

---

# 华夏智胜新锐股票型证券投资基金

## 2024 年年度报告

2024 年 12 月 31 日

基金管理人：华夏基金管理有限公司

基金托管人：广发证券股份有限公司

送出日期：二〇二五年三月三十一日

## §1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人广发证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 3 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中的财务资料经审计，毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2024 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录 .....	1
§2 基金简介 .....	3
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况 .....	4
3.1 主要会计数据和财务指标 .....	4
3.2 基金净值表现 .....	5
3.3 过去三年基金的利润分配情况 .....	8
§4 管理人报告 .....	8
§5 托管人报告 .....	13
§6 审计报告 .....	14
§7 年度财务报表 .....	16
7.1 资产负债表 .....	16
7.2 利润表 .....	17
7.3 净资产变动表 .....	18
7.4 报表附注 .....	20
§8 投资组合报告 .....	48
8.1 期末基金资产组合情况 .....	48
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	49
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 .....	49
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	64
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	65
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 .....	65
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	65
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	65
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	65
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	65
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	65
8.12 投资组合报告附注 .....	66
§9 基金份额持有人信息 .....	66
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	66
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	67
9.3 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 .....	67
§10 开放式基金份额变动 .....	67
§11 重大事件揭示 .....	67
§12 影响投资者决策的其他重要信息 .....	70
§13 备查文件目录 .....	70

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华夏智胜新锐股票型证券投资基金	
基金简称	华夏智胜新锐股票	
基金主代码	018728	
交易代码	018728	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2023 年 7 月 7 日	
基金管理人	华夏基金管理有限公司	
基金托管人	广发证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	693,565,005.94 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华夏智胜新锐股票 A	华夏智胜新锐股票 C
下属分级基金的交易代码	018728	018729
报告期末下属分级基金的份额总额	251,684,271.64 份	441,880,734.30 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在合理控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报，力求实现基金资产的稳健增值。
投资策略	本基金的投资策略包括资产配置策略、股票投资策略、固定收益品种投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略、股票期权投资策略等。 股票投资策略部分，本基金在股票投资方面主要采用量化模型选股、基本面选股等多种策略构建投资组合，同时运用数量化方法优化组合交易并控制组合风险，实现超额收益。
业绩比较基准	中证 1000 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%。
风险收益特征	本基金为股票型基金，80%-95%的基金资产投资于股票，其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华夏基金管理有限公司	广发证券股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李彬	罗琦
	联系电话	400-818-6666	020-66338888
	电子邮箱	service@ChinaAMC.com	gzluoqi@gf.com.cn
客户服务电话		400-818-6666	95575
传真		010-63136700	020-87553363-6847
注册地址		北京市顺义区安庆大街甲3号院	广东省广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街2号618室
办公地址		北京市朝阳区北辰西路6号院	广州市天河区马场路26号广发证券

	北辰中心C座5层	大厦34楼
邮政编码	100101	510627
法定代表人	张佑君	林传辉

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.ChinaAMC.com
基金年度报告备置地点	基金管理人和/或基金托管人的住所/办公地址

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)	北京市东城区东长安街 1 号东方广场东 2 座办公楼 8 层
注册登记机构	华夏基金管理有限公司	北京市朝阳区北辰西路 6 号院北辰中心 C 座 5 层

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据 和指标	2024 年		2023 年 7 月 7 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日	
	华夏智胜新锐股票 A	华夏智胜新锐股票 C	华夏智胜新锐股票 A	华夏智胜新锐股票 C
本期已实现收益	-16,502,014.27	-17,379,840.04	-2,706,732.13	-4,430,444.07
本期利润	-24,088,931.95	-14,341,535.08	-9,498,708.40	-14,109,037.54
加权平均基金份额本期利润	-0.0611	-0.0191	-0.0162	-0.0152
本期加权平均净值利润率	-6.85%	-2.15%	-1.66%	-1.56%
本期基金份额净值增长率	4.50%	4.08%	-1.54%	-1.73%
3.1.2 期末数据 和指标	2024 年末		2023 年末	
	华夏智胜新锐股票 A	华夏智胜新锐股票 C	华夏智胜新锐股票 A	华夏智胜新锐股票 C
期末可供分配利润	7,280,469.98	10,090,073.01	-9,543,332.66	-16,344,949.34
期末可供	0.0289	0.0228	-0.0154	-0.0173

分配基金份额利润				
期末基金资产净值	258,964,741.62	451,970,807.31	608,693,998.92	925,982,042.30
期末基金份额净值	1.0289	1.0228	0.9846	0.9827
3.1.3 累计期末指标	2024 年末		2023 年末	
	华夏智胜新锐股票 A	华夏智胜新锐股票 C	华夏智胜新锐股票 A	华夏智胜新锐股票 C
基金份额累计净值增长率	2.89%	2.28%	-1.54%	-1.73%

注：①所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

②本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

③期末可供分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华夏智胜新锐股票 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	8.43%	2.08%	4.23%	2.28%	4.20%	-0.20%
过去六个月	21.97%	1.97%	20.68%	2.13%	1.29%	-0.16%
过去一年	4.50%	2.00%	1.41%	2.01%	3.09%	-0.01%
自基金合同生效起至今	2.89%	1.70%	-8.55%	1.73%	11.44%	-0.03%

华夏智胜新锐股票 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	8.32%	2.08%	4.23%	2.28%	4.09%	-0.20%
过去六个月	21.72%	1.97%	20.68%	2.13%	1.04%	-0.16%
过去一年	4.08%	1.99%	1.41%	2.01%	2.67%	-0.02%
自基金合同生效起至今	2.28%	1.70%	-8.55%	1.73%	10.83%	-0.03%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

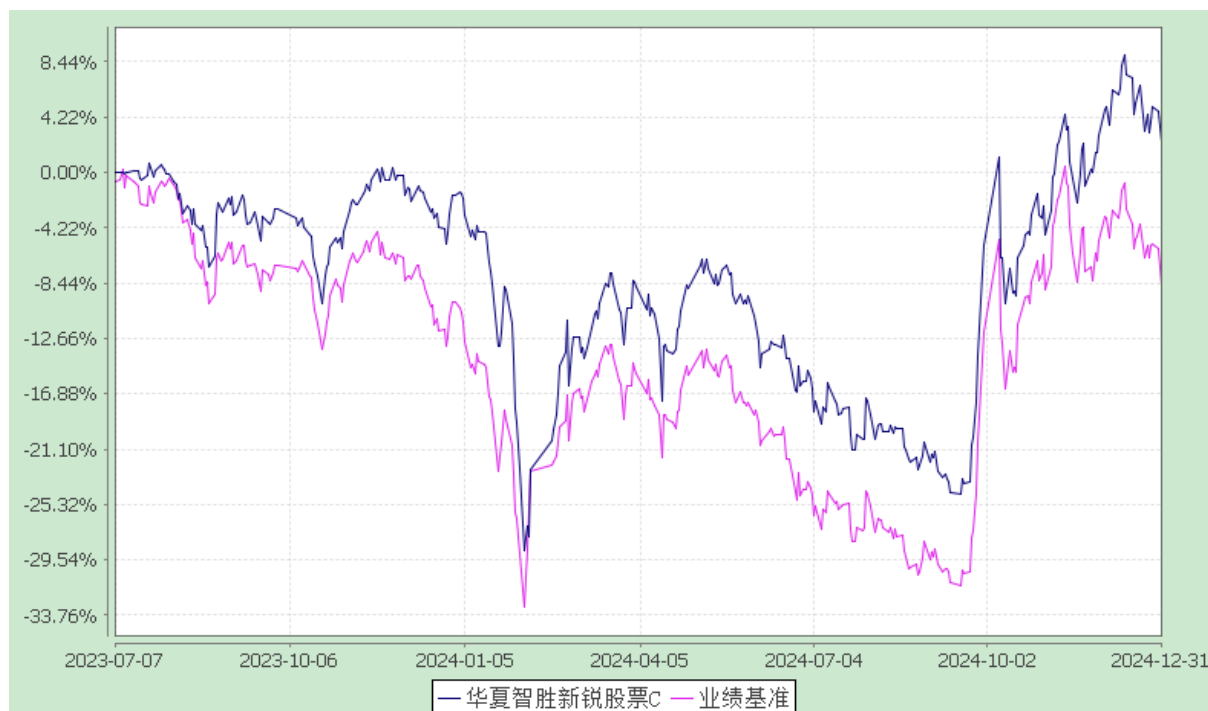
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2023 年 7 月 7 日至 2024 年 12 月 31 日)

### 华夏智胜新锐股票 A



### 华夏智胜新锐股票 C



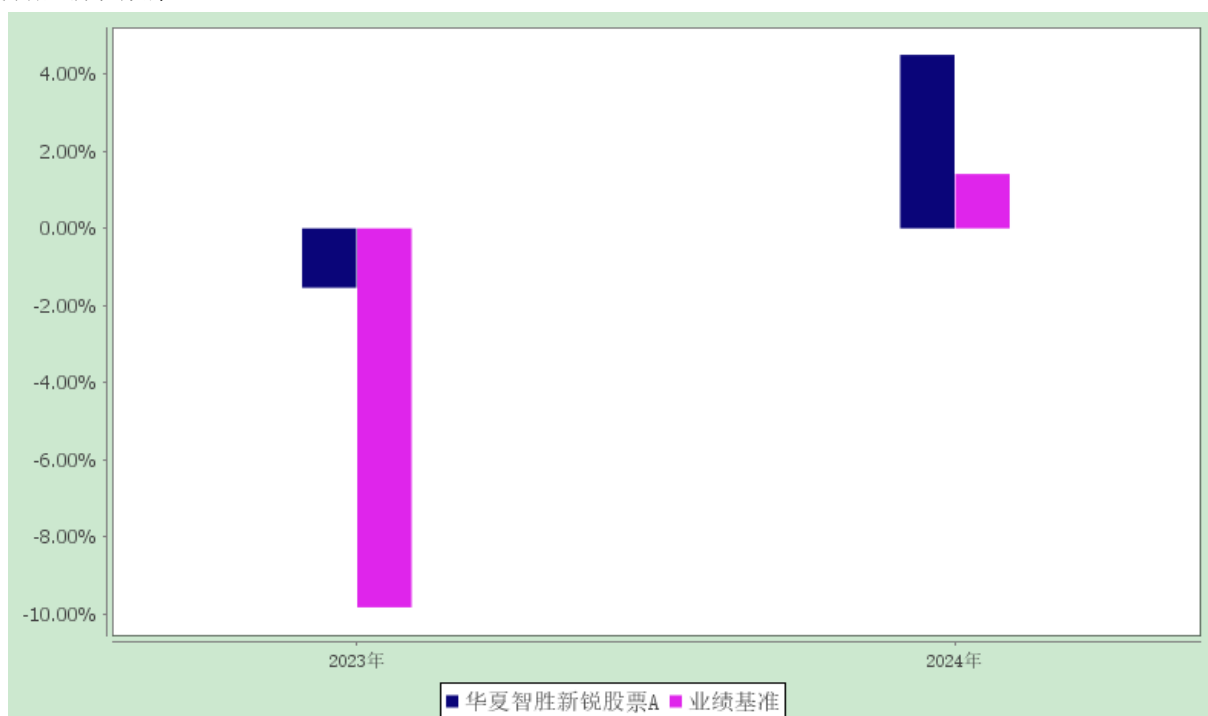
注：根据本基金的基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同中投资范围、投资限制的有关约定。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

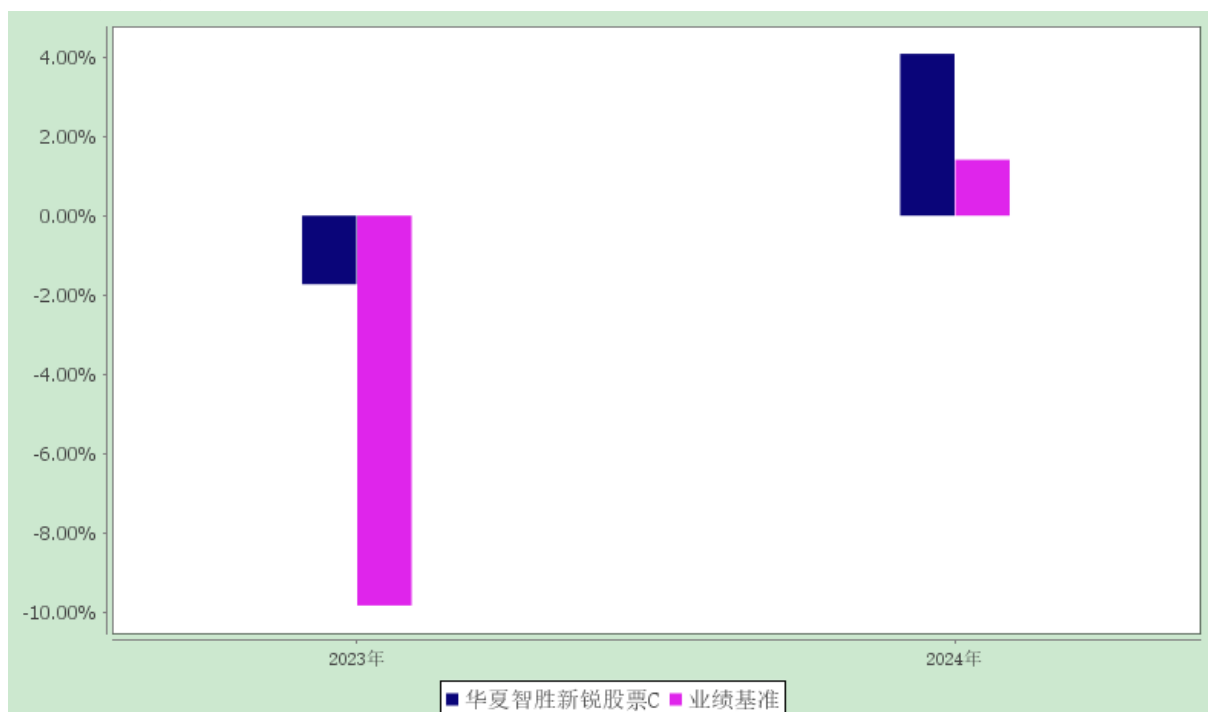
# 华夏智胜新锐股票型证券投资基金

自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图

## 华夏智胜新锐股票 A



## 华夏智胜新锐股票 C



注：本基金合同于 2023 年 7 月 7 日生效，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自基金合同生效以来无利润分配事项。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

