
华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金

2023 年年度报告

2023 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：招商银行股份有限公司

送出日期：二〇二四年三月二十八日

§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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 3 月 26 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，普华永道中天会计师事务所（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 2023 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	14
§6 审计报告	15
§7 年度财务报表	16
7.1 资产负债表	17
7.2 利润表	18
7.3 净资产变动表	19
7.4 报表附注	20
§8 投资组合报告	59
8.1 期末基金资产组合情况	59
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	60
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	60
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	83
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	92
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	93
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	93
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	93
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	93
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	93
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	93
8.12 投资组合报告附注	93
§9 基金份额持有人信息	94
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	94
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	94
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	95
§10 开放式基金份额变动	95
§11 重大事件揭示	95
§12 影响投资者决策的其他重要信息	98
§13 备查文件目录	99

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金	
基金简称	华夏智胜价值成长股票	
基金主代码	002871	
交易代码	002871	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 3 月 6 日	
基金管理人	华夏基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	728,069,364.71 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华夏智胜价值成长股票 A	华夏智胜价值成长股票 C
下属分级基金的交易代码	002871	002872
报告期末下属分级基金的份额总额	278,848,250.97 份	449,221,113.74 份

2.2 基金产品说明

投资目标	利用定量投资模型，灵活应用多种策略，把握市场机会，追求资产的长期增值。
投资策略	主要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、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、期权投资策略、国债期货投资策略等。在股票投资策略上，本基金采用混合多种投资策略，包含基本面选股策略、多因子策略，辅助其他投资策略如套利类策略、衍生品交易类策略等。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率*95%+银行活期存款利率(税后)*5%。
风险收益特征	本基金为股票基金，其预期风险和预期收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金还可通过港股通渠道投资于香港证券市场，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还将面临汇率风险、香港市场风险等特殊投资风险。

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	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李彬	张姗
	联系电话	400-818-6666	400-61-95555
	电子邮箱	service@ChinaAMC.com	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		400-818-6666	400-61-95555
传真		010-63136700	0755-83195201
注册地址		北京市顺义区安庆大街甲3号	深圳市深南大道7088号招商银行大

	院	厦
办公地址	北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座8层	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
邮政编码	100033	518040
法定代表人	张佑君	缪建民

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
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	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼
注册登记机构	华夏基金管理有限公司	北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 8 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	2023 年		2022 年		2021 年	
	华夏智胜价值成长股票 A	华夏智胜价值成长股票 C	华夏智胜价值成长股票 A	华夏智胜价值成长股票 C	华夏智胜价值成长股票 A	华夏智胜价值成长股票 C
本期已实现收益	-5,536,327.17	7,933,363.66	-3,413,319.99	-8,439,987.84	54,603,783.29	23,191,098.07
本期利润	-4,774,910.82	3,632,823.99	-4,325,581.94	-14,377,250.83	64,320,092.28	18,926,442.72
加权平均基金份额本期利润	-0.0228	0.0084	-0.0679	-0.0985	0.3217	0.0887
本期加权平均净值利润率	-1.49%	0.55%	-4.87%	-7.08%	24.87%	6.23%
本期基金份额净值增	6.43%	6.16%	-4.41%	-4.64%	28.43%	28.12%

长率						
3.1.2 期末数据和指标	2023 年末		2022 年末		2021 年末	
	华夏智胜价值成长股票 A	华夏智胜价值成长股票 C	华夏智胜价值成长股票 A	华夏智胜价值成长股票 C	华夏智胜价值成长股票 A	华夏智胜价值成长股票 C
期末可供分配利润	133,698,344.44	208,940,111.44	26,955,333.41	76,772,530.18	30,392,507.93	75,124,046.64
期末可供分配基金份额利润	0.4795	0.4651	0.4128	0.4023	0.4758	0.4688
期末基金资产净值	419,287,385.21	668,766,925.48	92,261,479.23	267,620,628.35	94,409,529.43	235,662,902.18
期末基金份额净值	1.5036	1.4887	1.4128	1.4023	1.4780	1.4706
3.1.3 累计期末指标	2023 年末		2022 年末		2021 年末	
	华夏智胜价值成长股票 A	华夏智胜价值成长股票 C	华夏智胜价值成长股票 A	华夏智胜价值成长股票 C	华夏智胜价值成长股票 A	华夏智胜价值成长股票 C
基金份额累计净值增长率	55.73%	64.53%	46.33%	54.98%	53.08%	62.53%

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

华夏智胜价值成长股票 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	-1.69%	0.76%	-4.36%	0.82%	2.67%	-0.06%
过去六个月	-4.19%	0.77%	-9.01%	0.81%	4.82%	-0.04%
过去一年	6.43%	0.74%	-7.01%	0.78%	13.44%	-0.04%
过去三年	30.66%	1.04%	-11.92%	1.00%	42.58%	0.04%
过去五年	106.57%	1.17%	32.17%	1.09%	74.40%	0.08%

自基金转型起至今	55.73%	1.18%	2.25%	1.11%	53.48%	0.07%
----------	--------	-------	-------	-------	--------	-------

华夏智胜价值成长股票 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	-1.75%	0.76%	-4.36%	0.82%	2.61%	-0.06%
过去六个月	-4.31%	0.77%	-9.01%	0.81%	4.70%	-0.04%
过去一年	6.16%	0.74%	-7.01%	0.78%	13.17%	-0.04%
过去三年	29.70%	1.04%	-11.92%	1.00%	41.62%	0.04%
2019 年 12 月 24 日起至今	64.53%	1.17%	4.59%	1.07%	59.94%	0.10%

注：2018 年 3 月 6 日至 2018 年 12 月 25 日，2019 年 1 月 7 日至 2019 年 12 月 23 日期间，华夏智胜价值成长股票 C 类基金份额为零。

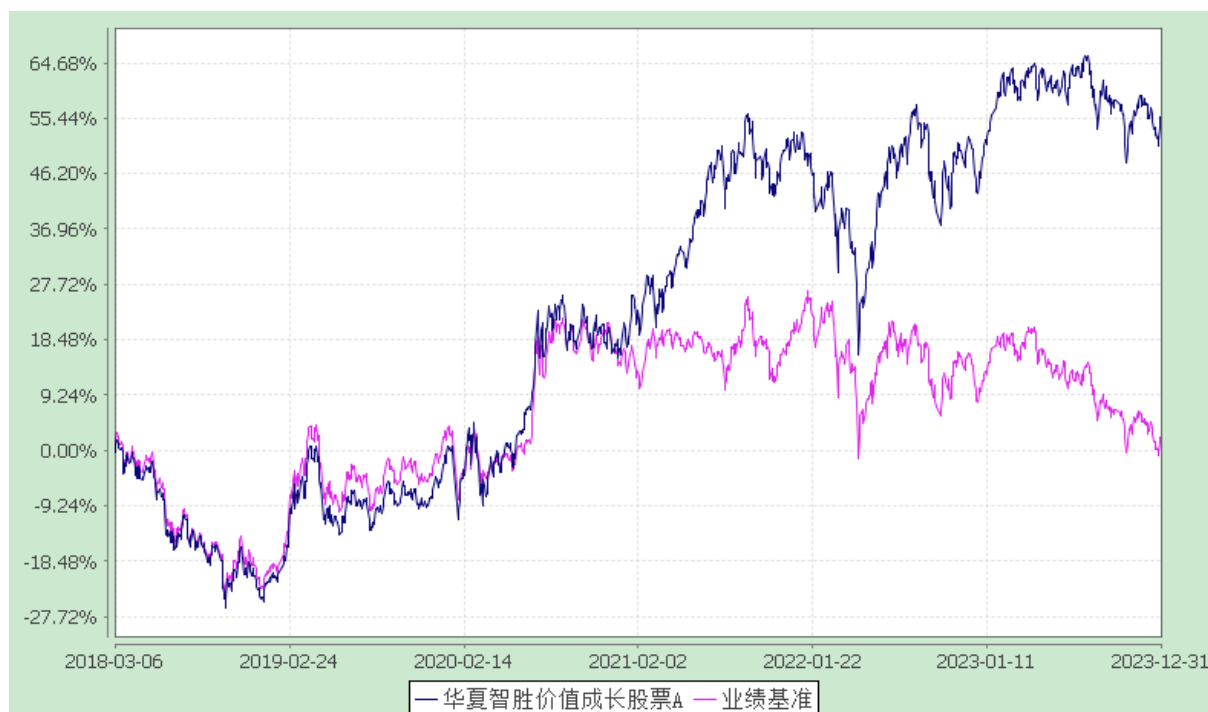
3.2.2 自基金转型以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金

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

(2018 年 3 月 6 日至 2023 年 12 月 31 日)

华夏智胜价值成长股票 A



注：本基金自 2018 年 3 月 6 日起由“华夏新锦源灵活配置混合型证券投资基金”转型而来。

华夏智胜价值成长股票 C



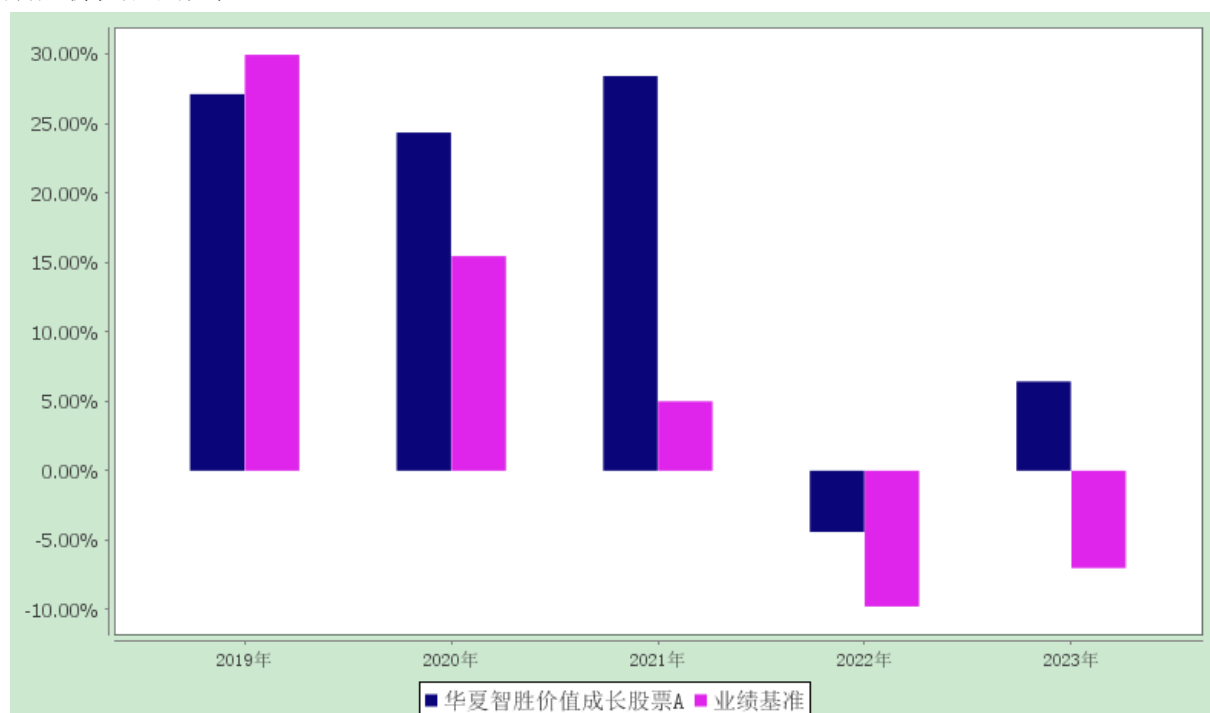
注：2018 年 3 月 6 日至 2018 年 12 月 25 日，2019 年 1 月 7 日至 2019 年 12 月 23 日期间，华夏智胜价值成长股票 C 类基金份额为零。

