00
93	603135	中重科技	628	11,234.92	0.00
94	301141	中科磁業	262	11,184.78	0.00

95	301225	恒勃股份	333	11,075.58	0.00
96	301429	森泰股份	499	10,488.98	0.00
97	601065	江鹽集團	875	10,360.00	0.00
98	688631	萊斯信息	336	10,036.32	0.00
99	688479	友車科技	332	9,790.68	0.00
100	301232	飛沃科技	165	9,639.30	0.00
101	301376	致歐科技	420	9,454.20	0.00
102	301355	南王科技	563	9,430.25	0.00
103	301357	北方長龍	190	9,194.10	0.00
104	301386	未來電器	378	8,992.62	0.00
105	301323	新萊福	228	8,974.08	0.00
106	688429	時創能源	346	8,833.38	0.00
107	301170	錫南科技	250	8,732.50	0.00
108	301281	科源製藥	338	8,483.80	0.00
109	688535	華海誠科	161	8,248.03	0.00
110	601133	柏誠股份	664	8,140.64	0.00
111	301157	華塑科技	150	7,939.50	0.00
112	301295	美碩科技	215	7,755.05	0.00
113	301203	國泰環保	225	7,740.00	0.00
114	301337	亞華電子	232	7,045.84	0.00
115	301428	世紀恒通	229	7,007.40	0.00
116	001380	華緯科技	170	5,232.60	0.00
117	603125	常青科技	160	3,924.80	0.00
118	001328	登康口腔	145	3,696.05	0.00
119	001282	三聯鍛造	105	3,468.15	0.00
120	001360	南礦集團	177	2,631.99	0.00
121	001324	長青科技	114	2,234.40	0.00
122	001367	海森藥業	55	2,171.40	0.00
123	603172	萬豐股份	122	1,967.86	0.00
124	002101	廣東鴻圖	3	58.74	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	001979	招商蛇口	48,165,069.00	4.66
2	002594	比亞迪	47,805,533.53	4.62
3	688012	中微公司	40,253,555.68	3.89
4	688072	拓荆科技	40,169,922.20	3.89
5	688111	金山辦公	32,380,365.67	3.13
6	600325	華發股份	32,307,084.78	3.13
7	601633	長城汽車	31,595,776.67	3.06

8	300059	東方財富	29,316,186.86	2.84
9	002409	雅克科技	28,487,934.63	2.76
10	688601	力芯微	23,850,737.83	2.31
11	002196	方正電機	22,483,735.22	2.17
12	600031	三一重工	22,243,222.00	2.15
13	603986	兆易創新	22,012,230.05	2.13
14	688188	柏楚電子	21,994,900.52	2.13
15	300327	中穎電子	21,963,980.96	2.12
16	603239	浙江仙通	21,649,864.00	2.09
17	600166	福田汽車	21,410,001.00	2.07
18	301185	鷗瑪軟件	20,129,875.22	1.95
19	688037	芯源微	20,045,512.98	1.94
20	300567	精測電子	20,019,826.00	1.94

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	300059	東方財富	76,630,913.64	7.41
2	688111	金山辦公	46,195,762.04	4.47
3	000002	萬科 A	43,490,058.95	4.21
4	601636	旗濱集團	36,501,324.14	3.53
5	688123	聚辰股份	34,622,736.38	3.35
6	601155	新城控股	34,033,035.00	3.29
7	601166	興業銀行	32,296,359.00	3.12
8	600208	新湖中寶	30,851,880.01	2.98
9	600383	金地集團	28,920,914.00	2.80
10	600606	綠地控股	28,786,147.90	2.78
11	600153	建發股份	28,750,277.00	2.78
12	600862	中航高科	25,940,794.94	2.51
13	600031	三一重工	24,833,083.00	2.40
14	601888	中國中免	23,027,279.00	2.23
15	002196	方正電機	22,497,015.44	2.18
16	300831	派瑞股份	21,089,915.00	2.04
17	002594	比亞迪	20,491,053.00	1.98
18	688766	普冉股份	20,299,630.53	1.96
19	300327	中穎電子	20,198,686.65	1.95
20	688188	柏楚電子	19,419,607.21	1.88

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	1,174,768,223.44
賣出股票收入（成交）總額	1,244,609,461.42

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	-	-
2	央行票據	-	-
3	金融債券	40,610,586.30	4.73
	其中：政策性金融債	40,610,586.30	4.73
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）	1,811,120.49	0.21
8	同業存單	-	-
9	其他	-	-
10	合計	42,421,706.79	4.94

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	220306	22 進出 06	400,000	40,610,586.30	4.73
2	113670	金 23 轉債	12,560	1,585,565.80	0.18
3	127038	國微轉債	1,607	225,554.69	0.03
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