华夏基金管理有限公司成立于 1998 年 4 月 9 日，是经中国证监会批准成立的首批全国性基金管理公司之一。公司总部设在北京，在北京、上海、深圳、成都、南京、杭州、广州、青岛、武汉及沈阳设有分公司，在香港、深圳、上海、北京设有子公司。公司是首批全国社保基金管理人、首批企业年金基金管理人、境内首批 QDII 基金管理人、境内首只 ETF 基金管理人、境内首只沪港通 ETF 基金管理人、首批内地与香港基金互认基金管理人、首批基本养老保险基金投资管理人资格、首家加入联合国责任投资原则组织的公募基金公司、首批公募 FOF 基金管理人、首批公募养老目标基金管理人、首批个人养老金基金管理人、境内首批中日互通 ETF 基金管理人、首批商品期货 ETF 基金管理人、首批公募 MOM 基金管理人、首批纳入互联互通 ETF 基金管理人、首批北交所主题基金管理人以及特定客户资产管理人、保险资金投资管理人、公募 REITs 管理人，境内首家承诺“碳中和”具体目标和路径的公募基金公司，香港子公司是首批 RQFII 基金管理人。华夏基金是业务领域最广泛的基金管理公司之一。

华夏基金是境内权益 ETF 管理规模最大的基金管理公司之一，在指数基金管理方面积累了丰富的经验，形成了覆盖宽基、港股、行业主题、策略、跨境、商品等较为完整的指数产品线。

华夏基金以深入的投资研究为基础，尽力捕捉市场机会，为投资人谋求良好的回报。根据银河证券基金研究中心《中国基金业绩评价报告》，截至 2024 年 12 月 31 日，华夏基金旗下多只产品近 1 年同类排名领先（基金排名不作为产品未来表现的保证），其中：

主动权益产品：在消费行业偏股型基金(A 类)中华夏消费臻选混合发起式(A 类)排名第 1/81；在新能源主题行业偏股型基金(A 类)中华夏清洁能源龙头混合发起式(A 类)排名第 1/27；在北交所主题偏股型基金(A 类)中华夏北交所创新中小企业精选两年定开混合发起式排名第 1/11；在标准股票型基金(A 类)中华夏优势精选股票排名第 2/336、华夏潜龙精选股票排名第 15/336、华夏创新前沿股票排名第 64/336；在汽车主题行业偏股型基金(A 类)中华夏新能源车龙头混合发起式(A 类)排名第 3/16；在港股通标准股票型基金(A 类)中华夏港股通精选股票（LOF）(A 类)排名第 3/14；在 QDII 混合基金(A 类)中华夏全球科技先锋混合（QDII）排名第 5/51；在偏股型基金(股票上限 80%)(A 类)中华夏

经典混合排名第 5/148、华夏常阳三年定开混合排名第 19/148、华夏策略混合排名第 29/148；在 TMT 与信息技术行业偏股型基金(A 类)中华夏半导体龙头混合发起式(A 类)排名第 11/47；在医药医疗健康行业偏股型基金(A 类)中华夏乐享健康混合(A 类)排名第 13/78；在 QDII 股票型基金(A 类)中华夏全球股票（QDII）排名第 14/72；在偏股型基金(股票上下限 60%-95%)(A 类)中华夏见龙精选混合排名第 13/1719、华夏阿尔法精选混合(A 类)排名第 40/1719、华夏融盛可持续一年持有混合(A 类)排名第 101/1719、华夏远见成长一年持有混合(A 类)排名第 169/1719、华夏 ESG 可持续投资一年持有混合(A 类)排名第 177/1719、华夏先进制造龙头混合(A 类)排名第 184/1719、华夏行业景气混合排名第 214/1719、华夏景气成长一年持有混合发起式(A 类)排名第 257/1719、华夏科技前沿 6 个月定开混合(A 类)排名第 278/1719；在灵活配置型基金(基准股票比例 30%-60%)(A 类)中华夏磐晟混合（LOF）排名第 28/425、华夏高端制造混合(A 类)排名第 64/425、华夏新机遇混合(A 类)排名第 76/425；在偏股型基金(股票上限 95%)(A 类) 华夏新兴经济一年持有混合(A 类)排名第 34/221、华夏大盘精选混合(A 类)排名第 49/221。

固收与固收+产品：在信用债指数债券型基金(A 类)中华夏亚债中国指数(A 类)排名第 1/18；在普通债券型基金(可投转债)(A 类)中华夏双债债券(A 类)排名第 2/246；在定开纯债债券型基金(A 类)中华夏鼎华一年定开债券排名第 9/647、华夏鼎誉三个月定开债券(A 类)排名第 51/647；在定开普通债券型基金(二级)(A 类)中华夏卓信一年定开债券发起式排名第 11/24；在可转换债券型基金(A 类)中华夏可转债增强债券(A 类)排名第 12/38；在普通偏债型基金(股票上限不高于 30%)(A 类)中华夏磐泰混合（LOF）(A 类)排名第 14/333；在中短期纯债债券型基金(A 类)中华夏中短债债券(A 类)排名第 15/165；在定开普通债券型基金(可投转债)(A 类)中华夏鼎禄三个月定开债券(A 类)排名第 22/157、华夏鼎福三个月定开债券(A 类)排名第 31/157；在长期纯债债券型基金(A 类)中华夏鼎茂债券(A 类)排名第 20/851、华夏鼎通债券(A 类)排名第 37/851；在普通债券型基金(二级)(A 类)中华夏稳享增利 6 个月债券(A 类)排名第 79/443。

指数产品：在标准策略指数股票型基金(A 类)中华夏上证 50AH 优选指数（LOF）(A 类)排名第 6/25；在策略指数股票 ETF 基金中华夏中证智选 300 价值稳健策略 ETF 排名第 8/48；在规模指数股票 ETF 基金中华夏 MSCI 中国 A50 互联互通 ETF 排名第 14/161、华夏中证沪港深 500ETF 排名第 20/161、华夏上证 50ETF 排名第 29/161；在行业指数股票 ETF 基金中华夏中证银行 ETF 排名第 5/72、华夏中证全指证券公司 ETF 排名第 15/72；在增强规模指数股票型基金(A 类)中华夏沪深 300 指数增强(A 类)排名第 5/191、华夏上证科创板 50 成份指数增强发起式(A 类)排名第 17/191；在主题指数股票 ETF 基金中华夏金融 ETF 发起式排名第 2/357、华夏国证半导体芯片 ETF 排名第 19/357、华夏中证金融科技主题 ETF 排名第 21/357、华夏中证 5G 通信主题 ETF 排名第 60/357、华夏中证人工智能

主题 ETF 排名第 72/357、华夏中证云计算与大数据主题 ETF 排名第 83/357。

在客户服务方面，2024 年，华夏基金继续以客户需求为导向，努力提高客户使用的便利性和服务体验：（1）华夏基金直销渠道继续优化页面显示，升级搜索及查询功能，给客户更方便、直观的使用感受；（2）华夏基金管家客户端从客户需求出发持续优化操作页面，进一步提升操作体验；（3）与常熟农商银行、长春农商银行、贵文基金等代销机构合作，拓展更加丰富的客户理财渠道；（4）开展“送你长期主义的花朵”、“换个角度，世界可能不一样”、“聊聊新赛道”等活动，为客户提供了多样化的投资者教育和关怀服务。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
孙蒙	本基金的基金经理	2023-07-07	-	10 年	硕士。曾任中信建投证券股份有限公司研究员、投资经理等。2017 年 7 月加入华夏基金管理有限公司。历任数量投资部研究员、基金经理助理。
叶津佐	本基金的基金经理助理	2023-10-19	-	7 年	博士。2017 年 7 月加入华夏基金管理有限公司。历任数量投资部研究员。

注：①上述“任职日期”和“离任日期”为根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。首任基金经理的，其“任职日期”为基金合同生效日。

②证券从业的含义遵从行业协会《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.1.3 基金经理薪酬机制

本基金管理人旗下基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的，公司对其进行年度综合考核，考核结果作为确定其薪酬激励的重要参考因素之一。因此，基金经理个人薪酬激励与其管理的私募资产管理计划浮动管理费或产品业绩表现不直接挂钩。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《基金管理公司开展投资、研究活动防控内幕交易指导意见》等法律法规和基金合同，本着诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在严格控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损

害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规制定了《华夏基金管理有限公司公平交易制度》。公司通过科学、制衡的投资决策体系,加强交易分配环节的内部控制,并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时,通过监察稽核、事后分析和信息披露来保证公平交易过程和结果的监督。

##### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合,制定并严格遵守相应的制度和流程,通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内,本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《华夏基金管理有限公司公平交易制度》的规定。

###### 4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

本基金管理人一贯严格执行公平交易原则,对兼任基金经理的交易情况进行持续监测。本年度所有相关组合的交易行为均符合法规、制度和流程要求,未发现违反公平交易原则的情况。本年度同一基金经理管理的不同组合在邻近交易日的同向和反向交易,交易时机和交易价差均可合理解释,未发现异常。

本基金管理人根据《基金经理兼任私募资产管理计划投资经理工作指引(试行)》要求,针对同经理管理多个组合间的收益率差异进行归因分析,本年度各组合间收益率差异均属正常情况,主要原因为业绩基准不同、投资策略不同,收益率差异可以合理解释。

##### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内,本基金管理人旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中,同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的交易共有 197 次,其中 1 次为不同基金经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易,有关基金经理已根据公司管理要求提供决策依据;其余均为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2024 年,国际环境错综复杂,世界经济增长动能不足,地缘政治冲突加剧,贸易保护主义愈演愈烈;主要经济体表现分化,各国央行在应对通胀和促进经济增长之间艰难权衡,货币政策趋向差异明显。面对外部压力加大、内部困难增多的复杂严峻形势,我国经济运行稳中有进,高质量发展

扎实推进。一揽子增量政策及时出台，有效提振了社会信心，促进经济回升向好；新质生产力稳步发展，传统动能焕新升级、新动能积厚成势，高质量发展取得新成效。

市场方面，A 股市场 2024 年走势跌宕起伏，全年主要涨幅由三季度末的快速上涨贡献，而这得益于一系列稳经济稳增长、呵护市场流动性、推动资本市场高质量发展举措的连续出台。从市场风格来看，高股息板块凭借其稳健属性成为资金避险的核心方向，全年涨幅领跑市场，大盘价值股整体表现显著优于小盘成长股。

基金投资运作方面，本基金以多因子量化投资策略为主，我们在依据量化模型进行股票投资决策之外，还积极参与了科创板、创业板新股申购，获取较为确定性的收益增厚机会。同时，本基金秉承尽职尽责的态度，认真应对投资者日常申购、赎回等工作。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2024 年 12 月 31 日，华夏智胜新锐股票 A 基金份额净值为 1.0289 元，本报告期份额净值增长率为 4.50%；华夏智胜新锐股票 C 基金份额净值为 1.0228 元，本报告期份额净值增长率为 4.08%，同期业绩比较基准增长率为 1.41%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2025 年，政府将采取适度宽松的货币政策和更加积极的财政政策，并且要大力提振消费、提高投资效益，全方位扩大国内需求。积极的政策有利于 A 股上市公司盈利增速回升，但是政策的节奏和力度存在不确定性。预计市场震荡向上，风格呈现轮动特征，建议均衡配置。

珍惜基金份额持有人的每一分投资和每一份信任，本基金将继续奉行华夏基金管理有限公司“为信任奉献回报”的经营理念，规范运作，审慎投资，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求长期、稳定的回报。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人持续加强合规管理、风险控制和监察稽核工作。

在合规管理方面，公司通过合规审核、合规检查、合规咨询、合规宣传与合规培训等对合规风险进行管理，确保公司合规体系高效运行，合规风险有效控制。报告期内，公司不断加强合规制度建设，结合法律法规和业务实际，在廉洁从业风险防控、信息披露、洗钱风险管理等方面新增和修订多项管理制度，制度化水平显著提高。持续开展合规培训，在全员覆盖的基础上，着重加强投资研究和基金销售等重点业务领域的合规督导培训，强化员工主动合规意识和公募基金信息披露责任意识。持续优化合规管理的机制化和系统化，完善合规管理综合服务平台，提高合规管理效能。持续做好信息披露业务，通过流程优化、系统优化及强化培训持续保障信息披露的完整性、准确性、及时性。持续规范基金销售业务，通过严格审查宣传推介材料，认真开展投资者适当性管理工作等，

确保基金销售业务依法合规。公司高度重视洗钱风险管理，深入实践风险为本方法，认真贯彻落实各项反洗钱监管要求，持续加强“风险评估+合规检查”双支柱管理框架，深入推进洗钱风险管理数智化转型，持续提升洗钱风险管理水平。