3.2.3 过去五年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

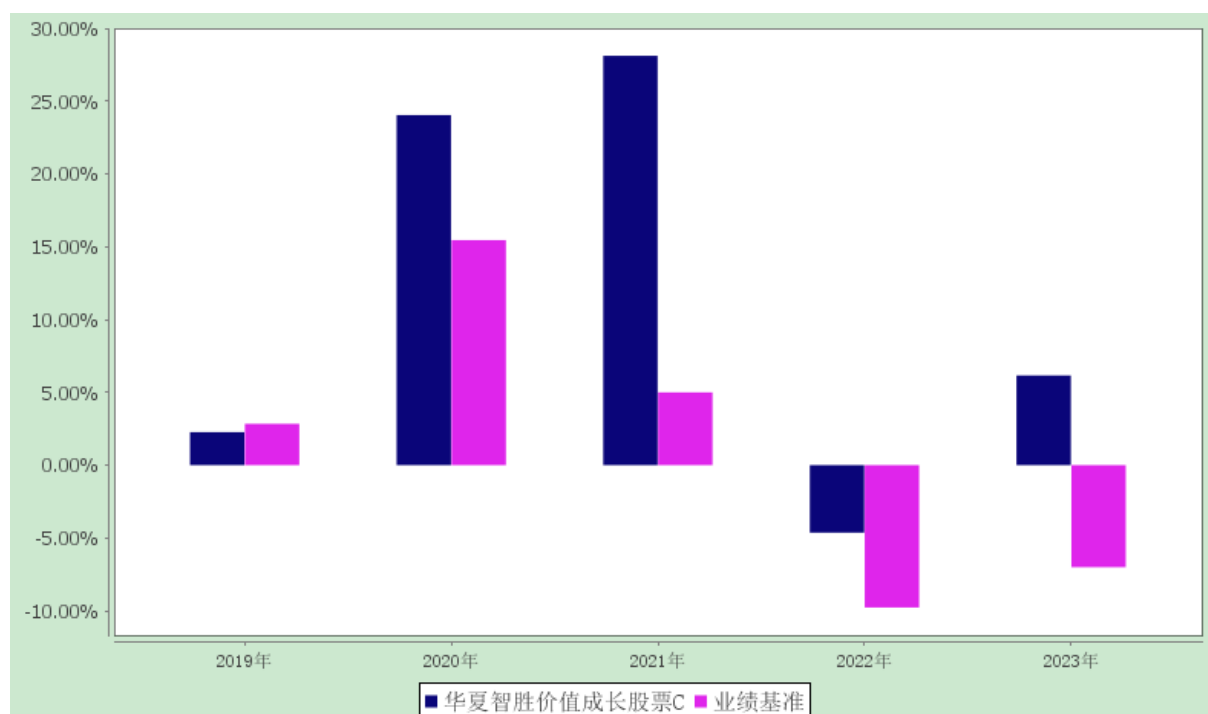
华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金

过去五年基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图

华夏智胜价值成长股票 A



华夏智胜价值成长股票 C



注：2018年3月6日至2018年12月25日，2019年1月7日至2019年12月23日期间，华夏智胜价值成长股票C类基金份额为零。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年无利润分配事项。

§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，国内首家承诺“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 2023 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 1/10；在对冲策略绝对收益目标基金(A 类)中华夏安泰对冲策略 3 个月定开混合排名第 1/22；在消费行业偏股型基金(A 类)中华夏网购精选混合(A 类)排名第 2/68、华夏消费升级混合(A 类)排名第 11/68、华夏消费龙头混合(A 类)排名第 13/68、华夏新兴消费混合(A 类)排名第 21/68；在低碳环保行业股票型基金(A 类)中华夏节能环保股票(A 类)排名第 3/10；在增强规模指数股票型基金(A 类)中华夏中证 500 指数增强(A 类)排名第 3/145、华夏中证 500 指数智选增强(A 类)排名第 4/145、华夏中证 1000 指数增强(A 类)排名第 20/145；在 TMT 与信息技术行业偏股型基金(A 类)中华夏数字经济龙头混合发起式(A 类)排名第 4/30；在新能源主题股票型基金(A 类)中华夏能源革新股票(A 类)排名第 4/14；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 4/13；在灵活配置型基金(基准股票比例 30%-60%)(A 类)中华夏新锦绣混合(A 类)排名第 4/421、华夏稳增混合排名第 10/421；在偏股型基金(股票上限 95%)(A 类)中华夏磐锐一年定开混合(A 类)排名第 4/216、华夏磐利一年定开混合(A 类)排名第 21/216、华夏新兴经济一年持有混合(A 类)排名第 33/216；在标准股票型基金(A 类)中华夏智胜先锋股票（LOF）(A 类)排名第 8/326、华夏智胜价值成长股票(A 类)排名第 15/326。

固收与固收+产品：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 1/349、华夏稳福六个月持有混合(A 类)排名第 17/349、华夏睿磐泰兴混合(A 类)排名第 28/349；在长期纯债债券型基金(A 类)中华夏鼎成一年定开债券排名第 12/1340、华夏鼎航债券(A 类)排名第 14/1340；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 13/402、华夏鼎源债券(A 类)排名第 14/402、华夏卓信一年定开债券发起式排名第 25/402、华夏希望债券(A 类)排名第 32/402、华夏鼎泓债券(A 类)排名第 34/402、华夏卓享债券(A 类)排名第 38/402；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 34/137。

指数产品：在主题指数股票 ETF 基金中华夏中证动漫游戏 ETF 排名第 2/343、华夏中证 5G 通信主题 ETF 排名第 10/343、华夏中证云计算与大数据主题 ETF 排名第 16/343、华夏中证人工智能主题 ETF 排名第 20/343、华夏国证消费电子主题 ETF 排名第 24/343、华夏中证智能汽车主题 ETF 排

排名第 25/343、华夏中证金融科技主题 ETF 排名第 28/343、华夏中证文化传媒 ETF 排名第 31/343、华夏中证机器人 ETF 排名第 39/343；在策略指数股票 ETF 基金中华夏中证智选 500 价值稳健策略 ETF 排名第 6/37、华夏中证智选 1000 价值稳健策略 ETF 排名第 10/37；在行业指数股票 ETF 基金中华夏中证全指证券公司 ETF 排名第 10/66；在规模指数股票 ETF 基金中华夏中证 1000ETF 排名第 17/146、华夏中证 500ETF 排名第 26/146；在主题指数股票 ETF 联接基金(A 类)中华夏中证动漫游戏 ETF 发起式联接(A 类)排名第 2/125、华夏中证 5G 通信主题 ETF 联接(A 类)排名第 6/125、华夏中证人工智能主题 ETF 联接(A 类)排名第 9/125、华夏中证央企 ETF 联接(A 类)排名第 25/125；在行业指数股票 ETF 联接基金(A 类)中华夏中证全指证券公司 ETF 联接(A 类)排名第 6/36；在规模指数股票 ETF 联接基金(A 类)中华夏中证 1000ETF 发起式联接(A 类)排名第 11/106、华夏中证 500ETF 联接(A 类)排名第 19/106；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 5/16；在利率债指数债券型基金(A 类)中华夏彭博政金债 1-5 年(A 类)排名第 13/115。

在《证券时报》主办的第十八届中国基金业“明星基金奖”评选活动上，华夏基金将两大奖项收入囊中：公司层面，华夏基金荣获“三年海外投资明星基金公司”；产品层面，华夏沪深 300ETF 荣获“三年持续回报指数型明星基金奖”。在《上海证券报》主办的第二十届“金基金”奖评选活动上，华夏基金荣膺三项大奖，公司层面获得“被动投资基金管理公司奖”，产品层面华夏创新前沿股票和华夏行业景气混合分别荣获股票型基金五年期奖和偏股混合型基金五年期奖。

在客户服务方面，2023 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）华夏基金直销渠道优化页面显示，升级搜索及查询功能，让客户操作更加便利；（2）华夏基金管家客户端优化“忘记密码”功能及定投模块，上线亲子账户、资产诊断等功能，贴合客户投资需求，进一步提升使用体验；（3）与华润银行、贵州银行、武汉农商行等代销机构合作，拓展更加丰富的客户理财渠道；（4）开展“帮你问了 ChatGPT”、“指数攻防值来啦！”、“华夏基金模拟投基大赛”、“煎熬的磨底期里找机会”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	2020-03-17	-	9 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。

孙然晔	本基金的基金经理	2022-07-04	-	9 年	博士。曾任美国银行企业投资部资深量化研究员，美国 AQR 资本管理公司量化研究员。2019 年 8 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	2023-03-28	-	6 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 255 次，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

2023 年，国际格局复杂演变，地缘政治冲突频发，国际经济贸易投资放缓，通胀出现高位回落趋势，发达国家利率保持高位。国内方面，在外部环境更趋复杂严峻的情况下，我国经济呈现出回升向好、动力增强的态势，高质量发展扎实推进，但仍面临有效需求不足、部分行业产能过剩、社会预期偏弱等挑战；货币政策方面，面对发达经济体货币政策的外溢影响，央行两次下调政策利率和存款准备金率，保持了市场流动性的合理充裕。

市场方面，A 股市场上涨后震荡下跌，热点板块快速轮动。行业间表现差异比较大：通信、传媒、计算机等科技相关行业表现较好，而美容护理、商业贸易、房地产等消费行业表现较差。从量化角度看，低波、反转等因子表现持续较好，而盈利、成长等因子持续走弱，期间量化策略整体表现正常。

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 2023 年 12 月 31 日，华夏智胜价值成长股票 A 基金份额净值为 1.5036 元，本报告期份额净值增长率为 6.43%；华夏智胜价值成长股票 C 基金份额净值为 1.4887 元，本报告期份额净值增长率为 6.16%，同期业绩比较基准增长率为-7.01%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2024 年政府预计设定较高经济增长目标，货币政策将继续保持宽松，而财政政策将发挥更大作用，A 股上市公司盈利预计温和增长。随着投资者悲观情绪逐渐修复，市场预计震荡上行；短期市场风格切换将发生，但长期市场风格维持轮动特征，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，在信息披露、洗钱风险管理、关联交易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。积极优化合规管理的机制化和系统化，完善合规考核评价机制、子公司管理机制，大力推进合规管理综合服务、制度管理、知识搜索等系统化建设，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，稳步夯实投资风险管理基础。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

托管人声明：

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§6 审计报告

普华永道中天审字（2024）第 21425 号

华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金全体基金份额持有人：

6.1 审计意见

（一）我们审计的内容

我们审计了华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金(以下简称“华夏智胜价值成长股票”)的财务报表，包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表，2023 年度的利润表和净资产变动表以及财务报表附注。

（二）我们的意见

我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注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”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了华夏智胜价值成长股票 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 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。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。

按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于华夏智胜价值成长股票，并履行了职业道德方面的其他责任。

6.3 管理层和治理层对财务报表的责任

华夏智胜价值成长股票的基金管理人华夏基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，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，基金管理人管理层负责评估华夏智胜价值成长股票的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算华夏智胜价值成长股票、终止运营或别无其他现实的选择。

基金管理人治理层负责监督华夏智胜价值成长股票的财务报告过程。

6.4 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：

(一) 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。

(二) 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。

(三) 评价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。

(四) 对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，就可能导致对华夏智胜价值成长股票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华夏智胜价值成长股票不能持续经营。