7.7 期末按公允價值佔基金資產淨值比例大小排序的所有資產支持證券投資明細

本基金本報告期末未持有資產支持證券。

7.8 報告期末按公允價值佔基金資產淨值比例大小排序的前五名貴金屬投資明細

本基金本報告期末未持有貴金屬。

7.9 期末按公允價值佔基金資產淨值比例大小排序的前五名權證投資明細

本基金本報告期末未持有權證。

7.10 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，本基金投資決策協議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	312,481.03
2	應收清算款	663,374.69
3	應收股利	-
4	應收利息	-
5	應收申購款	16,782.90
6	其他應收款	218,378.00
7	待攤費用	-
8	其他	-
9	合計	1,211,016.62

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	127038	國微轉債	225,554.69	0.03

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 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
39,216	7,125.47	20,743,477.68	7.42%	258,689,131.34	92.58%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	71,762.31	0.03%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2013年4月12日)基金份额总额	2,000,000,000.00
本报告期期初基金份额总额	314,137,835.12
本报告期基金总申购份额	22,531,058.93
减：本报告期基金总赎回份额	57,236,285.03
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	279,432,609.02

§10 重大事件披露

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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，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

本報告期末發生影響基金管理人經營或基金運營業務的訴訟。

本報告期無涉及基金財產、基金託管業務的訴訟事項。

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，基金託管人及其高級管理人員未受監管部門稽查或處罰。

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	
浙商證券	2	1,289,976,551.50	53.71%	943,358.87	50.13%	-
國泰君安證券	1	468,855,002.92	19.52%	436,642.43	23.20%	-
國海證券	1	363,110,305.82	15.12%	265,543.46	14.11%	-
招商證券	1	157,683,032.88	6.57%	146,851.81	7.80%	-
國融證券	1	122,202,380.96	5.09%	89,368.75	4.75%	-

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協議程序：

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定/證券經紀服務協定。

③ 除本表列示外，本基金還選擇了廣發證券、國都證券、國信證券、國元證券、滙豐前海證券、申萬宏源證券、銀河證券、中國銀河證券、中金公司、中信建投證券、中信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
浙商證券	-	-	-	-	-	-	-	-
國泰君安證券	-	-	-	-	-	-	-	-
國海證券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商證券	-	-	-	-	-	-	-	-
國融證券	-	-	-	-	-	-	-	-

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公告	中國證監會指定報刊及網站	2023-01-06
2	華夏基金管理有限公司關於旗下基金投資關聯方承銷證券的公告	中國證監會指定報刊及網站	2023-01-19
3	華夏基金管理有限公司關於旗下基金投資關聯方承銷證券的公告	中國證監會指定報刊及網站	2023-02-24
4	華夏基金管理有限公司關於旗下基金投資關聯方承銷證券的公告	中國證監會指定報刊及網站	2023-03-03

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	2023-03-11
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	2023-03-23
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	2023-03-30
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	2023-04-01
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	2023-04-13
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	2023-04-15
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	2023-04-27
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	2023-05-13
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	2023-05-27
14	華夏基金管理有限公司關於旗下基金投資關聯方承銷證券的公告	中國證監會指定報刊及網站	2023-05-31

§11 影響投資者決策的其他重要信息

11.1 報告期內單一投資者持有基金份額比例達到或超過 20%的情況

本基金本報告期內未出現單一投資者持有基金份額比例達到或超過 20%的情況。

§12 備查文件目錄

12.1 備查文件目錄

- 1、中國證監會准予基金轉型的文件；
- 2、《華夏興華混合型證券投資基金基金合同》；
- 3、《華夏興華混合型證券投資基金託管協定》；
- 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%)		
寧德時代	217,080	49,665,733.20
菲利華	919,476	45,238,219.20
華發股份	4,219,162	41,558,745.70
拓荆科技	85,976	36,623,196.72
保利發展	2,642,100	34,426,563.00
招商蛇口	2,619,500	34,132,085.00
長纜科技	2,010,540	33,113,593.80
雅克科技	418,000	30,463,840.00
卓勝微	280,734	27,127,326.42
新雷能	1,137,777	26,066,471.07
拓普集團	320,600	25,872,420.00
比亞迪	96,941	25,036,952.07
中微公司	158,250	24,758,212.50
鋼研高納	627,241	24,707,022.99
嶸泰股份	677,651	23,555,148.76
力芯微	490,241	23,090,351.10
浙江仙通	1,351,900	21,995,413.00
兆易創新	202,305	21,494,906.25
經緯恒潤	132,767	19,170,227.13
北方華創	59,000	18,741,350.00
祥鑫科技	335,100	18,658,368.00
湖南裕能	412,654	18,159,093.74
航太電器	278,572	17,772,893.60
芯源微	99,110	16,942,854.50
萬業企業	878,400	16,768,656.00
長城汽車	539,609	13,581,958.53
朗新科技	505,364	11,764,873.92
普冉股份	104,516	11,164,399.12
正帆科技	240,097	10,396,200.10
福田汽車	2,912,900	9,903,860.00