在风险控制方面，公司秉承数字化管理理念，持续完善内部风险管理系统建设，稳步夯实投资风险风险管理基础。紧密跟踪各项法律法规要求、加强风险研究，在严格管控基金日常投资运作风险的同时，持续完善风险管理制度建设，提升基金流动性风险、市场风险、合规风险、操作风险等关键风险的管控水平，努力保障各项风险管理措施落实到位。

在监察稽核方面，公司按照法规要求，做好日常合规监控，定期及不定期开展内部检查，排查业务风险隐患，促进公司整体业务合规运作、稳健经营。

报告期内，本基金管理人所管理的基金整体运作合法合规。本基金管理人将继续以风险控制为核心，坚持基金份额持有人利益优先的原则，提高监察稽核工作的科学性和有效性，切实保障基金合规稳健运作。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及基金合同约定，本基金管理人作为准确、及时进行基金估值和份额净值计价，制定了基金估值和份额净值计价的业务管理制度，建立了估值委员会，使用可靠的估值业务系统，设有完善的风险监测、控制和报告机制。本基金托管人审阅本基金管理人采用的估值原则及技术，并复核、审查基金资产净值和基金份额申购、赎回价格。会计师事务所对估值调整导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上时对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性发表专业意见。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

#### 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

## §5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对华夏智胜新锐股票型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金托管业务管理办法》等相关法律法规的规定和基金

合同、托管协议的约定勤勉履行基金托管人职责，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

## 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，华夏基金管理有限公司在本基金各重要方面的运作符合基金合同、托管协议的约定，本基金托管人未发现本基金在投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支及利润分配等方面存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

## 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对华夏基金管理有限公司编制和披露的华夏智胜新锐股票型证券投资基金 2024 年年度报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

# §6 审计报告

毕马威华振审字第 2506313 号

华夏智胜新锐股票型证券投资基金全体基金份额持有人：

## 6.1 审计意见

我们审计了后附的华夏智胜新锐股票型证券投资基金（以下简称“该基金”）财务报表，包括 2024 年 12 月 31 日的资产负债表，2024 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。

我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则（以下简称“企业会计准则”）及财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制，公允反映了该基金 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度的经营成果和净资产变动情况。

## 6.2 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则（以下简称“审计准则”）的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于该基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

## 6.3 其他信息

该基金管理人华夏基金管理有限公司（以下简称“该基金管理人”）管理层对其他信息负责。其他信息包括该基金 2024 年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。

我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结

论。

结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。

基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。

#### 6.4 管理层和治理层对财务报表的责任

该基金管理人管理层负责按照企业会计准则及财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时，该基金管理人管理层负责评估该基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项 (如适用)，并运用持续经营假设，除非该基金预计在清算时资产无法按照公允价值处置。

该基金管理人治理层负责监督该基金的财务报告过程。

#### 6.5 注册会计师对财务报表审计的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

(3) 评价该基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

(4) 对该基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对该基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告



日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致该基金不能持续经营。

(5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

我们与该基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）                      中国注册会计师  
王国蓓    管祎铭  
北京市东城区东长安街 1 号东方广场东 2 座办公楼 8 层  
2025 年 3 月 27 日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：华夏智胜新锐股票型证券投资基金

报告截止日：2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	7.4.7.1	46,007,958.61	89,642,984.45
结算备付金		2,376,565.51	2,069,768.62
存出保证金		423,460.80	1,964,457.60
交易性金融资产	7.4.7.2	668,693,250.97	1,440,221,308.32
其中：股票投资		668,693,250.97	1,439,467,258.74
基金投资		-	-
债券投资		-	754,049.58
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		1,516,279.54	7,400,169.44
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-

资产总计		719,017,515.43	1,541,298,688.43
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		6,940,872.60	4,675,582.39
应付管理人报酬		662,777.43	1,281,773.78
应付托管费		132,555.49	256,354.78
应付销售服务费		169,244.21	308,472.05
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	1.96
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	176,516.77	100,462.25
负债合计		8,081,966.50	6,622,647.21
净资产:			
实收基金	7.4.7.7	693,565,005.94	1,560,564,323.22
未分配利润	7.4.7.8	17,370,542.99	-25,888,282.00
净资产合计		710,935,548.93	1,534,676,041.22
负债和净资产总计		719,017,515.43	1,541,298,688.43

注：①报告截止日 2024 年 12 月 31 日，华夏智胜新锐股票 A 基金份额净值 1.0289 元，华夏智胜新锐股票 C 基金份额净值 1.0228 元；华夏智胜新锐股票基金份额总额 693,565,005.94 份（其中 A 类 251,684,271.64 份，C 类 441,880,734.30 份）。

②本基金合同于 2023 年 7 月 7 日生效，上年度可比期间自 2023 年 7 月 7 日至 2023 年 12 月 31 日。

7.2 利润表

会计主体：华夏智胜新锐股票型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 7 月 7 日（基 金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
一、营业总收入		-23,355,852.73	-13,175,083.76
1.利息收入		268,521.89	723,543.74
其中：存款利息收入	7.4.7.9	268,521.89	433,035.86

债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	290,507.88
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-19,861,155.50	1,570,453.70
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-35,451,311.12	-1,054,025.68
基金投资收益	7.4.7.11	-	-
债券投资收益	7.4.7.12	236,309.89	1,104,841.61
资产支持证券投资收益	7.4.7.13	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-1,379,179.27	-973,786.24
股利收益	7.4.7.16	16,733,025.00	2,493,424.01
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-4,548,612.72	-16,470,569.74
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	785,393.60	1,001,488.54
<b>减：二、营业总支出</b>		15,074,614.30	10,432,662.18
1.管理人报酬		10,194,532.25	7,152,568.86
2.托管费		2,038,906.39	1,430,513.89
3.销售服务费		2,666,175.10	1,748,777.95
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.信用减值损失	7.4.7.20	-	-
7.税金及附加		0.56	1.48
8.其他费用	7.4.7.21	175,000.00	100,800.00
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-38,430,467.03	-23,607,745.94
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-38,430,467.03	-23,607,745.94
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-38,430,467.03	-23,607,745.94

注：本基金合同于 2023 年 7 月 7 日生效，上年度可比期间自 2023 年 7 月 7 日至 2023 年 12 月 31 日。

### 7.3 净资产变动表

会计主体：华夏智胜新锐股票型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	1,560,564,323.22	-25,888,282.00	1,534,676,041.22
二、本期期初净资产	1,560,564,323.22	-25,888,282.00	1,534,676,041.22
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-866,999,317.28	43,258,824.99	-823,740,492.29
(一)、综合收益总额	-	-38,430,467.03	-38,430,467.03
(二)、本期基金份额 交易产生的净资产变 动数(净资产减少以 “-”号填列)	-866,999,317.28	81,689,292.02	-785,310,025.26
其中: 1.基金申购款	624,787,106.54	-55,755,845.76	569,031,260.78
2.基金赎回款	- 1,491,786,423.82	137,445,137.78	-1,354,341,286.04
(三)、本期向基金份 额持有人分配利润产 生的净资产变动(净 资产减少以“-”号填 列)	-	-	-
四、本期期末净资产	693,565,005.94	17,370,542.99	710,935,548.93
项目	上年度可比期间 2023 年 7 月 7 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-
二、本期期初净资产	1,500,299,612.84	-	1,500,299,612.84
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	60,264,710.38	-25,888,282.00	34,376,428.38
(一)、综合收益总额	-	-23,607,745.94	-23,607,745.94
(二)、本期基金份额 交易产生的净资产变 动数(净资产减少以 “-”号填列)	60,264,710.38	-2,280,536.06	57,984,174.32
其中: 1.基金申购款	626,461,400.67	-13,450,746.03	613,010,654.64
2.基金赎回款	-566,196,690.29	11,170,209.97	-555,026,480.32
(三)、本期向基金份 额持有人分配利润产 生的净资产变动(净 资产减少以“-”号填 列)	-	-	-
四、本期期末净资产	1,560,564,323.22	-25,888,282.00	1,534,676,041.22

注: 本基金合同于 2023 年 7 月 7 日生效, 上年度可比期间自 2023 年 7 月 7 日至 2023 年 12 月 31 日。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：张佑君，主管会计工作负责人：朱威，会计机构负责人：朱威

#### 7.4 报表附注

##### 7.4.1 基金基本情况

华夏智胜新锐股票型证券投资基金（以下简称“本基金”）已获中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2023]1260 号文《关于准予华夏智胜新锐股票型证券投资基金注册的批复》，由华夏基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《华夏智胜新锐股票型证券投资基金基金合同》及其他有关法律法规负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限为不定期。本基金自 2023 年 6 月 28 日至 2023 年 7 月 5 日共募集 1,499,978,350.33 元（不含认购资金利息），业经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）安永华明（2023）验字第 60739337\_A33 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华夏智胜新锐股票型证券投资基金基金合同》于 2023 年 7 月 7 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,500,299,612.84 份基金份额，其中认购资金利息折合 321,262.51 份基金份额。本基金的基金管理人为华夏基金管理有限公司，基金托管人为广发证券股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和本基金基金合同的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行或上市的股票（包括创业板、存托凭证及其他中国证监会注册或核准上市的股票）、债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、衍生品（包括股指期货、国债期货、股票期权）、资产支持证券、货币市场工具（含同业存单）、债券回购、银行存款以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

本基金可根据相关法律法规和《基金合同》的约定，参与融资业务。本基金的投资组合比例为：股票投资占基金资产的比例为 80%-95%。每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

##### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布和修订的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则(以下合称“企业会计准则”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会发布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告

和中期报告》和中国证监会、中国基金业协会允许的如财务报表附注 7.4.4 所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

##### 1、金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

##### （1）债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益。基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资、资产支持证

券投资和基金投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

## （2）权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

## 2、金融负债的分类

本基金的金融负债于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

## 3、衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，其公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益。

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益。

本基金对以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础，进行减值处理并确认损失准备。本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预

期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况。当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产。当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

1、存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

2、当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持



的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

3、如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。对于曾经实施份额拆分或折算的基金，由于基金份额拆分或折算引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日或基金份额折算日根据拆分前或折算前的基金份额数及确定的拆分或折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。对于已开放转换业务的基金，上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/（累计亏损）。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

境内基金投资在持有期间应取得的现金红利于除息日确认为投资收益；境外基金投资在持有期间应取得的基金分红收益扣除基金交易所在地适用的预缴所得税后的净额确认投资收益。境内股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益；境外股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除股票交易所在地适用的预缴所得税后的净额确认为投资收益。境内债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。境外债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在交易所在地适用的预缴所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值

变动损益；处置时其公允价值与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的按直线法近似计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

针对基金合同约定费率和计算方法的费用，本基金在费用涵盖期间按合同约定进行确认。

其他以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的按直线法近似计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

同一类别内的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红权益再投资日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。期末可供分配利润指期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

由于本基金各基金份额类别在费用收取上不同，其对应的可分配收益可能有所不同。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

#### 7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

1、对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

2、对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6 号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》进行估值。

3、对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566 号《关于发布<关于固定收益品种的估值处理标准>的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证

券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外),按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场交易的固定收益品种,按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 7.4.6 税项

根据财税[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]103 号《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81 号《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]125 号《财政部、国家税务总局、证监会关于内地与香港基金互认有关税收政策的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《财政部、国家税务总局关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《财政部、国家税务总局关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2023]39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1) 以发行基金方式募集资金不属于增值税征收范围,不征收增值税。

(2) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为,以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为,暂适用简易计税方法,按照 3% 的征收率缴纳增值税。

(3) 基金买卖股票、债券的差价收入免征增值税,暂不征收企业所得税。

(4) 存款利息收入不征收增值税。

(5) 国债、地方政府债利息收入，金融同业往来利息收入免征增值税。

(6) 对基金取得的债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(7) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(8) 对基金在境内取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利收入时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不征收企业所得税。基金在境内从上市公司分配取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，全额计入应纳税所得额，持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，减按 50% 计入应纳税所得额，持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。对香港市场投资者取得的股息、红利收入按照 10% 的税率代扣所得税。

(9) 基金在境内卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(10) 基金在境外证券交易所进行交易或取得的源自境外证券市场的收益，其涉及的税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行。

(11) 本基金分别按实际缴纳的增值税额的 7%、3%、2% 缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
活期存款	4,263,458.03	10,398,119.92
等于：本金	4,261,037.76	10,393,616.21
加：应计利息	2,420.27	4,503.71
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-

其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	41,744,500.58	79,244,864.53
等于：本金	41,743,195.77	79,239,307.83
加：应计利息	1,304.81	5,556.70
合计	46,007,958.61	89,642,984.45

注：其他存款为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末			
		2024 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		689,617,213.43	-	668,693,250.97	-20,923,962.46
贵金属投资- 金交所黄金 合约		-	-	-	-
债券	交易所市 场	-	-	-	-
	银行间市 场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证 券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		689,617,213.43	-	668,693,250.97	-20,923,962.46
项目		上年度末			
		2023 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		1,455,728,878.48	-	1,439,467,258.74	-16,261,619.74
贵金属投资- 金交所黄金 合约		-	-	-	-
债券	交易所市 场	754,000.00	49.58	754,049.58	-
	银行间市 场	-	-	-	-

	场				
	合计	754,000.00	49.58	754,049.58	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		1,456,482,878.48	49.58	1,440,221,308.32	-16,261,619.74

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	3,624,060.00	-	-	-
其中：股指期货	3,624,060.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	3,624,060.00	-	-	-
项目	上年度末 2023 年 12 月 31 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	16,579,430.00	-	-	-
其中：股指期货	16,579,430.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	16,579,430.00	-	-	-