(五) 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。

普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

中国注册会计师

朱宏宇 朱寅婷

上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼

2024 年 3 月 26 日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金

报告截止日：2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	7.4.7.1	60,677,087.31	23,104,069.86
结算备付金		6,003,889.68	1,936,281.56
存出保证金		940,981.41	878,318.31
交易性金融资产	7.4.7.2	1,025,226,668.90	334,769,166.48
其中：股票投资		1,024,648,781.35	334,582,219.20
基金投资		-	-
债券投资		577,887.55	186,947.28
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		3,864,612.15	72,284.66
应收股利		-	-
应收申购款		3,944,965.26	1,349,509.02
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		1,100,658,204.71	362,109,629.89
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 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		2,667,393.91	-
应付赎回款		8,165,015.74	753,098.59
应付管理人报酬		937,936.07	311,867.41
应付托管费		187,587.22	62,373.49
应付销售服务费		145,938.25	58,229.62
应付投资顾问费		-	-
应交税费		1.93	0.97
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	500,020.90	1,041,952.23

负债合计		12,603,894.02	2,227,522.31
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	728,069,364.71	256,154,243.99
未分配利润	7.4.7.8	359,984,945.98	103,727,863.59
净资产合计		1,088,054,310.69	359,882,107.58
负债和净资产总计		1,100,658,204.71	362,109,629.89

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，华夏智胜价值成长股票 A 基金份额净值 1.5036 元，华夏智胜价值成长股票 C 基金份额净值 1.4887 元；华夏智胜价值成长股票基金份额总额 728,069,364.71 份（其中 A 类 278,848,250.97 份，C 类 449,221,113.74 份）。

7.2 利润表

会计主体：华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
一、营业总收入		12,295,793.05	-14,492,505.87
1.利息收入		303,134.93	106,410.85
其中：存款利息收入	7.4.7.9	303,134.93	106,410.85
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		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		14,934,712.06	-7,780,050.37
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-23,542.29	-11,546,353.81
基金投资收益	7.4.7.11	-	-
债券投资收益	7.4.7.12	996,137.24	311,840.44
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	-713,144.41	-370,629.63
股利收益	7.4.7.16	14,675,261.52	3,825,092.63
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	-3,539,123.32	-6,849,524.94
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	597,069.38	30,658.59
减：二、营业总支出		13,437,879.88	4,210,326.90
1.管理人报酬		9,685,051.95	2,900,793.84
2.托管费		1,937,010.50	580,158.68
3.销售服务费		1,629,069.40	503,920.28

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		308.75	1.21
8.其他费用	7.4.7.21	186,439.28	225,452.89
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-1,142,086.83	-18,702,832.77
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-1,142,086.83	-18,702,832.77
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-1,142,086.83	-18,702,832.77

7.3 净资产变动表

会计主体：华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 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	256,154,243.99	103,727,863.59	359,882,107.58
二、本期期初净资产	256,154,243.99	103,727,863.59	359,882,107.58
三、本期增减变动额 （减少以“-”号填列）	471,915,120.72	256,257,082.39	728,172,203.11
（一）、综合收益总额	-	-1,142,086.83	-1,142,086.83
（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）	471,915,120.72	257,399,169.22	729,314,289.94
其中：1.基金申购款	1,052,725,412.62	563,436,432.21	1,616,161,844.83
2.基金赎回款	-580,810,291.90	-306,037,262.99	-886,847,554.89
（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	728,069,364.71	359,984,945.98	1,088,054,310.69
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 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	224,124,467.98	105,947,963.63	330,072,431.61
二、本期期初净资产	224,124,467.98	105,947,963.63	330,072,431.61

三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	32,029,776.01	-2,220,100.04	29,809,675.97
(一)、综合收益总额	-	-18,702,832.77	-18,702,832.77
(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)	32,029,776.01	16,482,732.73	48,512,508.74
其中: 1.基金申购款	119,419,738.56	51,314,400.68	170,734,139.24
2.基金赎回款	-87,389,962.55	-34,831,667.95	-122,221,630.50
(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	256,154,243.99	103,727,863.59	359,882,107.58

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

根据原华夏新锦源灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“华夏新锦源混合”)基金份额持有人大会审议通过的《关于华夏新锦源灵活配置混合型证券投资基金转型为华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金有关事项的议案》以及相关法律法规的规定,并向中国证券监督管理委员会备案,华夏新锦源混合于 2018 年 3 月 6 日转型为华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)。本基金为契约型开放式,存续期限为不定期。本基金的基金管理人为华夏基金管理有限公司,基金托管人为招商银行股份有限公司。

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)、港股通标的股票、债券(包括国债、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、公开发行的次级债券、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、期权等)、货币市场工具(含同业存单)、资产支持证券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。

本基金投资组合比例为:股票投资占基金资产的比例为 80%-95%,港股通标的股票投资占股票

资产的比例为 0-50%，每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货、期权合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，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商业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 and 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为投资收益。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 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
活期存款	60,677,087.31	23,104,069.86
等于：本金	60,670,535.30	23,101,558.32
加：应计利息	6,552.01	2,511.54
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	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
合计	60,677,087.31	23,104,069.86

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末			
		2023 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		1,032,502,135.39	-	1,024,648,781.35	-7,853,354.04
贵金属投资- 金交所黄金 合约		-	-	-	-
债券	交 易 所 市 场	562,500.00	69.05	577,887.55	15,318.50
	银 行 间 市 场	-	-	-	-
	合计	562,500.00	69.05	577,887.55	15,318.50
资产支持证 券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		1,033,064,635.39	69.05	1,025,226,668.90	-7,838,035.54
项目		上年度末			
		2022 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动

股票		338,933,674.12	-	334,582,219.20	-4,351,454.92
贵金属投资- 金交所黄金 合约		-	-	-	-
债券	交易所市 场	186,700.00	24.58	186,947.28	222.70
	银行间市 场	-	-	-	-
	合计	186,700.00	24.58	186,947.28	222.70
资产支持证 券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		339,120,374.12	24.58	334,769,166.48	-4,351,232.22

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 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	6,747,280.00	-	-	-
其中：股指期货	6,747,280.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	6,747,280.00	-	-	-
项目	上年度末 2022 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	6,032,840.00	-	-	-
其中：股指期货	6,032,840.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	6,032,840.00	-	-	-

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
IC2403	中证 500 期货	6	6,497,520.00	-249,760.00

	IC2403 合约			
合计	-	-	-	-249,760.00
减: 可抵销期货暂收款	-	-	-	-249,760.00
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 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	8,682.60	407.51
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	311,338.30	861,544.72
其中: 交易所市场	311,338.30	861,544.72
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	180,000.00	180,000.00
合计	500,020.90	1,041,952.23

7.4.7.7 实收基金

华夏智胜价值成长股票 A

金额单位: 人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	65,306,145.82	65,306,145.82
本期申购	319,604,890.36	319,604,890.36

本期赎回（以“-”号填列）	-106,062,785.21	-106,062,785.21
本期末	278,848,250.97	278,848,250.97

华夏智胜价值成长股票 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	190,848,098.17	190,848,098.17
本期申购	733,120,522.26	733,120,522.26
本期赎回（以“-”号填列）	-474,747,506.69	-474,747,506.69
本期末	449,221,113.74	449,221,113.74

7.4.7.8 未分配利润

华夏智胜价值成长股票 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	27,637,018.89	-681,685.48	26,955,333.41
本期期初	27,637,018.89	-681,685.48	26,955,333.41
本期利润	-5,536,327.17	761,416.35	-4,774,910.82
本期基金份额交易产生的变动数	111,597,652.72	6,661,058.93	118,258,711.65
其中：基金申购款	165,339,403.08	8,161,092.81	173,500,495.89
基金赎回款	-53,741,750.36	-1,500,033.88	-55,241,784.24
本期已分配利润	-	-	-
本期末	133,698,344.44	6,740,789.80	140,439,134.24

华夏智胜价值成长股票 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	78,823,092.69	-2,050,562.51	76,772,530.18
本期期初	78,823,092.69	-2,050,562.51	76,772,530.18
本期利润	7,933,363.66	-4,300,539.67	3,632,823.99
本期基金份额交易产生的变动数	122,183,655.09	16,956,802.48	139,140,457.57
其中：基金申购款	365,089,040.95	24,846,895.37	389,935,936.32
基金赎回款	-242,905,385.86	-7,890,092.89	-250,795,478.75
本期已分配利润	-	-	-
本期末	208,940,111.44	10,605,700.30	219,545,811.74

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

	月 31 日	月 31 日
活期存款利息收入	221,353.99	67,048.09
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	79,127.81	37,284.17
其他	2,653.13	2,078.59
合计	303,134.93	106,410.85

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-23,542.29	-11,546,353.81
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	-23,542.29	-11,546,353.81

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	6,060,238,665.61	2,165,622,104.11
减：卖出股票成本总额	6,051,860,240.23	2,172,715,583.89
减：交易费用	8,401,967.67	4,452,874.03
买卖股票差价收入	-23,542.29	-11,546,353.81

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 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
债券投资收益——利息收入	479.88	348.78

债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	995,657.36	311,491.66
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	996,137.24	311,840.44

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 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	3,840,061.39	1,877,956.04
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	2,843,800.00	1,566,100.00
减：应计利息总额	449.98	340.78
减：交易费用	154.05	23.60
买卖债券差价收入	995,657.36	311,491.66

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 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
股指期货投资收益	-713,144.41	-370,629.63

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
股票投资产生的股利收益	14,675,261.52	3,825,092.63
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	14,675,261.52	3,825,092.63

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31 日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31 日
1.交易性金融资产	-3,486,803.32	-6,414,784.94
——股票投资	-3,501,899.12	-6,394,348.04
——债券投资	15,095.80	-20,436.90
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	-52,320.00	-434,740.00
——权证投资	-	-
——期货投资	-52,320.00	-434,740.00
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	-3,539,123.32	-6,849,524.94

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
基金赎回费收入	597,069.38	30,658.59
合计	597,069.38	30,658.59

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 2023年1月1日至2023年12月31 日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31 日
----	---------------------------------	--------------------------------------

审计费用	60,000.00	60,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行费用	6,439.26	5,452.89
存托服务费	0.02	-
其他	-	40,000.00
合计	186,439.28	225,452.89

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
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	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
POWER CORPORATION OF CANADA	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
华夏资本管理有限公司（“华夏资本”）	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
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
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：①根据华夏基金管理有限公司于 2023 年 1 月 6 日发布的公告，华夏基金管理有限公司股权结构变更为中信证券（出资比例 62.2%）、MACKENZIE FINANCIAL CORPORATION（出资比例 27.8%）、天津海鹏科技咨询有限公司（出资比例 10%）。

②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	上年度可比期间
-------	----	---------

	2023年1月1日至2023年12月31日		2022年1月1日至2022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	8,872,157,660.55	69.42%	1,017,292,893.80	23.34%

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 2023年1月1日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022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	2,652,517.41	69.07%	1,242,492.63	66.16%

7.4.10.1.4 债券回购交易

无。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1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	1,141,356.25	40.37%	134,285.83	43.13%
关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022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	438,765.80	23.34%	57,869.93	6.72%

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。

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 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
----	-----------------------------	----------------------------------

	月31日	月31日
当期发生的基金应支付的管理费	9,685,051.95	2,900,793.84
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,759,337.52	102,132.15
应支付基金管理人的净管理费	7,925,714.43	2,798,661.69

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×1.00%/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 2023年1月1日至2023年12 月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12 月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,937,010.50	580,158.68

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×0.20%/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 联方 名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华夏智胜价值成长股票 A	华夏智胜价值成长股票 C	合计
华夏基金 管理有 限公 司	-	546,915.38	546,915.38
招商 银行	-	83,061.07	83,061.07

中信 证券	-	25,076.61	25,076.61
华夏 财富	-	746.28	746.28
中信 证券 (山 东)	-	546.34	546.34
中信 证券 (华 南)	-	240.04	240.04
中信 期货	-	139.88	139.88
合计	-	656,725.60	656,725.60
获得 销售 服务 费的 各关 联方 名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华夏智胜价值成长股票 A	华夏智胜价值成长股票 C	合计
华夏 基金 管理 有限 公司	-	417,397.27	417,397.27
中信 证券	-	1,773.48	1,773.48
华夏 财富	-	352.28	352.28
招商 银行	-	47.38	47.38
中信 证券 (华 南)	-	13.25	13.25
中信 证券 (山 东)	-	3.43	3.43