芯朋微	165,336	9,587,834.64
盛美上海	81,801	9,030,830.40
榮旗科技	82,834	8,636,364.40
鈞達股份	55,800	8,511,174.00
新泉股份	193,100	8,475,159.00
繼峰股份	582,400	8,328,320.00
福立旺	316,086	6,716,827.50
明陽電氣	10,672	346,230.44
致尚科技	4,820	277,921.20
義翹神州	2,000	171,400.00
溯聯股份	3,618	152,606.80
金楊股份	2,801	143,168.37
仁信新材	5,196	138,629.28
海科新源	5,824	116,421.76
晶合集成	6,035	108,992.10
豪恩汽電	2,618	104,144.04
朗威股份	3,060	79,009.20
廣康生化	2,257	77,134.83
天承科技	1,391	76,505.00
恒工精密	1,973	72,803.70
阿特斯	3,798	64,717.92
海看股份	2,117	57,189.75
中芯集成	10,060	54,424.60
九州一軌	3,580	54,308.60
中科飛測	831	53,740.77
格力博	1,972	46,598.36
日聯科技	329	44,734.13
曼恩斯特	364	39,293.80
中船特氣	1,011	38,549.43
多利科技	649	37,272.07
南芯科技	989	36,306.19
陝西能源	3,767	35,447.47
中電港	1,386	29,133.72
宏源藥業	931	28,591.01
頤中科技	2,361	28,497.27
索辰科技	222	27,108.42
鑫宏業	409	26,760.87
芯動聯科	648	26,360.64
三博腦科	333	23,782.86
真蘭儀錶	1,058	23,614.56
航太南湖	956	22,466.00
天瑪智控	884	22,391.72
美利信	687	21,887.82

國科軍工	410	21,750.50
綠通科技	392	20,870.08
美芯晟	221	20,057.96
安傑思	163	19,238.89
鑫磊股份	694	18,161.98
天鍵股份	493	17,609.96
航太軟件	726	16,197.06
泓淋電力	949	16,038.10
雙元科技	178	15,448.62
德爾瑪	1,122	15,405.06
英特科技	293	15,110.01
朗坤環境	753	14,826.57
光大同創	307	13,925.52
慧智微	721	13,814.36
蜂助手	408	13,398.72
萬孚生物	500	13,315.00
華曙高科	418	13,167.00
濤濤車業	266	12,406.24
航太環宇	472	11,257.20
中重科技	628	11,234.92
中科磁業	262	11,184.78
恒勃股份	333	11,075.58
森泰股份	499	10,488.98
江鹽集團	875	10,360.00
萊斯信息	336	10,036.32
友車科技	332	9,790.68
飛沃科技	165	9,639.30
致歐科技	420	9,454.20
南王科技	563	9,430.25
北方長龍	190	9,194.10
未來電器	378	8,992.62
新萊福	228	8,974.08
時創能源	346	8,833.38
錫南科技	250	8,732.50
科源製藥	338	8,483.80
華海誠科	161	8,248.03
柏誠股份	664	8,140.64
華塑科技	150	7,939.50
美碩科技	215	7,755.05
國泰環保	225	7,740.00
亞華電子	232	7,045.84
世紀恒通	229	7,007.40
華緯科技	170	5,232.60

常青科技	160	3,924.80
登康口腔	145	3,696.05
三聯鍛造	105	3,468.15
南礦集團	177	2,631.99
長青科技	114	2,234.40
海森藥業	55	2,171.40
萬豐股份	122	1,967.86
廣東鴻圖	3	58.74
合計	26,561,083	794,482,756.83
(2)債券投資		
上市投資		
中國(100%)		
22 進出 06	400,000	40,610,586.30
金 23 轉債	12,560	1,585,565.80
國微轉債	1,607	225,554.69
合計	414,167	42,421,706.79
(3)資產支持證券投資		
上市投資		
中國(-)		
合計	0	0.00
(4)買入返售金融資產		
銀行間同業市場買入返售金融資產		
交易所市場買入返售金融資產		
合計		0.00
總投資資產		836,904,463.62
銀行存款和結算備付金		35,036,691.57
其他各項資產		1,211,016.62
合計		873,152,171.81

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
		(%)	(%)
		2023 年 6 月 30 日	2022 年 12 月 31 日
1	股票	92.45	89.73
2	債券	4.94	3.91
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

二〇二三年八月三十日