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IM2503	中证 1000 期货 IM2503 合约	3	3,528,840.00	-95,220.00
合计	-	-	-	-95,220.00
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	-95,220.00
净额				-

注：衍生金融资产项下的利率/权益/其他衍生工具为国债/股指/商品期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指/商品/国债期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指/商品/国债期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净

额为 0。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

7.4.7.5 其他资产

无。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	1,516.77	462.25
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	-	-
其中：交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	175,000.00	100,000.00
合计	176,516.77	100,462.25

7.4.7.7 实收基金

华夏智胜新锐股票 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	618,237,331.58	618,237,331.58
本期申购	89,329,412.55	89,329,412.55
本期赎回（以“-”号填列）	-455,882,472.49	-455,882,472.49
本期末	251,684,271.64	251,684,271.64

华夏智胜新锐股票 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	942,326,991.64	942,326,991.64

本期申购	535,457,693.99	535,457,693.99
本期赎回（以“-”号填列）	-1,035,903,951.33	-1,035,903,951.33
本期末	441,880,734.30	441,880,734.30

#### 7.4.7.8 未分配利润

##### 华夏智胜新锐股票 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-2,422,385.05	-7,120,947.61	-9,543,332.66
本期期初	-2,422,385.05	-7,120,947.61	-9,543,332.66
本期利润	-16,502,014.27	-7,586,917.68	-24,088,931.95
本期基金份额交易产生的变动数	33,474,239.68	7,438,494.91	40,912,734.59
其中：基金申购款	-6,810,121.90	803,000.89	-6,007,121.01
基金赎回款	40,284,361.58	6,635,494.02	46,919,855.60
本期已分配利润	-	-	-
本期末	14,549,840.36	-7,269,370.38	7,280,469.98

##### 华夏智胜新锐股票 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-5,475,736.68	-10,869,212.66	-16,344,949.34
本期期初	-5,475,736.68	-10,869,212.66	-16,344,949.34
本期利润	-17,379,840.04	3,038,304.96	-14,341,535.08
本期基金份额交易产生的变动数	45,654,046.72	-4,877,489.29	40,776,557.43
其中：基金申购款	-46,403,912.71	-3,344,812.04	-49,748,724.75
基金赎回款	92,057,959.43	-1,532,677.25	90,525,282.18
本期已分配利润	-	-	-
本期末	22,798,470.00	-12,708,396.99	10,090,073.01

#### 7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 7 月 7 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	140,627.23	280,268.38
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	96,593.00	135,805.02
结算备付金利息收入	31,249.36	16,962.46
其他	52.30	-
合计	268,521.89	433,035.86

注：其他存款利息收入为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金产生的利息



收入。

7.4.7.10 股票投资收益

7.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 7 月 7 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-35,451,311.12	-1,054,025.68
股票投资收益——赎回差价收入	-	-
股票投资收益——申购差价收入	-	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-	-
合计	-35,451,311.12	-1,054,025.68

7.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 7 月 7 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	8,072,133,972.91	3,367,118,881.39
减：卖出股票成本总额	8,099,315,578.64	3,363,424,559.53
减：交易费用	8,269,705.39	4,748,347.54
买卖股票差价收入	-35,451,311.12	-1,054,025.68

7.4.7.11 基金投资收益

无。

7.4.7.12 债券投资收益

7.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年7月7日（基金合同生效日）至2023年12月31日
债券投资收益——利息收入	499.22	403.90
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	235,810.67	1,104,437.71
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-

入		
合计	236,309.89	1,104,841.61

7.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年7月7日（基金合同生效日）至2023年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	2,369,945.10	3,901,760.69
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	2,126,600.00	2,796,800.00
减：应计利息总额	7,479.85	366.73
减：交易费用	54.58	156.25
买卖债券差价收入	235,810.67	1,104,437.71

7.4.7.13 资产支持证券投资收益

无。

7.4.7.14 贵金属投资收益

无。

7.4.7.15 衍生工具收益

7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年7月7日（基金合同生效日）至2023年12月31日
股指期货投资收益	-1,379,179.27	-973,786.24

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年7月7日（基金合同生效日）至2023年12月31日
股票投资产生的股利收益	16,733,025.00	2,493,424.01
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	16,733,025.00	2,493,424.01

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年1月1日至2024年12月31 日	上年度可比期间 2023年7月7日（基金合同生效 日）至2023年12月31日
1.交易性金融资产	-4,662,342.72	-16,261,619.74
——股票投资	-4,662,342.72	-16,261,619.74
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	113,730.00	-208,950.00
——权证投资	-	-
——期货投资	113,730.00	-208,950.00
3.其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变 动产生的预估增值税	-	-
合计	-4,548,612.72	-16,470,569.74

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年7月7日（基金合同生效 日）至2023年12月31日
基金赎回费收入	785,393.60	1,001,488.54
合计	785,393.60	1,001,488.54

7.4.7.19 持有基金产生的费用

无。

7.4.7.20 信用减值损失

无。

7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31 日	上年度可比期间 2023年7月7日（基金合同生效 日）至2023年12月31日
审计费用	55,000.00	40,000.00
信息披露费	120,000.00	60,000.00
证券出借违约金	-	-

其他	-	800.00
合计	175,000.00	100,800.00

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
华夏基金管理有限公司	基金管理人
广发证券股份有限公司（“广发证券”）	基金托管人
中信证券股份有限公司（“中信证券”）	基金管理人的股东
MACKENZIE FINANCIAL CORPORATION	基金管理人的股东
天津海鹏科技咨询有限公司	基金管理人的股东
上海华夏财富投资管理有限公司（“华夏财富”）	基金管理人的子公司
华夏股权投资基金管理（北京）有限公司	基金管理人的子公司
China Asset Management (Hong Kong) Limited（中文名：华夏基金(香港)有限公司）	基金管理人的子公司
华夏资本管理有限公司（“华夏资本”）	基金管理人的子公司
中信期货有限公司（“中信期货”）	基金管理人第一大股东的子公司
中信证券(山东)有限责任公司（“中信证券（山东）”）	基金管理人第一大股东的子公司
中信证券华南股份有限公司（“中信证券（华南）”）	基金管理人第一大股东的子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年12月31日		上年度可比期间 2023年7月7日（基金合同生效日） 至2023年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
中信证券	15,401,731,586.65	100.00%	8,182,515,092.06	100.00%

7.4.10.1.2 权证交易

无。

7.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年12月31日		上年度可比期间 2023年7月7日（基金合同生效日） 至2023年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
中信证券	3,372,670.31	100.00%	3,901,760.69	100.00%

## 7.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年12月31日		上年度可比期间 2023年7月7日（基金合同生效日） 至2023年12月31日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
中信证券	-	-	5,045,000,000.00	100.00%

## 7.4.10.1.5 基金交易

无。

## 7.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
中信证券	3,244,967.60	100.00%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2023年7月7日（基金合同生效日）至2023年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
中信证券	2,150,936.98	100.00%	-	-

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。根据证监会公告[2024]3号《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，自2024年7月1日起，针对被动股票型基金，不再通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用。针对其他类型基金，不再通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年7月7日（基金合同生效日）至2023年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	10,194,532.25	7,152,568.86
其中：应支付销售机构的客户维护费	3,734,328.93	2,464,710.49
应支付基金管理人的净管理费	6,460,203.32	4,687,858.37

注：①支付基金管理人的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 1.00%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

②基金管理人报酬计算公式为：日基金管理人报酬＝前一日基金资产净值×年费率/当年天数。

③客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用按照代销机构所代销基金的份额保有量作为基数进行计算，从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年7月7日（基金合同生效日）至2023年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	2,038,906.39	1,430,513.89

注：①支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值 0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

②基金托管费计算公式为：日基金托管费＝前一日基金资产净值×年费率/当年天数。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关	本期 2024年1月1日至2024年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华夏智胜新锐股票 A	华夏智胜新锐股票 C	合计

关联方名称			
广发证券	-	999,528.14	999,528.14
中信证券	-	873,409.76	873,409.76
中信证券（华南）	-	321,619.54	321,619.54
华夏基金管理有限公司	-	66,349.70	66,349.70
华夏财富	-	45,493.14	45,493.14
中信期货	-	17,674.98	17,674.98
中信证券（山东）	-	3,945.43	3,945.43
合计	-	2,328,020.69	2,328,020.69
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2023年7月7日（基金合同生效日）至2023年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华夏智胜新锐股票 A	华夏智胜新锐股票 C	合计
中信证券	-	655,023.93	655,023.93
广发证券	-	644,190.69	644,190.69
中信证券（华南）	-	164,297.49	164,297.49
华夏	-	28,839.97	28,839.97

基金 管理 有限 公司			
华夏 财富	-	13,708.85	13,708.85
中信 期货	-	2,959.96	2,959.96
中信 证券 (山 东)	-	2,125.06	2,125.06
合计	-	1,511,145.95	1,511,145.95

注：①支付基金销售机构的基金销售服务费按 C 类基金份额前一日基金资产净值 0.40%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给基金管理人，再由基金管理人计算并支付给各基金销售机构。

②基金销售服务费计算公式为：C 类日基金销售服务费=前一日 C 类基金资产净值×年费率/当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

7.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

无。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年7月7日（基金合同生效日） 至2023年12月31日
-------	-----------------------------	---



	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中信证券券商存款	41,744,500.58	96,593.00	79,244,864.53	135,805.02
广发证券活期存款	4,263,458.03	140,627.23	10,398,119.92	280,268.38

注：本基金的活期银行存款由基金托管人广发证券保管，存放在具有基金托管资格的银行，按银行同业利率或约定利率计息。

中信证券券商存款为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金，按银行同业利率或约定利率计息。

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
中信证券	688708	佳驰科技	新股发行	7,794	211,061.52
中信证券	601033	永兴股份	新股发行	12,577	203,747.40
中信证券	688584	上海合晶	新股发行	8,659	196,212.94
中信证券	001391	国货航	新股发行	46,851	107,757.30
中信证券	301613	新铝时代	新股发行	2,756	76,341.20
广发证券	301556	托普云农	新股发行	2,663	38,613.50
中信证券	001359	平安电工	新股发行	1,833	31,875.87
中信证券	603091	众鑫股份	新股发行	940	24,910.00
上年度可比期间 2023 年 7 月 7 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
广发证券	-	-	-	-	-
中信证券	301559	中集环科	新股发行	13,144	318,347.68
中信证券	301517	陕西华达	新股发行	1,841	49,467.67

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

##### 7.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配事项。

#### 7.4.12 期末（2024 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
301626	苏州天脉	2024-10-17	6 个月	新发流通受限	21.23	65.78	957	20,317.11	62,951.46	-
688615	合合信息	2024-09-19	6 个月	新发流通受限	55.18	165.78	289	15,947.02	47,910.42	-
688708	佳驰科技	2024-11-27	6 个月	新发流通受限	27.08	48.95	780	21,122.40	38,181.00	-
688726	拉普拉斯	2024-10-22	6 个月	新发流通受限	17.58	33.06	979	17,210.82	32,365.74	-
001391	国货航	2024-12-23	6 个月	新发流通受限	2.30	6.80	4,686	10,777.80	31,864.80	-
301551	无线传媒	2024-09-19	6 个月	新发流通受限	9.40	43.23	652	6,128.80	28,185.96	-
603072	天和磁材	2024-12-24	1 个月内 (含)	新发流通受限	12.30	12.30	2,029	24,956.70	24,956.70	-
301522	上大股份	2024-10-09	6 个月	新发流通受限	6.88	24.84	816	5,614.08	20,269.44	-
301556	托普云农	2024-10-10	6 个月	新发流通受限	14.50	59.05	267	3,871.50	15,766.35	-
301631	壹连科技	2024-11-12	6 个月	新发流通受限	72.99	101.96	153	11,167.47	15,599.88	-
301606	绿联科技	2024-07-17	6 个月	新发流通受限	21.21	36.49	396	8,399.16	14,450.04	-
301571	国科天成	2024-08-14	6 个月	新发流通受限	11.14	40.83	350	3,899.00	14,290.50	-
301622	英思特	2024-11-26	6 个月	新发流通受限	22.36	44.92	306	6,842.16	13,745.52	-
301608	博实结	2024-07-25	6 个月	新发流通	44.50	65.38	184	8,188.00	12,029.92	-

				受限						
301613	新铝时代	2024-10-18	6 个月	新发流通受限	27.70	41.77	276	7,645.20	11,528.52	-
301586	佳力奇	2024-08-21	6 个月	新发流通受限	18.09	53.14	215	3,889.35	11,425.10	-
688710	益诺思	2024-08-27	6 个月	新发流通受限	19.06	33.58	332	6,327.92	11,148.56	-
301617	博苑股份	2024-12-03	6 个月	新发流通受限	27.76	39.79	253	7,023.28	10,066.87	-
301603	乔锋智能	2024-07-03	6 个月	新发流通受限	26.50	41.98	233	6,174.50	9,781.34	-
301607	富特科技	2024-08-28	6 个月	新发流通受限	14.00	36.14	257	3,598.00	9,287.98	-
603194	中力股份	2024-12-17	6 个月	新发流通受限	20.32	28.13	291	5,913.12	8,185.83	-
301552	科力装备	2024-07-15	6 个月	新发流通受限	30.00	56.87	143	4,290.00	8,132.41	-
001279	强邦新材	2024-09-27	6 个月	新发流通受限	9.68	27.91	265	2,565.20	7,396.15	-
603395	红四方	2024-11-19	6 个月	新发流通受限	7.98	35.77	154	1,228.92	5,508.58	-
603207	小方制药	2024-08-19	6 个月	新发流通受限	12.47	26.65	185	2,306.95	4,930.25	-
603310	巍华新材	2024-08-07	6 个月	新发流通受限	17.39	17.95	254	4,417.06	4,559.30	-
603091	众鑫股份	2024-09-10	6 个月	新发流通受限	26.50	44.43	94	2,491.00	4,176.42	-
603350	安乃达	2024-06-26	6 个月	新发流通受限	20.56	36.17	106	2,179.36	3,834.02	-
603285	键邦股份	2024-06-28	6 个月	新发流通	18.65	22.61	129	2,405.85	2,916.69	-