合计	-	419,587.09	419,587.09
----	---	------------	------------

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 0.25% 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 \times 0.25% / 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

份额单位：份

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日	
	华夏智胜价值成长 股票A	华夏智胜价值成长 股票C	华夏智胜价值成长 股票A	华夏智胜价值成长 股票C
期初持有的基金份额	10,608,423.83	-	10,608,423.83	-
期间申购/买入总份额	-	-	-	-
期间因拆分变动份额	-	-	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-	-	-
期末持有的基金份额	10,608,423.83	-	10,608,423.83	-
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	3.80%	-	16.24%	-

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 2023年1月1日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022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
招商银行活期存款	60,677,087.31	221,353.99	23,104,069.86	67,048.09

注：本基金的活期银行存款由基金托管人招商银行保管，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 2023 年 1 月 1 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
中信证券	688563	航材股份	新股发行	7,440	587,685.60
中信证券	688343	云天励飞	新股发行	10,484	460,457.28
中信证券	001286	陕西能源	新股发行	37,667	361,603.20
中信证券	603296	华勤技术	新股发行	4,227	341,541.60
中信证券	301559	中集环科	新股发行	13,144	318,347.68
中信证券	301371	敷尔佳	新股发行	5,637	313,868.16
中信证券	688146	中船特气	新股发行	7,317	264,509.55
中信证券	688581	安杰思	新股发行	1,629	204,928.20
中信证券	688539	高华科技	新股发行	5,334	203,865.48
中信证券	688522	纳睿雷达	新股发行	3,836	179,064.48
中信证券	301439	泓淋电力	新股发行	7,083	141,589.17
中信证券	688523	航天环宇	新股发行	4,717	103,113.62
中信证券	301293	三博脑科	新股发行	3,324	98,390.40
中信证券	301323	新莱福	新股发行	2,277	88,939.62
中信证券	688450	光格科技	新股发行	1,662	88,235.58
中信证券	688631	莱斯信息	新股发行	3,357	84,864.96
中信证券	301170	锡南科技	新股发行	2,496	84,864.00
中信证券	301157	华塑科技	新股发行	1,498	84,637.00
中信证券	601133	柏诚股份	新股发行	6,632	77,329.12
中信证券	301261	恒工精密	新股发行	1,973	72,803.70
中信证券	301517	陕西华达	新股发行	1,841	49,467.67
中信证券	603281	江瀚新材	新股发行	863	30,714.17
中信证券	001367	海森药业	新股发行	549	24,419.52
中信证券	001324	长青科技	新股发行	1,131	21,353.28
中信证券	603162	海通发展	新股发行	523	19,481.75
上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 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	688302	海创药业	新股发行	5,959	255,760.28
中信证券	688223	晶科能源	新股发行	41,748	208,740.00
中信证券	688382	益方生物	新股发行	11,081	200,787.72
中信证券	688141	杰华特	新股发行	4,326	165,512.76
中信证券	301335	天元宠物	新股发行	3,242	162,035.16
中信证券	301377	鼎泰高科	新股发行	6,012	137,554.56
中信证券	688061	灿瑞科技	新股发行	1,191	134,213.79
中信证券	301165	锐捷网络	新股发行	4,135	133,891.30
中信证券	688380	中微半导	新股发行	4,321	133,346.06
中信证券	688426	康为世纪	新股发行	2,697	132,099.06
中信证券	301200	大族数控	新股发行	1,713	131,147.28
中信证券	688326	经纬恒润	新股发行	986	119,306.00
中信证券	301302	华如科技	新股发行	2,272	118,212.16
中信证券	688432	有研硅	新股发行	11,705	115,996.55
中信证券	301109	军信股份	新股发行	3,185	110,869.85
中信证券	301230	泓博医药	新股发行	2,687	107,480.00
中信证券	688114	华大智造	新股发行	1,231	107,318.58
中信证券	688252	天德钰	新股发行	4,792	103,890.56
中信证券	688290	景业智能	新股发行	3,040	103,025.60
中信证券	301269	华大九天	新股发行	2,986	97,612.34
中信证券	688370	丛麟科技	新股发行	1,545	92,329.20
中信证券	688150	莱特光电	新股发行	3,979	87,736.95
中信证券	301349	信德新材	新股发行	621	86,244.48
中信证券	301171	易点天下	新股发行	4,200	76,356.00
中信证券	688525	佰维存储	新股发行	4,614	64,549.86
中信证券	600938	中国海油	新股发行	4,000	43,200.00
中信证券	603235	天新药业	新股发行	572	21,095.36
中信证券	001330	博纳影业	新股发行	3,564	17,926.92
中信证券	001322	箭牌家居	新股发行	1,313	16,648.84
中信证券	603132	金徽股份	新股发行	1,342	14,493.60
中信证券	001339	智微智能	新股发行	812	13,690.32
中信证券	603191	望变电气	新股发行	1,149	13,627.14
中信证券	603209	兴通股份	新股发行	595	12,804.40
中信证券	603151	邦基科技	新股发行	535	9,603.25
中信证券	001266	宏英智能	新股发行	247	9,536.67
中信证券	603215	比依股份	新股发行	575	7,187.50
中信证券	603051	鹿山新材	新股发行	272	7,014.88

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（2023 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
688717	艾罗能源	2023-12-26	6 个月	新发流通受限	55.66	55.66	11,303	629,124.98	629,124.98	-
688717	艾罗能源	2023-12-26	1 个月内 (含)	新发流通受限	55.66	55.66	4,844	269,617.04	269,617.04	-
688548	广钢气体	2023-08-08	6 个月	新发流通受限	9.87	12.75	4,048	39,953.76	51,612.00	-
688563	航材股份	2023-07-12	6 个月	新发流通受限	78.99	60.49	744	58,768.56	45,004.56	-
301526	国际复材	2023-12-19	6 个月	新发流通受限	2.66	4.45	9,723	25,863.18	43,267.35	-

301291	明阳电气	2023-06-21	6 个月	新发流通受限	38.13	28.36	1,206	45,984.78	34,202.16	-
603296	华勤技术	2023-08-01	6 个月	新发流通受限	80.80	77.75	423	34,178.40	32,888.25	-
301348	蓝箭电子	2023-08-01	6 个月	新发流通受限	18.08	44.57	613	11,083.04	27,321.41	-
688702	盛科通信	2023-09-06	6 个月	新发流通受限	42.66	48.18	549	23,420.34	26,450.82	-
688582	芯动联科	2023-06-21	6 个月	新发流通受限	26.74	38.67	648	17,327.52	25,058.16	-
301559	中集环科	2023-09-26	6 个月	新发流通受限	24.22	18.24	1,315	31,849.30	23,985.60	-
301486	致尚科技	2023-06-30	6 个月	新发流通受限	57.66	47.25	482	27,792.12	22,774.50	-
301511	德福科技	2023-08-08	6 个月	新发流	28.00	22.67	982	27,496.00	22,261.94	-

				通 受 限						
688652	京仪 装备	2023- 11-22	6 个月	新发 流通 受限	31.95	52.25	416	13,291.20	21,736.00	-
301525	儒竞 科技	2023- 08-23	6 个月	新发 流通 受限	99.57	81.46	266	26,485.62	21,668.36	-
301498	乖宝 宠物	2023- 08-09	6 个月	新发 流通 受限	39.99	38.81	554	22,154.46	21,500.74	-
301371	敷尔 佳	2023- 07-24	6 个月	新发 流通 受限	55.68	37.58	564	31,403.52	21,195.12	-
301370	国科 恒泰	2023- 07-03	6 个月	新发 流通 受限	13.39	16.01	1,240	16,603.60	19,852.40	-
688627	精智 达	2023- 07-11	6 个月	新发 流通 受限	46.77	87.72	222	10,382.94	19,473.84	-
301488	豪恩 汽电	2023- 06-26	6 个月	新发 流通 受限	39.78	69.09	262	10,422.36	18,101.58	-

301468	博盈特焊	2023-07-12	6 个月	新发流通受限	47.58	30.22	598	28,452.84	18,071.56	-
301381	赛维时代	2023-07-05	6 个月	新发流通受限	20.45	29.69	571	11,676.95	16,952.99	-
301172	君逸数码	2023-07-19	6 个月	新发流通受限	31.33	38.16	438	13,722.54	16,714.08	-
301362	民爆光电	2023-07-27	6 个月	新发流通受限	51.05	38.52	420	21,441.00	16,178.40	-
688612	威迈斯	2023-07-19	6 个月	新发流通受限	47.29	37.97	422	19,956.38	16,023.34	-
601096	宏盛华源	2023-12-15	6 个月	新发流通受限	1.70	4.06	3,918	6,660.60	15,907.08	-
301393	昊帆生物	2023-07-05	6 个月	新发流通受限	67.68	59.37	260	17,596.80	15,436.20	-
688610	埃科光电	2023-07-10	6 个月	新发流	73.33	51.00	275	20,165.75	14,025.00	-

				通 受 限						
601083	锦江 航运	2023- 11-28	6 个月	新发 流通 受限	11.25	11.07	1,263	14,208.75	13,981.41	-
301510	固高 科技	2023- 08-04	6 个月	新发 流通 受限	12.00	35.01	396	4,752.00	13,863.96	-
301210	金杨 股份	2023- 06-21	6 个月	新发 流通 受限	57.88	45.48	281	16,264.28	12,779.88	-
301566	达利 凯普	2023- 12-22	6 个月	新发 流通 受限	8.90	22.14	576	5,126.40	12,752.64	-
301456	盘古 智能	2023- 07-06	6 个月	新发 流通 受限	37.96	30.39	407	15,449.72	12,368.73	-
688602	康鹏 科技	2023- 07-13	6 个月	新发 流通 受限	8.66	11.06	1,066	9,231.56	11,789.96	-
688719	爱科 赛博	2023- 09-20	6 个月	新发 流通 受限	69.98	60.10	194	13,576.12	11,659.40	-

301550	斯菱股份	2023-09-06	6 个月	新发流通受限	37.56	43.57	260	9,765.60	11,328.20	-
301292	海科新源	2023-06-29	6 个月	新发流通受限	19.99	19.35	583	11,654.17	11,281.05	-
301508	中机认检	2023-11-23	6 个月	新发流通受限	16.82	26.68	419	7,047.58	11,178.92	-
688603	天承科技	2023-06-30	6 个月	新发流通受限	55.00	74.14	140	7,700.00	10,379.60	-
301528	多浦乐	2023-08-17	6 个月	新发流通受限	71.80	68.91	148	10,626.40	10,198.68	-
301329	信音电子	2023-07-05	6 个月	新发流通受限	21.00	22.23	458	9,618.00	10,181.34	-
301372	科净源	2023-08-03	6 个月	新发流通受限	45.00	43.59	231	10,395.00	10,069.29	-
301261	恒工精密	2023-06-29	6 个月	新发流	36.90	50.85	198	7,306.20	10,068.30	-

				通 受 限						
301202	朗威 股份	2023- 06-28	6 个月	新发 流通 受限	25.82	31.80	306	7,900.92	9,730.80	-
301395	仁信 新材	2023- 06-21	6 个月	新发 流通 受限	26.68	18.69	520	13,873.60	9,718.80	-
688716	中研 股份	2023- 09-13	6 个月	新发 流通 受限	29.66	36.39	267	7,919.22	9,716.13	-
301413	安培 龙	2023- 12-11	6 个月	新发 流通 受限	33.25	58.19	164	5,453.00	9,543.16	-
301500	飞南 资源	2023- 09-13	6 个月	新发 流通 受限	23.97	20.89	455	10,906.35	9,504.95	-
301418	协昌 科技	2023- 08-10	6 个月	新发 流通 受限	51.88	50.20	189	9,805.32	9,487.80	-
301516	中远 通	2023- 12-01	6 个月	新发 流通 受限	6.87	15.51	604	4,149.48	9,368.04	-