				受限						
603072	天和磁材	2024-12-24	6 个月	新发 流通 受限	12.30	12.30	226	2,779.80	2,779.80	-

注：①根据中国证监会《上市公司证券发行注册管理办法》，基金参与上市公司向特定对象发行股票所获得的股票，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。

②基金还可作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

③根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

④基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的设定限售期的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的风险管理政策是使基金投资风险可测、可控、可承担。本基金管理人建立了由风险管理委员会、督察长、法律部、合规部、稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的多层次风险管理架构体系。风险管理团队在识别、衡量投资风险后，通过正式报告的方式，将分析结果及时传达给基金经理、投资总监、投资决策委员会和风险管理委员会，协助制定风险控制决策，实现风险管理目标。

本基金管理人主要通过定性分析和定量分析的方法，估测各种金融工具风险可能产生的损失。

本基金管理人从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重性；从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用的金融工具特征，通过特定的风险量化指标、模型和日常的量化报告，参考压力测试结果，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时对各种风险进行监督、检查和评估，并制定相应决策，将风险控制在预期可承受的范围內。

#### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指由于基金所投资债券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息，债券发行人信用评级降低导致债券价格下降，或基金在交易过程中发生交收违约，而造成基金资产损失的可能性。

本基金管理人通过信用分析团队建立了内部评级体系和交易对手库，对发行人及债券投资进行内部评级，对交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度，以控制可能出现的信用风险。

#### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是在市场或持有资产流动性不足的情况下，基金管理人可能无法迅速、低成本地调整基金投资组合，从而对基金收益造成不利影响。

本基金管理人通过限制投资集中度来管理投资品种变现的流动性风险。除在“7.4.12 期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限制的情况外，本基金所投资的证券均能及时变现。

##### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

在日常运作中，本基金的流动性安排能够与基金合同约定的申购赎回安排以及投资者的申购赎回规律相匹配。

在资产端，本基金主要投资于基金合同约定的具有良好流动性的金融工具。基金管理人持续监测本基金持有资产的市场交易量、交易集中度等涉及资产流动性水平的风险指标，并定期开展压力测试，详细评估在不同的压力情景下资产变现情况的变化。

在负债端，基金管理人持续监测本基金开放期内投资者历史申赎、投资者类型和结构变化等数据，审慎评估不同市场环境可能带来的投资者潜在赎回需求，当市场环境或投资者结构发生变化时，及时调整组合资产结构及比例，预留充足现金头寸，保持基金资产可变现规模和期限与负债赎回规模和期限的匹配。

如遭遇极端市场情形或投资者非预期巨额赎回情形，基金管理人将采用本基金合同约定的赎回申请处理方式及其他各类流动性风险管理工具，控制极端情况下的潜在流动性风险。

#### 7.4.13.4 市场风险

市场风险是指由于市场变化或波动所引起的资产损失的可能性，本基金管理人通过监测组合敏感性指标来衡量市场风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率变动引起组合中资产特别是债券投资的市场价格变动，从而影响基金投资收益的风险。

本基金管理人定期对组合中债券投资部分面临的利率风险进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

截至本期末，综合考虑利率债、信用债、同业存单、资产支持证券等资产占基金资产净值的比例，利率变动对于本基金资产净值无重大影响。

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险为除市场利率和外汇汇率以外的市场因素（单个证券发行主体自身经营情况或证券市场整体波动）发生变动时导致基金资产发生损失的风险。

本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险。此外，本基金管理人对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法进行风险度量和分析，以对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日		上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	668,693,250.97	94.06	1,439,467,258.74	93.80
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	754,049.58	0.05
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	668,693,250.97	94.06	1,440,221,308.32	93.85

注：①本表中交易性金融资产-债券投资科目仅包含可转换公司债券和可交换公司债券等。

②由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的

		影响金额（单位：人民币元）	
		本期末	上年度末
		2024 年 12 月 31 日	2023 年 12 月 31 日
	-5%	-36,860,915.03	-58,292,565.35
	+5%	36,860,915.03	58,292,565.35

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

- 第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；
- 第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；
- 第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	668,205,025.42	1,438,205,483.02
第二层次	27,736.50	1,652,791.60
第三层次	460,489.05	363,033.70
合计	668,693,250.97	1,440,221,308.32

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券等投资，若出现交易不活跃（包括重大事项停牌、境内证券涨跌停等导致的交易不活跃）和非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。本基金政策以导致各层次之间转换的事项发生日作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
	期初余额	-	363,033.70

当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	1,069,720.75	1,069,720.75
转出第三层次	-	1,343,019.80	1,343,019.80
当期利得或损失总额	-	370,754.40	370,754.40
其中：计入损益的利得或损失	-	370,754.40	370,754.40
计入其他综合收益的利得或损失（若有）	-	-	-
期末余额	-	460,489.05	460,489.05
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	258,548.02	258,548.02
项目	上年度可比期间 2023 年 7 月 7 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	286,305.70	286,305.70
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	76,728.00	76,728.00
其中：计入损益的利得或损失	-	76,728.00	76,728.00
计入其他综合收益的利得或损失（若有）	-	-	-
期末余额	-	363,033.70	363,033.70
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	76,728.00	76,728.00

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系



限售股票	460,489.05	平均价格亚式 期权模型	预期年化波动 率	0.3423-5.7444	负相关
项目	上年度末公允 价值	采用的估值技 术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平 均值	与公允价值之 间的关系
限售股票	363,033.70	平均价格亚式 期权模型	预期年化波动 率	0.2716-2.1988	负相关

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

截至 2024 年 12 月 31 日止，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，其账面价值与公允价值差异很小。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	668,693,250.97	93.00
	其中：股票	668,693,250.97	93.00
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返 售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合 计	48,384,524.12	6.73
8	其他各项资产	1,939,740.34	0.27
9	合计	719,017,515.43	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	9,859,807.00	1.39
C	制造业	447,095,020.41	62.89
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	14,063,435.00	1.98
E	建筑业	7,063,837.00	0.99
F	批发和零售业	6,460,733.84	0.91
G	交通运输、仓储和邮政业	24,163,643.72	3.40
H	住宿和餐饮业	17,280.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	72,026,202.14	10.13
J	金融业	29,084,891.00	4.09
K	房地产业	12,565,785.80	1.77
L	租赁和商务服务业	9,024,137.00	1.27
M	科学研究和技术服务业	13,645,713.06	1.92
N	水利、环境和公共设施管理业	6,413,562.00	0.90
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	15,185,136.00	2.14
S	综合	2,024,067.00	0.28
	合计	668,693,250.97	94.06

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	601811	新华文轩	356,400	5,648,940.00	0.79
2	603766	隆鑫通用	609,700	5,548,270.00	0.78
3	600037	歌华有线	725,100	5,409,246.00	0.76
4	600941	中国移动	45,200	5,340,832.00	0.75
5	688336	三生国健	244,908	5,245,929.36	0.74
6	601288	农业银行	968,100	5,169,654.00	0.73
7	002724	海洋王	921,600	4,902,912.00	0.69
8	002153	石基信息	686,404	4,900,924.56	0.69
9	002546	新联电子	1,130,400	4,894,632.00	0.69
10	002578	闽发铝业	1,626,600	4,863,534.00	0.68
11	603680	今创集团	582,000	4,830,600.00	0.68
12	688509	正元地信	1,191,700	4,731,049.00	0.67
13	300414	中光防雷	594,100	4,729,036.00	0.67

14	600261	阳光照明	1,435,000	4,692,450.00	0.66
15	002107	沃华医药	969,900	4,636,122.00	0.65
16	688079	美迪凯	535,216	4,634,970.56	0.65
17	300259	新天科技	1,310,600	4,587,100.00	0.65
18	002522	浙江众成	1,164,700	4,553,977.00	0.64
19	002284	亚太股份	564,900	4,372,326.00	0.62
20	000720	新能泰山	1,325,200	4,306,900.00	0.61
21	300515	三德科技	353,000	4,204,230.00	0.59
22	002666	德联集团	929,500	4,052,620.00	0.57
23	600758	辽宁能源	1,173,700	4,037,528.00	0.57
24	688519	南亚新材	182,300	3,875,698.00	0.55
25	688061	灿瑞科技	133,500	3,855,480.00	0.54
26	601728	中国电信	533,800	3,854,036.00	0.54
27	688055	龙腾光电	932,700	3,852,051.00	0.54
28	600551	时代出版	441,000	3,797,010.00	0.53
29	300453	三鑫医疗	496,430	3,703,367.80	0.52
30	688231	隆达股份	259,482	3,689,834.04	0.52
31	600271	航天信息	395,100	3,599,361.00	0.51
32	600246	万通发展	477,700	3,558,865.00	0.50
33	300523	辰安科技	177,700	3,516,683.00	0.49
34	300627	华测导航	83,200	3,477,760.00	0.49
35	601939	建设银行	385,900	3,392,061.00	0.48
36	000429	粤高速 A	223,900	3,291,330.00	0.46
37	002003	伟星股份	230,500	3,266,185.00	0.46
38	688315	诺禾致源	257,093	3,213,662.50	0.45
39	002948	青岛银行	821,500	3,187,420.00	0.45
40	600662	外服控股	610,400	3,094,728.00	0.44
41	600320	振华重工	786,100	3,081,512.00	0.43
42	688232	新点软件	105,300	3,052,647.00	0.43
43	603421	鼎信通讯	418,600	2,984,618.00	0.42
44	002111	威海广泰	267,800	2,951,156.00	0.42
45	601702	华峰铝业	160,900	2,947,688.00	0.41
46	002818	富森美	192,900	2,881,926.00	0.41
47	002967	广电计量	175,400	2,876,560.00	0.40
48	600548	深高速	211,700	2,853,716.00	0.40
49	600812	华北制药	551,700	2,852,289.00	0.40
50	000060	中金岭南	607,700	2,850,113.00	0.40
51	601318	中国平安	53,100	2,795,715.00	0.39
52	688432	有研硅	246,100	2,780,930.00	0.39
53	600403	大有能源	945,300	2,779,182.00	0.39
54	600660	福耀玻璃	44,500	2,776,800.00	0.39
55	300080	易成新能	634,300	2,771,891.00	0.39
56	000927	中国铁物	1,049,500	2,760,185.00	0.39
57	600642	申能股份	290,400	2,755,896.00	0.39

58	301339	通行宝	135,100	2,747,934.00	0.39
59	600563	法拉电子	23,100	2,747,052.00	0.39
60	301090	华润材料	394,300	2,736,442.00	0.38
61	688371	菲沃泰	175,931	2,730,449.12	0.38
62	603989	艾华集团	181,000	2,729,480.00	0.38
63	002620	瑞和股份	607,900	2,729,471.00	0.38
64	300866	安克创新	27,800	2,714,392.00	0.38
65	601816	京沪高铁	440,600	2,714,096.00	0.38
66	688586	江航装备	282,602	2,704,501.14	0.38
67	601098	中南传媒	178,900	2,685,289.00	0.38
68	688206	概伦电子	142,000	2,685,220.00	0.38
69	000050	深天马 A	296,200	2,674,686.00	0.38
70	600707	彩虹股份	325,300	2,673,966.00	0.38
71	688776	国光电气	56,447	2,671,636.51	0.38
72	000881	中广核技	363,200	2,662,256.00	0.37
73	300140	节能环境	442,300	2,649,377.00	0.37
74	002099	海翔药业	511,900	2,641,404.00	0.37
75	002595	豪迈科技	52,400	2,629,956.00	0.37
76	002138	顺络电子	83,100	2,615,988.00	0.37
77	688093	世华科技	129,400	2,612,586.00	0.37
78	000538	云南白药	43,500	2,607,825.00	0.37
79	300010	豆神教育	419,900	2,607,579.00	0.37
80	000761	本钢板材	812,000	2,598,400.00	0.37
81	000767	晋控电力	1,026,900	2,598,057.00	0.37
82	301439	泓淋电力	188,900	2,597,375.00	0.37
83	601106	中国一重	892,500	2,597,175.00	0.37
84	002672	东江环保	613,800	2,596,374.00	0.37
85	688120	华海清科	15,900	2,591,541.00	0.36
86	301028	东亚机械	239,800	2,587,442.00	0.36
87	688237	超卓航科	114,600	2,586,522.00	0.36
88	600900	长江电力	87,500	2,585,625.00	0.36
89	601068	中铝国际	584,700	2,578,527.00	0.36
90	000869	张裕 A	110,700	2,567,133.00	0.36
91	002282	博深股份	345,600	2,560,896.00	0.36
92	000036	华联控股	626,410	2,555,752.80	0.36
93	002088	鲁阳节能	199,400	2,550,326.00	0.36
94	600718	东软集团	235,700	2,538,489.00	0.36
95	300074	华平股份	637,500	2,537,250.00	0.36
96	601228	广州港	747,800	2,535,042.00	0.36
97	601398	工商银行	364,700	2,523,724.00	0.35
98	300121	阳谷华泰	208,600	2,521,974.00	0.35
99	688041	海光信息	16,800	2,516,472.00	0.35
100	002801	微光股份	102,800	2,514,488.00	0.35
101	603379	三美股份	65,400	2,510,052.00	0.35

102	300741	华宝股份	144,100	2,505,899.00	0.35
103	002363	隆基机械	381,000	2,503,170.00	0.35
104	002160	常铝股份	671,500	2,497,980.00	0.35
105	002636	金安国纪	322,100	2,493,054.00	0.35
106	002573	清新环境	625,000	2,487,500.00	0.35
107	600352	浙江龙盛	241,300	2,482,977.00	0.35
108	600648	外高桥	208,300	2,480,853.00	0.35
109	688278	特宝生物	33,800	2,479,906.00	0.35
110	002014	永新股份	226,200	2,479,152.00	0.35
111	688479	友车科技	138,400	2,456,600.00	0.35
112	300447	全信股份	173,100	2,452,827.00	0.35
113	001965	招商公路	175,800	2,452,410.00	0.34
114	601018	宁波港	635,200	2,445,520.00	0.34
115	603618	杭电股份	450,300	2,445,129.00	0.34
116	600496	精工钢构	807,900	2,439,858.00	0.34
117	688496	清越科技	284,500	2,438,165.00	0.34
118	600737	中粮糖业	238,800	2,438,148.00	0.34
119	002414	高德红外	327,200	2,431,096.00	0.34
120	002961	瑞达期货	168,500	2,421,345.00	0.34
121	301503	智迪科技	70,500	2,419,560.00	0.34
122	688538	和辉光电	1,042,600	2,418,832.00	0.34
123	002228	合兴包装	804,800	2,414,400.00	0.34
124	300132	青松股份	489,200	2,411,756.00	0.34
125	002427	尤夫股份	692,500	2,409,900.00	0.34
126	600798	宁波海运	794,400	2,407,032.00	0.34
127	688616	西力科技	230,989	2,399,975.71	0.34
128	688428	诺诚健华	194,700	2,390,916.00	0.34
129	300274	阳光电源	32,300	2,384,709.00	0.34
130	301362	民爆光电	60,700	2,380,654.00	0.33
131	688562	航天软件	149,300	2,375,363.00	0.33
132	000930	中粮科技	427,800	2,374,290.00	0.33
133	688233	神工股份	101,100	2,370,795.00	0.33
134	002923	润都股份	248,500	2,370,690.00	0.33
135	688419	耐科装备	76,100	2,365,188.00	0.33
136	300271	华宇软件	336,000	2,358,720.00	0.33
137	000601	韶能股份	580,600	2,357,236.00	0.33
138	688316	青云科技	70,300	2,355,050.00	0.33
139	688689	银河微电	111,080	2,353,785.20	0.33
140	300048	合康新能	465,400	2,345,616.00	0.33
141	002574	明牌珠宝	508,300	2,343,263.00	0.33
142	603676	卫信康	234,000	2,328,300.00	0.33
143	003018	金富科技	250,600	2,320,556.00	0.33
144	603926	铁流股份	262,200	2,320,470.00	0.33
145	301081	严牌股份	270,500	2,293,840.00	0.32

146	300373	扬杰科技	52,400	2,280,448.00	0.32
147	300485	赛升药业	324,500	2,274,745.00	0.32
148	601212	白银有色	817,200	2,271,816.00	0.32
149	688248	南网科技	70,200	2,252,718.00	0.32
150	688090	瑞松科技	63,000	2,237,760.00	0.31
151	300126	锐奇股份	434,600	2,229,498.00	0.31
152	000509	华塑控股	668,700	2,226,771.00	0.31
153	688291	金橙子	115,400	2,217,988.00	0.31
154	300587	天铁科技	503,400	2,209,926.00	0.31
155	002249	大洋电机	375,900	2,206,533.00	0.31
156	688488	艾迪药业	280,000	2,200,800.00	0.31
157	600192	长城电工	378,100	2,181,637.00	0.31
158	002030	达安基因	383,400	2,177,712.00	0.31
159	688359	三孚新科	54,600	2,155,608.00	0.30
160	600488	津药药业	506,900	2,149,256.00	0.30
161	600229	城市传媒	308,200	2,148,154.00	0.30
162	301327	华宝新能	28,000	2,147,880.00	0.30
163	002549	凯美特气	349,300	2,141,209.00	0.30
164	000517	荣安地产	949,200	2,116,716.00	0.30
165	600936	广西广电	733,800	2,113,344.00	0.30
166	601002	晋亿实业	484,700	2,108,445.00	0.30
167	603118	共进股份	233,900	2,081,710.00	0.29
168	688161	威高骨科	82,300	2,075,606.00	0.29
169	000547	航天发展	282,900	2,067,999.00	0.29
170	300750	宁德时代	7,700	2,048,200.00	0.29
171	688280	精进电动	466,039	2,045,911.21	0.29
172	600643	爱建集团	395,200	2,043,184.00	0.29
173	600805	悦达投资	456,900	2,024,067.00	0.28
174	002678	珠江钢琴	438,100	1,958,307.00	0.28
175	688425	铁建重工	444,800	1,957,120.00	0.28
176	000100	TCL 科技	388,500	1,954,155.00	0.27
177	301180	万祥科技	125,067	1,934,786.49	0.27
178	002459	晶澳科技	139,700	1,920,875.00	0.27
179	600664	哈药股份	455,100	1,879,563.00	0.26
180	002558	巨人网络	147,200	1,867,968.00	0.26
181	300512	中亚股份	273,600	1,863,216.00	0.26
182	600299	安迪苏	147,000	1,844,850.00	0.26
183	002191	劲嘉股份	438,000	1,839,600.00	0.26
184	300337	银邦股份	165,300	1,838,136.00	0.26
185	000902	新洋丰	140,000	1,825,600.00	0.26
186	605499	东鹏饮料	7,200	1,789,344.00	0.25
187	688077	大地熊	85,300	1,770,828.00	0.25
188	301332	德尔玛	175,800	1,761,516.00	0.25
189	600073	光明肉业	253,800	1,761,372.00	0.25

190	688283	坤恒顺维	70,900	1,745,558.00	0.25
191	002020	京新药业	136,300	1,744,640.00	0.25
192	000423	东阿阿胶	27,800	1,743,616.00	0.25
193	600610	中毅达	411,400	1,740,222.00	0.24
194	300320	海达股份	178,200	1,710,720.00	0.24
195	603936	博敏电子	203,000	1,709,260.00	0.24
196	688381	帝奥微	88,300	1,702,424.00	0.24
197	600219	南山铝业	431,000	1,685,210.00	0.24
198	001218	丽臣实业	95,620	1,647,532.60	0.23
199	688100	威胜信息	44,487	1,610,429.40	0.23
200	600863	内蒙华电	371,200	1,607,296.00	0.23
201	000020	深华发 A	127,600	1,584,792.00	0.22
202	002454	松芝股份	237,700	1,580,705.00	0.22
203	688096	京源环保	210,700	1,571,822.00	0.22
204	301170	锡南科技	67,800	1,553,976.00	0.22
205	000088	盐田港	318,016	1,548,737.92	0.22
206	601326	秦港股份	455,600	1,526,260.00	0.21
207	600519	贵州茅台	1,000	1,524,000.00	0.21
208	600901	江苏金租	288,500	1,505,970.00	0.21
209	002550	千红制药	240,400	1,490,480.00	0.21
210	002412	汉森制药	245,200	1,473,652.00	0.21
211	002399	海普瑞	136,300	1,457,047.00	0.20
212	601916	浙商银行	498,400	1,450,344.00	0.20
213	688701	卓锦股份	269,800	1,443,430.00	0.20
214	603115	海星股份	110,300	1,423,973.00	0.20
215	300605	恒锋信息	119,900	1,404,029.00	0.20
216	301093	华兰股份	58,700	1,397,060.00	0.20
217	002413	雷科防务	308,400	1,344,624.00	0.19
218	600096	云天化	59,200	1,320,160.00	0.19
219	688236	春立医疗	102,601	1,313,292.80	0.18
220	000030	富奥股份	254,200	1,304,046.00	0.18
221	601616	广电电气	296,200	1,300,318.00	0.18
222	300868	杰美特	47,800	1,294,424.00	0.18
223	000651	格力电器	28,400	1,290,780.00	0.18
224	300771	智莱科技	122,400	1,287,648.00	0.18
225	000729	燕京啤酒	105,800	1,273,832.00	0.18
226	000333	美的集团	16,800	1,263,696.00	0.18
227	600469	风神股份	202,300	1,246,168.00	0.18
228	601375	中原证券	285,500	1,233,360.00	0.17
229	002755	奥赛康	95,100	1,208,721.00	0.17
230	301260	格力博	90,200	1,195,150.00	0.17
231	605056	咸亨国际	93,800	1,171,562.00	0.16
232	002978	安宁股份	39,900	1,133,958.00	0.16
233	300269	联建光电	279,100	1,110,818.00	0.16

234	301263	泰恩康	73,900	1,107,761.00	0.16
235	688387	信科移动	183,900	1,096,044.00	0.15
236	000686	东北证券	133,300	1,058,402.00	0.15
237	301281	科源制药	34,000	1,016,940.00	0.14
238	300247	融捷健康	279,300	999,894.00	0.14
239	600366	宁波韵升	135,500	997,280.00	0.14
240	603938	三孚股份	91,520	989,331.20	0.14
241	603699	纽威股份	44,600	988,782.00	0.14
242	603987	康德莱	137,700	988,686.00	0.14
243	300931	通用电梯	146,900	965,133.00	0.14
244	688173	希荻微	86,900	962,852.00	0.14
245	300821	东岳硅材	119,000	923,440.00	0.13
246	600874	创业环保	153,700	917,589.00	0.13
247	002773	康弘药业	45,800	897,680.00	0.13
248	688189	南新制药	134,700	880,938.00	0.12
249	600894	广日股份	60,200	878,920.00	0.12
250	601611	中国核建	93,300	843,432.00	0.12
251	601138	工业富联	38,100	819,150.00	0.12
252	002517	恺英网络	58,600	797,546.00	0.11
253	600757	长江传媒	83,300	797,181.00	0.11
254	600268	国电南自	118,600	796,992.00	0.11
255	600820	隧道股份	109,800	789,462.00	0.11
256	601857	中国石油	87,700	784,038.00	0.11
257	688663	新风光	36,100	783,731.00	0.11
258	300433	蓝思科技	35,600	779,640.00	0.11
259	605058	澳弘电子	39,100	775,353.00	0.11
260	603188	亚邦股份	222,900	773,463.00	0.11
261	688410	山外山	69,300	773,388.00	0.11
262	300311	任子行	128,579	752,187.15	0.11
263	688060	云涌科技	21,000	745,710.00	0.10
264	301036	双乐股份	18,700	733,040.00	0.10
265	601628	中国人寿	17,000	712,640.00	0.10
266	000725	京东方 A	157,000	689,230.00	0.10
267	600269	赣粤高速	120,900	678,249.00	0.10
268	600067	冠城新材	252,700	669,655.00	0.09
269	301309	万得凯	26,625	643,526.25	0.09
270	002446	盛路通信	96,900	634,695.00	0.09
271	000404	长虹华意	82,500	610,500.00	0.09
272	603778	国晟科技	191,100	579,033.00	0.08
273	300743	天地数码	37,900	577,217.00	0.08
274	688070	纵横股份	16,300	575,390.00	0.08
275	002980	华盛昌	21,600	554,040.00	0.08
276	002534	西子洁能	47,800	531,058.00	0.07
277	688409	富创精密	10,100	520,857.00	0.07



278	688631	莱斯信息	5,900	513,831.00	0.07
279	002063	远光软件	87,900	506,304.00	0.07
280	300084	海默科技	90,000	484,200.00	0.07
281	002004	华邦健康	107,100	484,092.00	0.07
282	301217	铜冠铜箔	41,200	456,496.00	0.06
283	000557	西部创业	87,300	453,087.00	0.06
284	002109	兴化股份	140,700	446,019.00	0.06
285	301149	隆华新材	42,200	417,358.00	0.06
286	600008	首创环保	125,500	411,640.00	0.06
287	688472	阿特斯	32,500	408,200.00	0.06
288	688383	新益昌	8,829	396,157.23	0.06
289	600020	中原高速	93,000	392,460.00	0.06
290	601279	英利汽车	99,500	381,085.00	0.05
291	000636	风华高科	26,500	380,275.00	0.05
292	002391	长青股份	74,100	371,241.00	0.05
293	300946	恒而达	13,400	363,944.00	0.05
294	000672	上峰水泥	47,400	362,610.00	0.05
295	002938	鹏鼎控股	9,700	353,856.00	0.05
296	600746	江苏索普	49,600	347,696.00	0.05
297	002583	海能达	24,400	346,724.00	0.05
298	600100	同方股份	47,100	334,881.00	0.05
299	002380	科远智慧	18,000	332,640.00	0.05
300	002461	珠江啤酒	33,200	328,348.00	0.05
301	600438	通威股份	14,800	327,228.00	0.05
302	600550	保变电气	41,200	323,420.00	0.05
303	000603	盛达资源	26,600	318,934.00	0.04
304	688066	航天宏图	15,600	318,240.00	0.04
305	600148	长春一东	17,700	317,538.00	0.04
306	000062	深圳华强	14,000	313,600.00	0.04
307	300261	雅本化学	45,100	308,935.00	0.04
308	688392	骄成超声	7,500	306,000.00	0.04
309	002867	周大生	20,900	303,677.00	0.04
310	000968	蓝焰控股	45,000	299,250.00	0.04
311	000757	浩物股份	79,700	297,281.00	0.04
312	600830	香溢融通	25,300	295,757.00	0.04
313	002859	洁美科技	14,200	294,650.00	0.04
314	600959	江苏有线	85,500	286,425.00	0.04
315	603299	苏盐井神	25,100	279,614.00	0.04
316	002706	良信股份	36,400	279,552.00	0.04
317	002651	利君股份	38,000	278,540.00	0.04
318	600996	贵广网络	32,300	276,165.00	0.04
319	000039	中集集团	35,500	275,835.00	0.04
320	002261	拓维信息	15,000	274,650.00	0.04
321	600651	飞乐音响	63,200	261,648.00	0.04