301272	英华特	2023-07-06	6 个月	新发流通受限	51.39	53.38	173	8,890.47	9,234.74	-
301469	恒达新材	2023-08-10	6 个月	新发流通受限	36.58	33.09	275	10,059.50	9,099.75	-
301519	舜禹股份	2023-07-19	6 个月	新发流通受限	20.93	20.21	442	9,251.06	8,932.82	-
301518	长华化学	2023-07-26	6 个月	新发流通受限	25.75	23.01	385	9,913.75	8,858.85	-
301568	思泰克	2023-11-21	6 个月	新发流通受限	23.23	35.58	246	5,714.58	8,752.68	-
301520	万邦医药	2023-09-18	6 个月	新发流通受限	67.88	52.74	160	10,860.80	8,438.40	-
688638	誉辰智能	2023-07-04	6 个月	新发流通受限	83.90	59.68	141	11,829.90	8,414.88	-
301459	丰茂股份	2023-12-06	6 个月	新发流	31.90	39.84	208	6,635.20	8,286.72	-

				通 受 限						
688720	艾森 股份	2023- 11-29	6 个月	新发 流通 受限	28.03	49.84	165	4,624.95	8,223.60	-
301489	思泉 新材	2023- 10-16	6 个月	新发 流通 受限	41.66	64.11	128	5,332.48	8,206.08	-
688651	盛邦 安全	2023- 07-19	6 个月	新发 流通 受限	39.90	46.05	178	7,102.20	8,196.90	-
301517	陕西 华达	2023- 10-09	6 个月	新发 流通 受限	26.87	43.69	185	4,970.95	8,082.65	-
301578	辰奕 智能	2023- 12-21	6 个月	新发 流通 受限	48.94	68.32	118	5,774.92	8,061.76	-
301548	崇德 科技	2023- 09-11	6 个月	新发 流通 受限	66.80	58.99	136	9,084.80	8,022.64	-
688657	浩辰 软件	2023- 09-25	6 个月	新发 流通 受限	103.40	78.23	101	10,443.40	7,901.23	-

688671	碧兴物联	2023-08-02	6 个月	新发流通受限	36.12	34.30	226	8,163.12	7,751.80	-
688693	锆威特	2023-08-10	6 个月	新发流通受限	40.83	43.41	178	7,267.74	7,726.98	-
603275	众辰科技	2023-08-16	6 个月	新发流通受限	49.97	39.70	193	9,644.21	7,662.10	-
301533	威马农机	2023-08-07	6 个月	新发流通受限	29.50	33.16	225	6,637.50	7,461.00	-
603062	麦加芯彩	2023-10-31	6 个月	新发流通受限	58.08	57.81	126	7,318.08	7,284.06	-
301555	惠柏新材	2023-10-24	6 个月	新发流通受限	22.88	32.44	224	5,125.12	7,266.56	-
301505	苏州规划	2023-07-12	6 个月	新发流通受限	26.35	35.81	194	5,111.90	6,947.14	-
301529	福赛科技	2023-08-31	6 个月	新发流	36.60	37.88	182	6,661.20	6,894.16	-

				通 受 限						
301515	港通 医疗	2023- 07-13	6 个月	新发 流通 受限	31.16	28.27	230	7,166.80	6,502.10	-
688648	中邮 科技	2023- 11-06	6 个月	新发 流通 受限	15.18	21.43	303	4,599.54	6,493.29	-
001378	德冠 新材	2023- 10-23	6 个月	新发 流通 受限	31.68	31.27	205	6,494.40	6,410.35	-
688450	光格 科技	2023- 07-17	6 个月	新发 流通 受限	53.09	36.42	167	8,866.03	6,082.14	-
603004	鼎龙 科技	2023- 12-20	6 个月	新发 流通 受限	16.80	31.19	195	3,276.00	6,082.05	-
603119	浙江 荣泰	2023- 07-21	6 个月	新发 流通 受限	15.32	23.87	226	3,462.32	5,394.62	-
001306	夏厦 精密	2023- 11-09	6 个月	新发 流通 受限	53.63	75.36	64	3,432.32	4,823.04	-

603075	热威股份	2023-09-01	6 个月	新发流通受限	23.10	23.31	182	4,204.20	4,242.42	-
001358	兴欣新材	2023-12-14	6 个月	新发流通受限	41.00	44.16	87	3,567.00	3,841.92	-
001239	永达股份	2023-12-04	6 个月	新发流通受限	12.05	19.92	189	2,277.45	3,764.88	-
603231	索宝蛋白	2023-12-06	6 个月	新发流通受限	21.29	21.53	161	3,427.69	3,466.33	-
603273	天元智能	2023-10-16	6 个月	新发流通受限	9.50	18.97	178	1,691.00	3,376.66	-
603276	恒兴新材	2023-09-18	6 个月	新发流通受限	25.73	24.88	134	3,447.82	3,333.92	-
603373	安邦护卫	2023-12-13	6 个月	新发流通受限	19.10	34.75	88	1,680.80	3,058.00	-
7.4.12.1.2 受限证券类别：债券										

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
113069	博23转债	2023-12-22	1个月内(含)	新发流通受限	100.00	100.01	4,590	459,000.00	459,030.18	期末估值单价为含息价格

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

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688337	普源精电	2023-12-25	重大事项	43.87	2024-01-09	41.72	1,200	51,696.84	52,644.00	

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之内。

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 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 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	1,024,648,781.35	94.17	334,582,219.20	92.97
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	577,887.55	0.05	186,947.28	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	1,025,226,668.90	94.23	334,769,166.48	93.02

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 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	-5%	-43,065,453.93	-12,144,742.18
	+5%	43,065,453.93	12,144,742.18

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 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	1,022,767,099.20	331,592,191.73
第二层次	1,410,416.20	1,716,131.08
第三层次	1,049,153.50	1,460,843.67
合计	1,025,226,668.90	334,769,166.48

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）和非公开发行业务等情况，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 2023 年 1 月 1 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	-	1,460,843.67	1,460,843.67
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	2,277,810.80	2,277,810.80
转出第三层次	-	3,093,337.53	3,093,337.53
当期利得或损失总额	-	403,836.56	403,836.56
其中：计入损益的利得或损失	-	403,836.56	403,836.56
计入其他综合收益的利得或损失（若有）	-	-	-
期末余额	-	1,049,153.50	1,049,153.50
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	-	67,855.65	67,855.65
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 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	-	1,271,927.37	1,271,927.37
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	188,916.30	188,916.30
其中：计入损益的利	-	188,916.30	188,916.30

得或损失			
计入其他综合收益的利得或损失（若有）	-	-	-
期末余额	-	1,460,843.67	1,460,843.67
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	-	188,916.30	188,916.30

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	1,049,153.50	平均价格亚式期权模型	预期年化波动率	0.1462-2.1988	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	1,460,843.67	平均价格亚式期权模型	预期年化波动率	0.1891-2.4756	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 2023 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	1,024,648,781.35	93.09
	其中：股票	1,024,648,781.35	93.09
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	577,887.55	0.05
	其中：债券	577,887.55	0.05
	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	66,680,976.99	6.06
8	其他各项资产	8,750,558.82	0.80
9	合计	1,100,658,204.71	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	51,034,742.39	4.69
C	制造业	667,443,032.27	61.34
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	23,358,178.00	2.15
E	建筑业	13,283,520.10	1.22
F	批发和零售业	13,489,238.39	1.24
G	交通运输、仓储和邮政业	19,586,617.81	1.80
H	住宿和餐饮业	364,780.00	0.03
I	信息传输、软件和信息技术服务业	78,070,356.72	7.18
J	金融业	90,723,585.66	8.34
K	房地产业	10,348,763.06	0.95
L	租赁和商务服务业	13,361,701.00	1.23
M	科学研究和技术服务业	16,135,031.46	1.48
N	水利、环境和公共设施管理业	10,702,618.21	0.98
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	1,151,014.00	0.11
Q	卫生和社会工作	2,400,058.00	0.22
R	文化、体育和娱乐业	12,977,488.28	1.19
S	综合	218,056.00	0.02
	合计	1,024,648,781.35	94.17

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	600161	天坛生物	234,890	7,267,496.60	0.67
2	600867	通化东宝	589,700	6,386,451.00	0.59
3	000338	潍柴动力	458,900	6,263,985.00	0.58
4	601601	中国太保	257,400	6,120,972.00	0.56
5	601211	国泰君安	403,951	6,010,790.88	0.55
6	000423	东阿阿胶	105,900	5,222,988.00	0.48
7	000932	华菱钢铁	999,200	5,145,880.00	0.47
8	600535	天士力	297,800	5,068,556.00	0.47
9	601318	中国平安	125,200	5,045,560.00	0.46
10	002128	电投能源	348,100	4,967,387.00	0.46
11	603328	依顿电子	595,200	4,850,880.00	0.45
12	601857	中国石油	670,100	4,730,906.00	0.43
13	603056	德邦股份	309,500	4,478,465.00	0.41
14	601688	华泰证券	317,900	4,434,705.00	0.41
15	000050	深天马 A	416,100	4,431,465.00	0.41
16	600038	中直股份	111,301	4,288,427.53	0.39
17	600390	五矿资本	911,700	4,266,756.00	0.39
18	300308	中际旭创	37,700	4,256,707.00	0.39
19	600201	生物股份	392,400	4,226,148.00	0.39
20	000729	燕京啤酒	485,851	4,192,894.13	0.39
21	000902	新洋丰	367,800	4,189,242.00	0.39
22	601398	工商银行	861,600	4,118,448.00	0.38
23	603993	洛阳钼业	785,000	4,082,000.00	0.38
24	000737	北方铜业	702,300	4,073,340.00	0.37
25	601628	中国人寿	141,000	3,997,350.00	0.37
26	603233	大参林	160,500	3,996,450.00	0.37
27	600312	平高电气	314,500	3,991,005.00	0.37
28	600643	爱建集团	781,630	3,986,313.00	0.37
29	000598	兴蓉环境	682,600	3,883,994.00	0.36
30	603228	景旺电子	170,300	3,841,968.00	0.35
31	300750	宁德时代	23,500	3,836,610.00	0.35
32	002635	安洁科技	228,200	3,726,506.00	0.34
33	603236	移远通信	69,281	3,723,853.75	0.34
34	600901	江苏金租	762,600	3,690,984.00	0.34
35	300383	光环新网	372,300	3,618,756.00	0.33
36	300768	迪普科技	242,300	3,581,194.00	0.33
37	003012	东鹏控股	426,100	3,515,325.00	0.32
38	601108	财通证券	450,900	3,498,984.00	0.32
39	601231	环旭电子	226,200	3,417,882.00	0.31
40	601888	中国中免	39,300	3,289,017.00	0.30
41	002027	分众传媒	519,300	3,281,976.00	0.30
42	300662	科锐国际	117,900	3,256,398.00	0.30