322	301177	迪阿股份	11,426	260,969.84	0.04
323	002901	大博医疗	8,000	246,720.00	0.03
324	300663	科蓝软件	13,600	236,096.00	0.03
325	601319	中国人保	30,400	231,648.00	0.03
326	002215	诺普信	20,000	224,600.00	0.03
327	002368	太极股份	9,400	222,592.00	0.03
328	300735	光弘科技	7,700	215,523.00	0.03
329	600769	祥龙电业	22,100	212,381.00	0.03
330	601015	陕西黑猫	62,900	210,086.00	0.03
331	600640	国脉文化	16,800	200,592.00	0.03
332	300679	电连技术	3,300	197,010.00	0.03
333	688779	五矿新能	36,900	196,308.00	0.03
334	002190	成飞集成	10,000	193,400.00	0.03
335	002475	立讯精密	4,700	191,572.00	0.03
336	002966	苏州银行	23,600	191,396.00	0.03
337	688048	长光华芯	4,896	190,895.04	0.03
338	600305	恒顺醋业	23,900	190,722.00	0.03
339	601988	中国银行	34,200	188,442.00	0.03
340	605358	立昂微	7,600	188,252.00	0.03
341	300702	天宇股份	11,200	186,592.00	0.03
342	688505	复旦张江	24,000	184,080.00	0.03
343	300527	中船应急	22,400	180,768.00	0.03
344	605365	立达信	11,500	180,550.00	0.03
345	300134	大富科技	15,200	178,296.00	0.03
346	600151	航天机电	22,100	176,358.00	0.02
347	688523	航天环宇	8,800	176,000.00	0.02
348	688659	元琛科技	25,400	171,450.00	0.02
349	688372	伟测科技	2,900	169,708.00	0.02
350	002491	通鼎互联	33,000	169,620.00	0.02
351	002777	久远银海	9,700	167,034.00	0.02
352	000967	盈峰环境	33,400	165,998.00	0.02
353	688348	昱能科技	3,400	165,920.00	0.02
354	000951	中国重汽	9,700	164,706.00	0.02
355	002326	永太科技	18,400	164,496.00	0.02
356	600183	生益科技	6,800	163,540.00	0.02
357	600169	太原重工	65,600	163,344.00	0.02
358	002275	桂林三金	10,800	162,972.00	0.02
359	688007	光峰科技	11,000	162,690.00	0.02
360	600058	五矿发展	22,200	158,064.00	0.02
361	600578	京能电力	44,800	157,696.00	0.02
362	000917	电广传媒	22,200	156,954.00	0.02
363	300409	道氏技术	11,500	156,515.00	0.02
364	688655	迅捷兴	14,400	155,232.00	0.02
365	600928	西安银行	42,800	154,508.00	0.02

366	688177	百奥泰	7,900	153,102.00	0.02
367	000848	承德露露	17,000	152,490.00	0.02
368	300180	华峰超纤	24,200	152,460.00	0.02
369	688321	微芯生物	8,200	152,356.00	0.02
370	600575	淮河能源	38,300	152,051.00	0.02
371	002532	天山铝业	19,300	151,891.00	0.02
372	300151	昌红科技	8,900	151,300.00	0.02
373	600869	远东股份	31,700	150,575.00	0.02
374	688526	科前生物	10,501	150,059.29	0.02
375	600582	天地科技	24,200	149,556.00	0.02
376	002500	山西证券	23,800	149,464.00	0.02
377	002212	天融信	23,000	148,350.00	0.02
378	002928	华夏航空	19,000	147,440.00	0.02
379	002194	武汉凡谷	13,100	146,982.00	0.02
380	300455	航天智装	11,300	146,448.00	0.02
381	603267	鸿远电子	4,000	144,920.00	0.02
382	000632	三木集团	39,000	143,130.00	0.02
383	000958	电投产融	22,900	142,667.00	0.02
384	300850	新强联	7,400	141,414.00	0.02
385	300187	永清环保	28,000	141,400.00	0.02
386	688502	茂莱光学	700	140,980.00	0.02
387	688565	力源科技	24,200	139,392.00	0.02
388	688293	奥浦迈	3,800	138,624.00	0.02
389	000702	正虹科技	20,900	138,567.00	0.02
390	688196	卓越新能	4,100	137,719.00	0.02
391	002916	深南电路	1,100	137,500.00	0.02
392	600160	巨化股份	5,700	137,484.00	0.02
393	688330	宏力达	5,200	136,448.00	0.02
394	600415	小商品城	10,100	135,441.00	0.02
395	600017	日照港	42,200	135,040.00	0.02
396	002913	奥士康	5,600	135,016.00	0.02
397	300427	红相股份	22,800	134,520.00	0.02
398	603982	泉峰汽车	16,700	132,932.00	0.02
399	688331	荣昌生物	4,400	132,484.00	0.02
400	688012	中微公司	700	132,412.00	0.02
401	600131	国网信通	7,000	132,370.00	0.02
402	601607	上海医药	6,300	132,300.00	0.02
403	300339	润和软件	2,600	130,078.00	0.02
404	002563	森马服饰	18,500	129,870.00	0.02
405	002839	张家港行	28,300	123,671.00	0.02
406	688819	天能股份	4,500	122,490.00	0.02
407	601555	东吴证券	15,300	119,340.00	0.02
408	688585	上纬新材	17,500	116,550.00	0.02
409	603117	万林物流	19,000	116,090.00	0.02

410	000061	农产品	16,500	115,665.00	0.02
411	600993	马应龙	4,400	114,884.00	0.02
412	301297	富乐德	2,700	114,750.00	0.02
413	605376	博迁新材	3,900	112,905.00	0.02
414	603328	依顿电子	11,300	111,418.00	0.02
415	600236	桂冠电力	15,900	108,120.00	0.02
416	600312	平高电气	5,600	107,520.00	0.02
417	600035	楚天高速	23,300	107,180.00	0.02
418	688021	奥福环保	10,200	106,488.00	0.01
419	688772	珠海冠宇	6,600	106,128.00	0.01
420	002627	三峡旅游	21,100	105,922.00	0.01
421	002448	中原内配	16,800	105,168.00	0.01
422	600392	盛和资源	10,200	104,856.00	0.01
423	688297	中无人机	2,600	104,728.00	0.01
424	688148	芳源股份	21,100	104,445.00	0.01
425	300508	维宏股份	3,800	102,790.00	0.01
426	688107	安路科技	3,400	100,572.00	0.01
427	301262	海看股份	4,000	99,480.00	0.01
428	300471	厚普股份	10,400	98,384.00	0.01
429	301389	隆扬电子	5,500	91,960.00	0.01
430	000090	天健集团	21,600	88,776.00	0.01
431	300324	旋极信息	25,900	85,729.00	0.01
432	300045	华力创通	4,100	85,649.00	0.01
433	688658	悦康药业	5,900	85,019.00	0.01
434	000581	威孚高科	4,500	84,960.00	0.01
435	600316	洪都航空	2,600	83,512.00	0.01
436	300394	天孚通信	900	82,224.00	0.01
437	300770	新媒股份	2,000	80,820.00	0.01
438	688379	华光新材	3,900	79,638.00	0.01
439	688408	中信博	1,100	79,200.00	0.01
440	688126	沪硅产业	4,100	77,162.00	0.01
441	300776	帝尔激光	1,200	76,296.00	0.01
442	002104	恒宝股份	11,200	75,712.00	0.01
443	688131	皓元医药	2,100	74,970.00	0.01
444	688182	灿勤科技	4,100	73,308.00	0.01
445	300049	福瑞股份	2,300	72,542.00	0.01
446	000096	广聚能源	5,900	72,334.00	0.01
447	688193	仁度生物	2,000	71,500.00	0.01
448	688737	中自科技	4,000	71,240.00	0.01
449	603162	海通发展	7,700	70,840.00	0.01
450	000598	兴蓉环境	9,300	70,587.00	0.01
451	688226	威腾电气	2,800	70,364.00	0.01
452	300674	宇信科技	3,600	70,272.00	0.01
453	300811	铂科新材	1,300	70,083.00	0.01

454	600369	西南证券	14,800	69,116.00	0.01
455	002440	闰土股份	10,300	69,113.00	0.01
456	301225	恒勃股份	2,600	69,004.00	0.01
457	688051	佳华科技	3,300	68,706.00	0.01
458	002891	中宠股份	1,900	67,830.00	0.01
459	688152	麒麟信安	1,300	67,652.00	0.01
460	002373	千方科技	6,600	66,924.00	0.01
461	300697	电工合金	5,300	66,833.00	0.01
462	603937	丽岛新材	7,300	66,138.00	0.01
463	603385	惠达卫浴	10,300	65,508.00	0.01
464	300816	艾可蓝	2,500	64,125.00	0.01
465	603301	振德医疗	2,900	63,771.00	0.01
466	600281	华阳新材	19,400	63,438.00	0.01
467	301626	苏州天脉	957	62,951.46	0.01
468	688528	秦川物联	7,100	62,125.00	0.01
469	688700	东威科技	2,100	61,866.00	0.01
470	002694	顾地科技	13,400	61,372.00	0.01
471	688508	芯朋微	1,400	60,158.00	0.01
472	300352	北信源	11,000	58,080.00	0.01
473	688981	中芯国际	600	56,772.00	0.01
474	300737	科顺股份	11,100	56,277.00	0.01
475	601158	重庆水务	11,400	55,860.00	0.01
476	601333	广深铁路	16,200	55,566.00	0.01
477	601568	北元集团	12,600	52,920.00	0.01
478	688489	三未信安	1,500	51,750.00	0.01
479	688657	浩辰软件	1,300	51,558.00	0.01
480	301326	捷邦科技	700	51,170.00	0.01
481	001208	华菱线缆	5,500	49,940.00	0.01
482	002626	金达威	3,300	49,830.00	0.01
483	300379	东方通	3,300	49,797.00	0.01
484	601369	陕鼓动力	5,600	48,720.00	0.01
485	300175	朗源股份	8,700	48,024.00	0.01
486	688615	合合信息	289	47,910.42	0.01
487	300050	世纪鼎利	8,900	47,615.00	0.01
488	002267	陕天然气	5,600	47,320.00	0.01
489	300077	国民技术	1,900	45,296.00	0.01
490	002442	龙星科技	7,300	43,873.00	0.01
491	300152	新动力	8,600	43,430.00	0.01
492	600961	株冶集团	5,500	43,285.00	0.01
493	002167	东方锆业	5,800	42,572.00	0.01
494	601231	环旭电子	2,500	41,250.00	0.01
495	600267	海正药业	4,900	40,670.00	0.01
496	603158	腾龙股份	5,000	40,400.00	0.01
497	300360	炬华科技	2,400	40,248.00	0.01

498	301025	读客文化	4,200	40,026.00	0.01
499	600308	华泰股份	10,800	39,312.00	0.01
500	002250	联化科技	7,000	38,570.00	0.01
501	600990	四创电子	1,800	38,304.00	0.01
502	688708	佳驰科技	780	38,181.00	0.01
503	688718	唯赛勃	3,800	38,000.00	0.01
504	605319	无锡振华	1,800	37,890.00	0.01
505	688133	泰坦科技	2,000	36,480.00	0.01
506	600113	浙江东日	2,600	36,192.00	0.01
507	300303	聚飞光电	5,200	35,464.00	0.00
508	688246	嘉和美康	1,400	34,720.00	0.00
509	300445	康斯特	2,000	32,540.00	0.00
510	688726	拉普拉斯	979	32,365.74	0.00
511	300643	万通智控	2,700	32,292.00	0.00
512	001391	国货航	4,686	31,864.80	0.00
513	600110	诺德股份	7,700	30,800.00	0.00
514	688178	万德斯	2,400	29,976.00	0.00
515	688098	申联生物	5,400	29,538.00	0.00
516	688151	华强科技	1,900	29,507.00	0.00
517	688598	金博股份	1,400	29,484.00	0.00
518	600033	福建高速	7,400	28,712.00	0.00
519	601515	东峰集团	7,100	28,258.00	0.00
520	301551	无线传媒	652	28,185.96	0.00
521	600977	中国电影	2,400	27,864.00	0.00
522	603072	天和磁材	2,255	27,736.50	0.00
523	600663	陆家嘴	2,800	27,552.00	0.00
524	002761	浙江建投	3,100	27,218.00	0.00
525	301120	新特电气	2,700	26,757.00	0.00
526	300123	亚光科技	4,600	26,680.00	0.00
527	300079	数码视讯	4,900	26,509.00	0.00
528	688593	新相微	1,400	25,620.00	0.00
529	600282	南钢股份	5,400	25,326.00	0.00
530	603228	景旺电子	900	25,056.00	0.00
531	002935	天奥电子	1,500	24,150.00	0.00
532	603358	华达科技	700	23,380.00	0.00
533	300408	三环集团	600	23,106.00	0.00
534	600458	时代新材	1,800	23,058.00	0.00
535	300768	迪普科技	1,300	22,750.00	0.00
536	688448	磁谷科技	800	22,504.00	0.00
537	300656	民德电子	900	22,392.00	0.00
538	603111	康尼机电	3,700	22,311.00	0.00
539	002668	TCL 智家	1,700	22,304.00	0.00
540	688296	和达科技	1,985	22,271.70	0.00
541	688172	燕东微	1,100	22,055.00	0.00