43	000725	京东方 A	833,700	3,251,430.00	0.30
44	002594	比亚迪	16,400	3,247,200.00	0.30
45	688183	生益电子	285,400	3,244,998.00	0.30
46	601138	工业富联	214,200	3,238,704.00	0.30
47	000858	五粮液	23,000	3,227,130.00	0.30
48	000990	诚志股份	392,900	3,225,709.00	0.30
49	600941	中国移动	32,100	3,193,308.00	0.29
50	600028	中国石化	572,000	3,191,760.00	0.29
51	002109	兴化股份	673,100	3,190,494.00	0.29
52	603259	药明康德	43,800	3,186,888.00	0.29
53	002608	江苏国信	484,100	3,180,537.00	0.29
54	002811	郑中设计	322,000	3,171,700.00	0.29
55	002415	海康威视	91,000	3,159,520.00	0.29
56	601288	农业银行	864,100	3,145,324.00	0.29
57	002100	天康生物	356,600	3,127,382.00	0.29
58	601319	中国人保	645,400	3,123,736.00	0.29
59	301219	腾远钴业	77,908	3,067,237.96	0.28
60	300638	广和通	160,560	3,055,456.80	0.28
61	002111	威海广泰	336,600	3,049,596.00	0.28
62	688772	珠海冠宇	136,600	3,006,566.00	0.28
63	002249	大洋电机	602,495	2,994,400.15	0.28
64	002739	万达电影	229,664	2,990,225.28	0.27
65	601808	中海油服	202,600	2,962,012.00	0.27
66	002641	公元股份	587,100	2,953,113.00	0.27
67	601699	潞安环能	134,500	2,946,895.00	0.27
68	600519	贵州茅台	1,700	2,934,200.00	0.27
69	601336	新华保险	94,200	2,932,446.00	0.27
70	000612	焦作万方	495,700	2,850,275.00	0.26
71	603113	金能科技	341,600	2,756,712.00	0.25
72	002138	顺络电子	101,500	2,741,515.00	0.25
73	603208	江山欧派	92,137	2,735,547.53	0.25
74	001203	大中矿业	266,000	2,705,220.00	0.25
75	601989	中国重工	647,100	2,672,523.00	0.25
76	600016	民生银行	714,100	2,670,734.00	0.25
77	000625	长安汽车	158,500	2,667,555.00	0.25
78	300433	蓝思科技	201,800	2,663,760.00	0.24
79	002283	天润工业	454,300	2,657,655.00	0.24
80	000333	美的集团	48,600	2,655,018.00	0.24
81	000975	银泰黄金	176,000	2,640,000.00	0.24
82	600346	恒力石化	198,600	2,615,562.00	0.24
83	300866	安克创新	29,300	2,595,980.00	0.24
84	601985	中国核电	343,700	2,577,750.00	0.24
85	300887	谱尼测试	210,400	2,484,824.00	0.23
86	002984	森麒麟	85,700	2,472,445.00	0.23

87	300741	华宝股份	115,000	2,462,150.00	0.23
88	002763	汇洁股份	291,400	2,450,674.00	0.23
89	600873	梅花生物	255,800	2,442,890.00	0.22
90	301283	聚胶股份	72,300	2,377,224.00	0.22
91	000933	神火股份	140,800	2,365,440.00	0.22
92	600828	茂业商业	647,400	2,363,010.00	0.22
93	600110	诺德股份	416,900	2,351,316.00	0.22
94	002285	世联行	967,700	2,332,157.00	0.21
95	603063	禾望电气	92,900	2,322,500.00	0.21
96	600500	中化国际	521,100	2,303,262.00	0.21
97	002399	海普瑞	194,200	2,277,966.00	0.21
98	002545	东方铁塔	318,100	2,274,415.00	0.21
99	600699	均胜电子	125,500	2,253,980.00	0.21
100	601766	中国中车	423,900	2,229,714.00	0.20
101	002078	太阳纸业	183,100	2,228,327.00	0.20
102	300981	中红医疗	138,700	2,221,974.00	0.20
103	603680	今创集团	234,800	2,218,860.00	0.20
104	002373	千方科技	197,700	2,216,217.00	0.20
105	002429	兆驰股份	392,600	2,190,708.00	0.20
106	600862	中航高科	98,800	2,188,420.00	0.20
107	600007	中国国贸	111,587	2,162,556.06	0.20
108	000425	徐工机械	395,900	2,161,614.00	0.20
109	002252	上海莱士	268,100	2,144,800.00	0.20
110	601018	宁波港	596,400	2,123,184.00	0.20
111	300088	长信科技	316,100	2,114,709.00	0.19
112	300253	卫宁健康	294,100	2,114,579.00	0.19
113	601328	交通银行	366,300	2,102,562.00	0.19
114	002774	快意电梯	251,800	2,089,940.00	0.19
115	300748	金力永磁	103,300	2,088,726.00	0.19
116	002214	大立科技	182,000	2,087,540.00	0.19
117	601728	中国电信	385,800	2,087,178.00	0.19
118	002923	润都股份	168,380	2,077,809.20	0.19
119	000513	丽珠集团	59,200	2,072,592.00	0.19
120	600025	华能水电	238,700	2,059,981.00	0.19
121	600612	老凤祥	29,800	2,056,200.00	0.19
122	002152	广电运通	166,500	2,041,290.00	0.19
123	300369	绿盟科技	215,300	2,030,279.00	0.19
124	002247	聚力文化	863,900	2,021,526.00	0.19
125	600497	驰宏锌锗	399,600	2,017,980.00	0.19
126	601137	博威合金	128,800	2,000,264.00	0.18
127	002595	豪迈科技	67,100	1,997,567.00	0.18
128	002266	浙富控股	587,303	1,996,830.20	0.18
129	300286	安科瑞	76,900	1,994,017.00	0.18
130	300296	利亚德	331,900	1,991,400.00	0.18

131	300027	华谊兄弟	742,100	1,988,828.00	0.18
132	600261	阳光照明	606,800	1,984,236.00	0.18
133	000728	国元证券	287,900	1,966,357.00	0.18
134	000923	河钢资源	116,600	1,958,880.00	0.18
135	300812	易天股份	46,900	1,950,571.00	0.18
136	600737	中粮糖业	236,700	1,950,408.00	0.18
137	000157	中联重科	295,300	1,928,309.00	0.18
138	000568	泸州老窖	10,600	1,901,852.00	0.17
139	600959	江苏有线	604,000	1,896,560.00	0.17
140	600808	马钢股份	693,700	1,886,864.00	0.17
141	300166	东方国信	200,000	1,880,000.00	0.17
142	002032	苏泊尔	35,300	1,871,253.00	0.17
143	000039	中集集团	244,460	1,870,119.00	0.17
144	002925	盈趣科技	95,700	1,863,279.00	0.17
145	301162	国能日新	35,900	1,862,492.00	0.17
146	600029	南方航空	321,900	1,854,144.00	0.17
147	601006	大秦铁路	256,400	1,848,644.00	0.17
148	603669	灵康药业	332,800	1,840,384.00	0.17
149	600977	中国电影	150,200	1,838,448.00	0.17
150	601939	建设银行	281,600	1,833,216.00	0.17
151	000426	兴业银锡	198,600	1,803,288.00	0.17
152	601225	陕西煤业	85,851	1,793,427.39	0.16
153	603758	秦安股份	156,500	1,790,360.00	0.16
154	300861	美畅股份	53,600	1,784,344.00	0.16
155	002745	木林森	206,000	1,783,960.00	0.16
156	300888	稳健医疗	47,600	1,773,100.00	0.16
157	603093	南华期货	147,500	1,770,000.00	0.16
158	600900	长江电力	75,700	1,766,838.00	0.16
159	601088	中国神华	56,300	1,765,005.00	0.16
160	001227	兰州银行	675,800	1,757,080.00	0.16
161	600066	宇通客车	132,600	1,756,950.00	0.16
162	601169	北京银行	385,700	1,747,221.00	0.16
163	300069	金利华电	108,200	1,742,020.00	0.16
164	002948	青岛银行	565,100	1,723,555.00	0.16
165	603061	金海通	18,100	1,719,138.00	0.16
166	688981	中芯国际	32,315	1,713,341.30	0.16
167	600637	东方明珠	227,500	1,710,800.00	0.16
168	002851	麦格米特	69,500	1,709,700.00	0.16
169	600967	内蒙一机	206,900	1,708,994.00	0.16
170	603027	千禾味业	105,600	1,707,552.00	0.16
171	601898	中煤能源	176,100	1,706,409.00	0.16
172	300001	特锐德	84,800	1,704,480.00	0.16
173	688622	禾信仪器	47,400	1,704,030.00	0.16
174	000063	中兴通讯	64,200	1,700,016.00	0.16

175	000100	TCL 科技	391,800	1,684,740.00	0.15
176	688308	欧科亿	59,800	1,668,420.00	0.15
177	688244	永信至诚	29,900	1,668,121.00	0.15
178	002879	长缆科技	103,700	1,661,274.00	0.15
179	300596	利安隆	56,200	1,661,272.00	0.15
180	000559	万向钱潮	320,000	1,660,800.00	0.15
181	688138	清溢光电	73,400	1,660,308.00	0.15
182	688055	龙腾光电	339,951	1,658,960.88	0.15
183	300215	电科院	313,300	1,657,357.00	0.15
184	002318	久立特材	83,300	1,656,004.00	0.15
185	300775	三角防务	59,300	1,654,470.00	0.15
186	300411	金盾股份	236,600	1,653,834.00	0.15
187	688661	和林微纳	36,021	1,650,482.22	0.15
188	300155	安居宝	278,700	1,649,904.00	0.15
189	300412	迦南科技	289,900	1,649,531.00	0.15
190	300893	松原股份	56,400	1,648,572.00	0.15
191	600696	岩石股份	91,600	1,647,884.00	0.15
192	002718	友邦吊顶	96,600	1,643,166.00	0.15
193	688325	赛微微电	41,900	1,642,061.00	0.15
194	601918	新集能源	310,400	1,635,808.00	0.15
195	300529	健帆生物	73,500	1,633,905.00	0.15
196	600938	中国海油	77,700	1,629,369.00	0.15
197	688109	品茗科技	57,675	1,624,704.75	0.15
198	002563	森马服饰	281,500	1,624,255.00	0.15
199	603659	璞泰来	77,500	1,622,075.00	0.15
200	600383	金地集团	371,400	1,619,304.00	0.15
201	600989	宝丰能源	109,600	1,618,792.00	0.15
202	688163	赛伦生物	80,900	1,617,191.00	0.15
203	002271	东方雨虹	84,100	1,614,720.00	0.15
204	688626	翔宇医疗	30,300	1,614,687.00	0.15
205	603277	银都股份	60,200	1,614,564.00	0.15
206	603321	梅轮电梯	189,000	1,614,060.00	0.15
207	300724	捷佳伟创	21,800	1,613,418.00	0.15
208	300712	永福股份	60,100	1,610,680.00	0.15
209	600182	S 佳通	108,670	1,610,489.40	0.15
210	605166	聚合顺	162,300	1,610,016.00	0.15
211	300009	安科生物	157,500	1,609,650.00	0.15
212	002900	哈三联	117,800	1,607,970.00	0.15
213	300068	南都电源	124,200	1,607,148.00	0.15
214	600746	江苏索普	219,400	1,606,008.00	0.15
215	601899	紫金矿业	128,800	1,604,848.00	0.15
216	300332	天壕能源	201,700	1,603,515.00	0.15
217	000630	铜陵有色	486,500	1,595,720.00	0.15
218	688516	奥特维	17,600	1,592,800.00	0.15

219	301333	诺思格	24,700	1,592,656.00	0.15
220	688511	天微电子	50,600	1,592,382.00	0.15
221	603823	百合花	161,800	1,592,112.00	0.15
222	300787	海能实业	94,600	1,591,172.00	0.15
223	603283	赛腾股份	21,900	1,589,064.00	0.15
224	300490	华自科技	136,800	1,588,248.00	0.15
225	300289	利德曼	258,000	1,586,700.00	0.15
226	300772	运达股份	149,100	1,586,424.00	0.15
227	600837	海通证券	169,300	1,586,341.00	0.15
228	600816	建元信托	551,900	1,583,953.00	0.15
229	600488	津药药业	323,200	1,583,680.00	0.15
230	300030	阳普医疗	204,100	1,581,775.00	0.15
231	300443	金雷股份	57,319	1,581,431.21	0.15
232	301257	普蕊斯	24,900	1,581,150.00	0.15
233	003816	中国广核	508,400	1,581,124.00	0.15
234	002551	尚荣医疗	388,900	1,578,934.00	0.15
235	600885	宏发股份	57,000	1,575,480.00	0.14
236	600971	恒源煤电	141,200	1,574,380.00	0.14
237	300800	力合科技	115,100	1,573,417.00	0.14
238	688235	百济神州	11,300	1,571,152.00	0.14
239	605158	华达新材	206,600	1,570,160.00	0.14
240	600111	北方稀土	81,100	1,568,474.00	0.14
241	301226	祥明智能	68,700	1,568,421.00	0.14
242	300697	电工合金	121,300	1,567,196.00	0.14
243	300681	英搏尔	81,300	1,566,651.00	0.14
244	688057	金达莱	110,600	1,566,096.00	0.14
245	300680	隆盛科技	83,600	1,563,320.00	0.14
246	000997	新大陆	79,700	1,562,917.00	0.14
247	300041	回天新材	155,900	1,562,118.00	0.14
248	300599	雄塑科技	194,700	1,561,494.00	0.14
249	300035	中科电气	148,100	1,560,974.00	0.14
250	000065	北方国际	138,800	1,557,336.00	0.14
251	600795	国电电力	374,200	1,556,672.00	0.14
252	300440	运达科技	208,800	1,555,560.00	0.14
253	301163	宏德股份	57,400	1,555,540.00	0.14
254	301429	森泰股份	76,100	1,555,484.00	0.14
255	688093	世华科技	85,400	1,555,134.00	0.14
256	000953	河化股份	284,300	1,555,121.00	0.14
257	300894	火星人	95,700	1,554,168.00	0.14
258	603087	甘李药业	29,514	1,553,912.10	0.14
259	301120	新特电气	133,900	1,551,901.00	0.14
260	300881	盛德鑫泰	60,600	1,550,148.00	0.14
261	301323	新莱福	41,900	1,549,881.00	0.14
262	301129	瑞纳智能	58,200	1,549,866.00	0.14

263	688578	艾力斯	37,200	1,549,752.00	0.14
264	300773	拉卡拉	96,600	1,549,464.00	0.14
265	300358	楚天科技	144,800	1,549,360.00	0.14
266	002215	诺普信	187,500	1,548,750.00	0.14
267	601988	中国银行	387,900	1,547,721.00	0.14
268	300355	蒙草生态	412,000	1,545,000.00	0.14
269	301122	采纳股份	45,600	1,544,016.00	0.14
270	000627	天茂集团	542,400	1,540,416.00	0.14
271	603551	奥普家居	145,400	1,539,786.00	0.14
272	300725	药石科技	39,200	1,539,384.00	0.14
273	300223	北京君正	23,800	1,538,670.00	0.14
274	301246	宏源药业	59,200	1,538,016.00	0.14
275	300196	长海股份	141,300	1,537,344.00	0.14
276	301117	佳缘科技	28,200	1,537,182.00	0.14
277	600019	宝钢股份	259,100	1,536,463.00	0.14
278	600231	凌钢股份	714,500	1,536,175.00	0.14
279	301399	英特科技	40,139	1,536,119.53	0.14
280	301305	朗坤环境	85,058	1,535,296.90	0.14
281	300315	掌趣科技	298,000	1,534,700.00	0.14
282	300575	中旗股份	200,800	1,534,112.00	0.14
283	300352	北信源	322,900	1,533,775.00	0.14
284	300168	万达信息	180,800	1,533,184.00	0.14
285	600284	浦东建设	243,200	1,532,160.00	0.14
286	300824	北鼎股份	169,600	1,531,488.00	0.14
287	300005	探路者	231,300	1,531,206.00	0.14
288	300634	彩讯股份	74,800	1,531,156.00	0.14
289	301212	联盛化学	56,700	1,530,900.00	0.14
290	300993	玉马遮阳	139,200	1,528,416.00	0.14
291	300613	富瀚微	36,000	1,527,840.00	0.14
292	002555	三七互娱	81,200	1,527,372.00	0.14
293	001225	和泰机电	38,900	1,526,047.00	0.14
294	001270	铖昌科技	24,300	1,523,853.00	0.14
295	002412	汉森制药	223,900	1,518,042.00	0.14
296	301207	华兰疫苗	54,600	1,517,880.00	0.14
297	300692	中环环保	244,800	1,517,760.00	0.14
298	600548	深高速	168,800	1,517,512.00	0.14
299	601216	君正集团	405,400	1,516,196.00	0.14
300	002803	吉宏股份	73,500	1,511,160.00	0.14
301	603833	欧派家居	21,700	1,510,537.00	0.14
302	605169	洪通燃气	133,300	1,510,289.00	0.14
303	688466	金科环境	85,000	1,508,750.00	0.14
304	300636	同和药业	143,000	1,507,220.00	0.14
305	300687	赛意信息	69,192	1,507,001.76	0.14
306	300997	欢乐家	107,800	1,505,966.00	0.14

307	600986	浙文互联	275,400	1,503,684.00	0.14
308	301335	天元宠物	70,200	1,502,280.00	0.14
309	601811	新华文轩	109,800	1,499,868.00	0.14
310	301058	中粮科工	137,200	1,499,596.00	0.14
311	300451	创业慧康	227,800	1,492,090.00	0.14
312	688185	康希诺	20,000	1,490,400.00	0.14
313	603508	思维列控	94,740	1,487,418.00	0.14
314	002463	沪电股份	66,700	1,475,404.00	0.14
315	603737	三棵树	30,920	1,472,101.20	0.14
316	300900	广联航空	59,600	1,470,928.00	0.14
317	300059	东方财富	104,700	1,469,988.00	0.14
318	688616	西力科技	107,400	1,464,936.00	0.13
319	300928	华安鑫创	29,000	1,462,760.00	0.13
320	600688	上海石化	511,000	1,461,460.00	0.13
321	688047	龙芯中科	13,200	1,460,052.00	0.13
322	000553	安道麦 A	210,100	1,458,094.00	0.13
323	603900	莱绅通灵	218,100	1,456,908.00	0.13
324	000069	华侨城 A	468,300	1,456,413.00	0.13
325	600380	健康元	116,100	1,443,123.00	0.13
326	605577	龙版传媒	61,400	1,432,462.00	0.13
327	688020	方邦股份	29,500	1,430,160.00	0.13
328	300795	米奥会展	38,700	1,426,869.00	0.13
329	300017	网宿科技	181,700	1,426,345.00	0.13
330	300641	正丹股份	252,800	1,425,792.00	0.13
331	300871	回盛生物	98,600	1,425,756.00	0.13
332	603920	世运电路	77,900	1,424,012.00	0.13
333	300386	飞天诚信	132,500	1,421,725.00	0.13
334	688231	隆达股份	64,400	1,417,444.00	0.13
335	603980	吉华集团	302,640	1,413,328.80	0.13
336	600562	国睿科技	101,700	1,407,528.00	0.13
337	688768	容知日新	38,200	1,406,142.00	0.13
338	300323	华灿光电	189,700	1,388,604.00	0.13
339	000951	中国重汽	103,600	1,384,096.00	0.13
340	601816	京沪高铁	280,800	1,381,536.00	0.13
341	002572	索菲亚	86,400	1,378,080.00	0.13
342	000651	格力电器	42,200	1,357,574.00	0.12
343	002472	双环传动	51,800	1,347,836.00	0.12
344	603225	新凤鸣	93,900	1,333,380.00	0.12
345	300254	仟源医药	135,900	1,308,717.00	0.12
346	000060	中金岭南	302,600	1,307,232.00	0.12
347	000596	古井贡酒	5,600	1,303,680.00	0.12
348	002891	中宠股份	49,400	1,301,690.00	0.12
349	600997	开滦股份	170,400	1,300,152.00	0.12
350	600660	福耀玻璃	34,700	1,297,433.00	0.12

351	601198	东兴证券	155,900	1,283,057.00	0.12
352	601059	信达证券	71,300	1,282,687.00	0.12
353	600126	杭钢股份	239,500	1,276,535.00	0.12
354	603298	杭叉集团	51,300	1,276,344.00	0.12
355	301046	能辉科技	46,800	1,269,216.00	0.12
356	600398	海澜之家	168,500	1,250,270.00	0.11
357	002142	宁波银行	62,000	1,246,820.00	0.11
358	300719	安达维尔	92,700	1,235,691.00	0.11
359	002736	国信证券	144,100	1,230,614.00	0.11
360	301252	同星科技	29,803	1,229,075.72	0.11
361	601567	三星医疗	59,500	1,219,750.00	0.11
362	300745	欣锐科技	44,700	1,214,499.00	0.11
363	601608	中信重工	314,400	1,213,584.00	0.11
364	600276	恒瑞医药	26,800	1,212,164.00	0.11
365	002436	兴森科技	82,100	1,209,333.00	0.11
366	300150	世纪瑞尔	248,300	1,204,255.00	0.11
367	688311	盟升电子	23,600	1,203,836.00	0.11
368	002578	闽发铝业	268,700	1,203,776.00	0.11
369	688216	气派科技	43,500	1,203,645.00	0.11
370	000030	富奥股份	225,400	1,203,636.00	0.11
371	301102	兆讯传媒	62,700	1,200,078.00	0.11
372	002582	好想你	156,200	1,198,054.00	0.11
373	301087	可孚医疗	31,400	1,190,060.00	0.11
374	601658	邮储银行	273,000	1,187,550.00	0.11
375	000930	中粮科技	177,800	1,180,592.00	0.11
376	600050	中国联通	268,800	1,177,344.00	0.11
377	600377	宁沪高速	114,600	1,174,650.00	0.11
378	300802	矩子科技	61,200	1,170,144.00	0.11
379	002114	罗平锌电	155,900	1,166,132.00	0.11
380	603590	康辰药业	30,600	1,165,248.00	0.11
381	600236	桂冠电力	209,700	1,161,738.00	0.11
382	600600	青岛啤酒	15,530	1,160,867.50	0.11
383	601607	上海医药	69,300	1,159,389.00	0.11
384	600388	龙净环保	90,400	1,156,216.00	0.11
385	603515	欧普照明	66,520	1,156,117.60	0.11
386	002295	精艺股份	141,500	1,156,055.00	0.11
387	002636	金安国纪	129,400	1,152,954.00	0.11
388	301193	家联科技	67,900	1,152,942.00	0.11
389	603377	东方时尚	273,400	1,151,014.00	0.11
390	600403	大有能源	301,700	1,146,460.00	0.11
391	002007	华兰生物	51,300	1,135,269.00	0.10
392	600279	重庆港	254,200	1,131,190.00	0.10
393	603992	松霖科技	62,100	1,126,494.00	0.10
394	000020	深华发 A	85,800	1,111,110.00	0.10