542	002019	亿帆医药	2,000	21,440.00	0.00
543	601801	皖新传媒	2,900	21,286.00	0.00
544	601107	四川成渝	4,000	20,920.00	0.00
545	301522	上大股份	816	20,269.44	0.00
546	002423	中粮资本	1,500	20,085.00	0.00
547	688105	诺唯赞	900	19,953.00	0.00
548	600780	通宝能源	3,500	19,705.00	0.00
549	600908	无锡银行	3,300	19,503.00	0.00
550	601949	中国出版	2,700	19,386.00	0.00
551	603338	浙江鼎力	300	19,356.00	0.00
552	601700	风范股份	4,300	19,350.00	0.00
553	603566	普莱柯	1,500	19,140.00	0.00
554	600420	国药现代	1,600	19,104.00	0.00
555	600418	江淮汽车	500	18,750.00	0.00
556	300158	振东制药	4,200	18,144.00	0.00
557	300366	创意信息	1,900	17,670.00	0.00
558	601678	滨化股份	4,600	17,296.00	0.00
559	000428	华天酒店	5,400	17,280.00	0.00
560	300525	博思软件	1,100	17,138.00	0.00
561	002498	汉缆股份	5,000	16,950.00	0.00
562	300083	创世纪	2,600	16,926.00	0.00
563	600531	豫光金铅	2,600	16,692.00	0.00
564	300257	开山股份	1,800	16,416.00	0.00
565	300241	瑞丰光电	2,900	15,921.00	0.00
566	600751	海航科技	6,000	15,780.00	0.00
567	301556	托普云农	267	15,766.35	0.00
568	603693	江苏新能	1,600	15,760.00	0.00
569	688183	生益电子	400	15,704.00	0.00
570	600206	有研新材	1,000	15,670.00	0.00
571	002987	京北方	1,100	15,653.00	0.00
572	301631	壹连科技	153	15,599.88	0.00
573	000738	航发控制	700	15,568.00	0.00
574	300869	康泰医学	1,100	15,334.00	0.00
575	002577	雷柏科技	800	15,144.00	0.00
576	300936	中英科技	400	15,120.00	0.00
577	688697	纽威数控	900	14,976.00	0.00
578	601069	西部黄金	1,300	14,885.00	0.00
579	301606	绿联科技	396	14,450.04	0.00
580	301571	国科天成	350	14,290.50	0.00
581	300443	金雷股份	700	13,944.00	0.00
582	301622	英思特	306	13,745.52	0.00
583	301029	怡合达	500	12,360.00	0.00
584	301608	博实结	184	12,029.92	0.00
585	688063	派能科技	300	12,015.00	0.00

586	301613	新铝时代	276	11,528.52	0.00
587	301586	佳力奇	215	11,425.10	0.00
588	688710	益诺思	332	11,148.56	0.00
589	600526	菲达环保	2,400	10,776.00	0.00
590	001236	弘业期货	1,100	10,604.00	0.00
591	301617	博苑股份	253	10,066.87	0.00
592	301603	乔锋智能	233	9,781.34	0.00
593	301607	富特科技	257	9,287.98	0.00
594	600919	江苏银行	900	8,838.00	0.00
595	002807	江阴银行	2,000	8,700.00	0.00
596	300188	国投智能	600	8,274.00	0.00
597	603194	中力股份	291	8,185.83	0.00
598	002716	湖南白银	2,400	8,136.00	0.00
599	301552	科力装备	143	8,132.41	0.00
600	002128	电投能源	400	7,832.00	0.00
601	300628	亿联网络	200	7,720.00	0.00
602	001279	强邦新材	265	7,396.15	0.00
603	603303	得邦照明	600	7,062.00	0.00
604	300573	兴齐眼药	100	6,978.00	0.00
605	600463	空港股份	700	6,951.00	0.00
606	688026	洁特生物	500	6,415.00	0.00
607	300284	苏交科	600	6,090.00	0.00
608	000935	四川双马	400	5,792.00	0.00
609	300454	深信服	100	5,740.00	0.00
610	603395	红四方	154	5,508.58	0.00
611	603207	小方制药	185	4,930.25	0.00
612	603310	巍华新材	254	4,559.30	0.00
613	603091	众鑫股份	94	4,176.42	0.00
614	603350	安乃达	106	3,834.02	0.00
615	600511	国药股份	100	3,422.00	0.00
616	300397	天和防务	300	3,297.00	0.00
617	603285	键邦股份	129	2,916.69	0.00
618	600152	维科技术	400	2,404.00	0.00
619	002410	广联达	200	2,352.00	0.00
620	000901	航天科技	200	2,194.00	0.00
621	603848	好太太	100	1,646.00	0.00
622	002635	安洁科技	100	1,592.00	0.00
623	603013	亚普股份	100	1,498.00	0.00
624	600330	天通股份	200	1,420.00	0.00
625	002585	双星新材	200	1,068.00	0.00
626	000597	东北制药	200	1,054.00	0.00
627	002105	信隆健康	200	998.00	0.00
628	000898	鞍钢股份	400	960.00	0.00
629	600210	紫江企业	100	661.00	0.00



#### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	603766	隆鑫通用	17,190,508.00	1.12
2	301239	普瑞眼科	15,551,651.00	1.01
3	688371	菲沃泰	14,789,572.34	0.96
4	688336	三生国健	14,626,273.69	0.95
5	000902	新洋丰	14,222,434.00	0.93
6	688617	惠泰医疗	14,078,090.61	0.92
7	600718	东软集团	12,730,727.00	0.83
8	000030	富奥股份	12,686,216.47	0.83
9	688315	诺禾致源	12,663,702.10	0.83
10	301217	铜冠铜箔	12,638,209.00	0.82
11	301015	百洋医药	12,624,908.00	0.82
12	601728	中国电信	12,620,343.00	0.82
13	601811	新华文轩	12,436,900.00	0.81
14	301028	东亚机械	12,389,277.00	0.81
15	002636	金安国纪	12,362,463.00	0.81
16	002595	豪迈科技	11,742,207.00	0.77
17	300259	新天科技	11,684,396.00	0.76
18	300502	新易盛	11,611,784.00	0.76
19	300476	胜宏科技	11,427,680.00	0.74
20	603699	纽威股份	11,397,883.00	0.74

注：“买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

##### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002130	沃尔核材	17,867,910.70	1.16
2	688183	生益电子	17,826,925.55	1.16
3	688100	威胜信息	17,395,826.24	1.13
4	603766	隆鑫通用	16,987,846.00	1.11
5	300323	华灿光电	16,308,007.00	1.06
6	601857	中国石油	15,950,660.00	1.04
7	002128	电投能源	15,815,510.00	1.03
8	600312	平高电气	15,801,531.20	1.03
9	600007	中国国贸	15,418,382.46	1.00

10	601728	中国电信	15,265,646.18	0.99
11	601138	工业富联	14,880,168.00	0.97
12	600718	东软集团	14,512,423.00	0.95
13	688617	惠泰医疗	14,209,374.61	0.93
14	301239	普瑞眼科	14,020,535.00	0.91
15	002636	金安国纪	13,515,956.40	0.88
16	000333	美的集团	13,375,980.00	0.87
17	601811	新华文轩	13,117,806.00	0.85
18	301217	铜冠铜箔	13,007,520.00	0.85
19	000902	新洋丰	12,955,301.00	0.84
20	601137	博威合金	12,897,100.00	0.84

注：“卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	7,333,203,913.59
卖出股票收入（成交）总额	8,072,133,972.91

注：“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

#### 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

#### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在风险可控的前提下，根据基金合同规定投资股指期货旨在配合基金日常投资管理需要，更有效地进行流动性管理，实现投资目标。

#### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末无国债期货投资。

8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货投资。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国农业银行股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责、处罚的情况。本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

8.12.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	423,460.80
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,516,279.54
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,939,740.34

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	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

华夏智胜新锐股票 A	13,158	19,127.85	15,368,847.41	6.11%	236,315,424.23	93.89%
华夏智胜新锐股票 C	9,978	44,285.50	32,289,810.13	7.31%	409,590,924.17	92.69%
合计	23,136	29,977.74	47,658,657.54	6.87%	645,906,348.40	93.13%

#### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	华夏智胜新锐股票 A	594,354.88	0.24%
	华夏智胜新锐股票 C	158,473.48	0.04%
	合计	752,828.36	0.11%

#### 9.3 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	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	华夏智胜新锐股票 A	0~10
	华夏智胜新锐股票 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	华夏智胜新锐股票 A	0
	华夏智胜新锐股票 C	0
	合计	0

## §10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华夏智胜新锐股票 A	华夏智胜新锐股票 C
基金合同生效日（2023 年 7 月 7 日）基金份额总额	511,273,756.06	989,025,856.78
本报告期期初基金份额总额	618,237,331.58	942,326,991.64
本报告期基金总申购份额	89,329,412.55	535,457,693.99
减：本报告期基金总赎回份额	455,882,472.49	1,035,903,951.33
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	251,684,271.64	441,880,734.30

## §11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 11.2 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

本报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期未发生影响基金管理人经营或基金运营业务的诉讼。

本报告期内，无涉及基金财产诉讼，本基金托管人不涉及公募基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

为本基金提供审计服务的会计师事务所由普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）更换为毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）。本基金本报告期应支付给毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为 55,000.00 元人民币。本基金本报告期内选聘毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）提供首年审计服务。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

措施 1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	管理人
受到稽查或处罚等措施的时间	2024-07-05
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证监会北京监管局
受到的具体措施类型	责令改正并暂停办理相关业务行政监管措施
受到稽查或处罚等措施的原因	部分制度不健全或执行不到位，部分业务管控不严
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	基金管理人高度重视，已按要求完成了整改，并已将整改落实情况报送监管机构
其他	无
措施 2	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	高级管理人员
受到稽查或处罚等措施的时间	2024-08-16
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证监会北京监管局
受到的具体措施类型	警示函
受到稽查或处罚等措施的原因	部分制度不健全或执行不到位，部分业务管控不严
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	不适用
其他	无

11.6.1 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易	股票交易	应支付该券商的佣金	备注
------	----	------	-----------	----

	单元 数量	成交金额	占当期股 票成交总 额的比例	佣金	占当期佣 金总量的 比例	
中信证券	3	15,401,731,586.65	100.00%	3,244,967.60	100.00%	-

注：①为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择研究服务证券公司的标准，即：

i 投研部门根据证券公司的总体资质情况、财务状况、研究服务能力、经营行为及风控合规能力等情况，选择证券公司进入交易合作库，并进行跟踪评估，对合作库证券公司进行调整。

ii 投研部门牵头制定证券公司研究服务评价制度，建立健全对证券公司研究服务的定期评价机制。评价指标包括但不限于：业绩贡献、反馈速度、观点或数据质量等。

②为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择交易服务证券公司的标准，即：

i 投资部门根据证券公司的总体资质、财务状况、经营行为和合规风控能力、交易服务能力等情况，选择证券公司进入交易合作库，并进行跟踪监控，对合作库证券公司进行调整。

ii 投资部门牵头制定证券公司交易服务评价制度，建立健全对证券公司交易服务的定期评价机制。

iii 投资部门定期对证券公司的交易服务开展评价，评价指标包括但不限于：交易服务成本、交易服务能力、交易系统稳定性、交易系统支持能力、应急交易能力等。

③证券公司专用交易单元选择程序：

i 投资、研究部门牵头制定规范、合理的合作证券公司管理制度，明确证券公司准入标准、退出程序等。合规管理部门对合作证券公司管理制度进行合规性审查。

ii 投资、研究部门根据上述标准进行评估并确定选用的证券公司。

iii 本基金管理人与被选择的证券公司签订交易单元租用协议/证券经纪服务协议。

④除本表列示外，本基金本报告期末选择其他交易单元作为本基金交易单元。

⑤本报告期内，本基金租用的券商交易单元未发生变更。

⑥本部分的数据统计时间区间与本报告的报告期一致：本公司网站披露的《华夏基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2024 年度）》的报告期为 2024 年 7 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日。敬请投资者关注上述报告统计时间区间的口径差异。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期 债券成 交总额 的比例	成交金 额	占当 期债 券回 购成	成交金额	占当 期权 证成 交总	成交金 额	占当 期基 金成 交总

				交总 额的 比例		额的 比例		额的 比例
中信证券	3,372,670.31	100.00%	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-01-13
2	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-02-03
3	华夏智胜新锐股票型证券投资基金调整申购、定期定额申购及转换转入业务上限的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-02-08
4	华夏智胜新锐股票型证券投资基金调整申购、定期定额申购及转换转入业务上限的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-03-01
5	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-03-21
6	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-09-12
7	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-10-12
8	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-10-19
9	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-11-29
10	华夏基金管理有限公司关于旗下 111 只基金改聘会计师事务所公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-12-03
11	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-12-25

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

1、中国证监会准予基金注册的文件；

- 2、基金合同；
- 3、托管协议；
- 4、法律意见书；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照。

### 13.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

### 13.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的住所免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

华夏基金管理有限公司

二〇二五年三月三十一日