395	688788	科思科技	28,700	1,110,116.00	0.10
396	603511	爱慕股份	71,600	1,108,368.00	0.10
397	002296	辉煌科技	134,100	1,106,325.00	0.10
398	688169	石头科技	3,897	1,102,656.15	0.10
399	002475	立讯精密	32,000	1,102,400.00	0.10
400	000823	超声电子	112,500	1,076,625.00	0.10
401	002832	比音勒芬	33,900	1,074,630.00	0.10
402	002633	申科股份	91,700	1,071,973.00	0.10
403	300505	川金诺	63,700	1,066,975.00	0.10
404	688670	金迪克	37,200	1,058,712.00	0.10
405	002444	巨星科技	46,500	1,047,180.00	0.10
406	600160	巨化股份	63,400	1,045,466.00	0.10
407	301033	迈普医学	24,000	1,044,960.00	0.10
408	002153	石基信息	107,130	1,043,446.20	0.10
409	300625	三雄极光	70,400	1,043,328.00	0.10
410	688683	莱尔科技	40,700	1,041,106.00	0.10
411	605288	凯迪股份	22,000	1,036,640.00	0.10
412	002597	金禾实业	47,200	1,034,152.00	0.10
413	000589	贵州轮胎	168,300	1,029,996.00	0.09
414	003041	真爱美家	61,800	1,028,970.00	0.09
415	300931	通用电梯	121,800	1,027,992.00	0.09
416	688625	呈和科技	26,000	1,019,720.00	0.09
417	300318	博晖创新	163,100	1,017,744.00	0.09
418	688499	利元亨	26,700	1,016,736.00	0.09
419	603365	水星家纺	70,600	1,015,228.00	0.09
420	002541	鸿路钢构	46,400	1,008,272.00	0.09
421	603279	景津装备	45,600	1,008,216.00	0.09
422	688232	新点软件	27,500	995,500.00	0.09
423	603421	鼎信通讯	104,900	986,060.00	0.09
424	002410	广联达	57,120	979,036.80	0.09
425	600082	海泰发展	283,000	976,350.00	0.09
426	688100	威胜信息	33,600	971,712.00	0.09
427	601668	中国建筑	201,100	967,291.00	0.09
428	300102	乾照光电	131,300	965,055.00	0.09
429	000959	首钢股份	278,900	964,994.00	0.09
430	300891	惠云钛业	98,400	954,480.00	0.09
431	688018	乐鑫科技	9,200	947,140.00	0.09
432	688239	航宇科技	19,800	945,846.00	0.09
433	603303	得邦照明	73,600	945,760.00	0.09
434	688314	康拓医疗	28,700	944,517.00	0.09
435	688707	振华新材	45,900	940,950.00	0.09
436	002498	汉缆股份	235,200	940,800.00	0.09
437	002365	永安药业	96,000	938,880.00	0.09
438	300595	欧普康视	41,500	937,070.00	0.09

439	688669	聚石化学	50,000	937,000.00	0.09
440	300143	盈康生命	87,700	932,251.00	0.09
441	600761	安徽合力	51,000	928,710.00	0.09
442	601019	山东出版	98,800	926,744.00	0.09
443	600663	陆家嘴	105,600	924,000.00	0.08
444	301380	挖金客	19,200	909,312.00	0.08
445	688717	艾罗能源	16,147	898,742.02	0.08
446	688234	天岳先进	13,600	898,552.00	0.08
447	300015	爱尔眼科	56,600	895,412.00	0.08
448	300705	九典制药	26,900	893,887.00	0.08
449	603766	隆鑫通用	172,800	891,648.00	0.08
450	688036	传音控股	6,400	885,760.00	0.08
451	002277	友阿股份	217,300	875,719.00	0.08
452	688697	纽威数控	46,482	875,256.06	0.08
453	002461	珠江啤酒	110,500	872,950.00	0.08
454	002056	横店东磁	63,800	863,852.00	0.08
455	600037	歌华有线	111,500	861,895.00	0.08
456	688188	柏楚电子	3,400	860,574.00	0.08
457	600369	西南证券	209,400	856,446.00	0.08
458	601101	昊华能源	135,100	853,832.00	0.08
459	000738	航发控制	42,800	851,720.00	0.08
460	002817	黄山胶囊	97,200	851,472.00	0.08
461	000921	海信家电	41,600	848,640.00	0.08
462	688819	天能股份	30,200	843,184.00	0.08
463	002841	视源股份	18,300	837,408.00	0.08
464	600547	山东黄金	36,600	837,042.00	0.08
465	300682	朗新集团	50,900	834,251.00	0.08
466	002568	百润股份	33,700	829,357.00	0.08
467	688127	蓝特光学	35,400	824,466.00	0.08
468	002376	新北洋	107,800	821,436.00	0.08
469	600395	盘江股份	132,200	815,674.00	0.07
470	688575	亚辉龙	35,600	814,172.00	0.07
471	300381	溢多利	109,100	804,067.00	0.07
472	002709	天赐材料	32,000	802,560.00	0.07
473	300543	朗科智能	72,000	786,240.00	0.07
474	002179	中航光电	20,100	783,900.00	0.07
475	600845	宝信软件	16,000	780,800.00	0.07
476	603928	兴业股份	57,500	768,775.00	0.07
477	002394	联发股份	92,500	768,675.00	0.07
478	002003	伟星股份	70,600	766,010.00	0.07
479	603345	安井食品	7,300	763,653.00	0.07
480	000503	国新健康	57,700	760,486.00	0.07
481	300321	同大股份	39,200	758,520.00	0.07
482	002384	东山精密	41,700	758,106.00	0.07

483	300126	锐奇股份	105,700	755,755.00	0.07
484	300476	胜宏科技	40,700	750,915.00	0.07
485	300670	大烨智能	95,100	744,633.00	0.07
486	688569	铁科轨道	26,703	737,269.83	0.07
487	600582	天地科技	134,900	733,856.00	0.07
488	603337	杰克股份	33,900	732,240.00	0.07
489	002649	博彦科技	59,100	725,157.00	0.07
490	600055	万东医疗	42,000	717,360.00	0.07
491	601186	中国铁建	94,000	715,340.00	0.07
492	002402	和而泰	50,000	714,500.00	0.07
493	603160	汇顶科技	10,300	711,730.00	0.07
494	600606	绿地控股	306,700	705,410.00	0.06
495	300618	寒锐钴业	24,743	699,979.47	0.06
496	000807	云铝股份	56,900	695,318.00	0.06
497	600325	华发股份	96,400	695,044.00	0.06
498	605066	天正电气	75,600	694,008.00	0.06
499	000952	广济药业	86,600	691,934.00	0.06
500	000733	振华科技	11,700	688,428.00	0.06
501	600084	中信尼雅	87,100	684,606.00	0.06
502	601952	苏垦农发	66,200	677,888.00	0.06
503	603580	艾艾精工	45,300	674,517.00	0.06
504	688681	科汇股份	43,462	671,487.90	0.06
505	601991	大唐发电	276,900	670,098.00	0.06
506	000166	申万宏源	150,600	668,664.00	0.06
507	601700	风范股份	133,400	668,334.00	0.06
508	600919	江苏银行	99,700	666,993.00	0.06
509	688111	金山办公	2,100	664,020.00	0.06
510	603786	科博达	9,300	663,648.00	0.06
511	002733	雄韬股份	43,600	655,744.00	0.06
512	300860	锋尚文化	12,000	655,560.00	0.06
513	601158	重庆水务	114,300	648,081.00	0.06
514	601390	中国中铁	113,900	646,952.00	0.06
515	688209	英集芯	36,200	646,532.00	0.06
516	600801	华新水泥	51,400	638,902.00	0.06
517	688105	诺唯赞	19,700	630,794.00	0.06
518	688611	杭州柯林	19,200	629,376.00	0.06
519	000560	我爱我家	278,800	627,300.00	0.06
520	603137	恒尚节能	31,700	621,954.00	0.06
521	002131	利欧股份	272,100	620,388.00	0.06
522	301019	宁波色母	25,800	619,974.00	0.06
523	300407	凯发电气	65,500	618,320.00	0.06
524	300769	德方纳米	10,092	615,914.76	0.06
525	300491	通合科技	27,500	612,700.00	0.06
526	688067	爱威科技	25,533	607,940.73	0.06

527	688315	诺禾致源	26,000	606,840.00	0.06
528	601633	长城汽车	23,898	602,707.56	0.06
529	688269	凯立新材	16,200	599,562.00	0.06
530	300698	万马科技	16,400	598,600.00	0.06
531	603258	电魂网络	26,000	597,480.00	0.05
532	000061	农产品	92,300	597,181.00	0.05
533	603611	诺力股份	31,500	596,295.00	0.05
534	603801	志邦家居	35,500	595,335.00	0.05
535	000761	本钢板材	166,700	595,119.00	0.05
536	601866	中远海发	253,800	593,892.00	0.05
537	300695	兆丰股份	11,200	593,152.00	0.05
538	688319	欧林生物	37,400	590,920.00	0.05
539	605303	园林股份	48,400	590,480.00	0.05
540	002840	华统股份	28,400	590,436.00	0.05
541	600702	舍得酒业	6,100	589,870.00	0.05
542	603444	吉比特	2,400	588,288.00	0.05
543	000702	正虹科技	93,700	587,499.00	0.05
544	688045	必易微	13,673	585,614.59	0.05
545	688793	倍轻松	17,200	578,780.00	0.05
546	000655	金岭矿业	80,700	578,619.00	0.05
547	601128	常熟银行	90,000	575,100.00	0.05
548	002753	永东股份	69,700	575,025.00	0.05
549	601066	中信建投	24,300	574,938.00	0.05
550	002517	恺英网络	51,100	570,787.00	0.05
551	002540	亚太科技	86,300	570,443.00	0.05
552	002588	史丹利	89,300	569,734.00	0.05
553	600841	动力新科	96,200	568,542.00	0.05
554	600594	益佰制药	99,900	568,431.00	0.05
555	603192	汇得科技	28,893	567,747.45	0.05
556	300259	新天科技	156,400	567,732.00	0.05
557	688128	中国电研	27,600	566,352.00	0.05
558	601827	三峰环境	74,200	557,242.00	0.05
559	000534	万泽股份	42,500	556,325.00	0.05
560	300458	全志科技	24,500	555,905.00	0.05
561	301176	逸豪新材	33,100	555,087.00	0.05
562	601366	利群股份	101,300	553,098.00	0.05
563	600370	三房巷	227,500	550,550.00	0.05
564	300806	斯迪克	39,000	548,730.00	0.05
565	600935	华塑股份	160,800	541,896.00	0.05
566	300551	古鳌科技	31,100	541,140.00	0.05
567	002991	甘源食品	7,500	535,950.00	0.05
568	603041	美思德	39,700	534,362.00	0.05
569	603530	神马电力	25,600	530,944.00	0.05
570	002557	洽洽食品	15,200	529,264.00	0.05

571	300281	金明精机	87,700	525,323.00	0.05
572	600080	金花股份	70,300	523,735.00	0.05
573	002254	泰和新材	35,000	523,600.00	0.05
574	002859	洁美科技	20,900	521,455.00	0.05
575	688253	英诺特	20,700	517,707.00	0.05
576	300316	晶盛机电	11,700	515,853.00	0.05
577	002788	鹭燕医药	56,600	508,834.00	0.05
578	688617	惠泰医疗	1,309	508,546.50	0.05
579	000543	皖能电力	80,500	503,930.00	0.05
580	002715	登云股份	30,800	499,884.00	0.05
581	600551	时代出版	45,800	498,762.00	0.05
582	688225	亚信安全	27,000	495,180.00	0.05
583	601298	青岛港	78,600	485,748.00	0.04
584	600650	锦江在线	50,500	483,285.00	0.04
585	002884	凌霄泵业	27,800	482,608.00	0.04
586	000617	中油资本	88,700	478,980.00	0.04
587	600183	生益科技	26,100	477,891.00	0.04
588	002650	加加食品	116,500	475,320.00	0.04
589	000766	通化金马	23,800	474,572.00	0.04
590	300626	华瑞股份	43,600	473,060.00	0.04
591	000001	平安银行	50,300	472,317.00	0.04
592	605007	五洲特纸	32,000	470,720.00	0.04
593	600778	友好集团	74,800	467,500.00	0.04
594	600888	新疆众和	64,300	465,532.00	0.04
595	002001	新和成	27,400	464,704.00	0.04
596	601333	广深铁路	178,300	461,797.00	0.04
597	600809	山西汾酒	2,000	461,460.00	0.04
598	001872	招商港口	28,900	461,244.00	0.04
599	300751	迈为股份	3,500	453,285.00	0.04
600	688639	华恒生物	3,600	453,240.00	0.04
601	002372	伟星新材	31,300	452,911.00	0.04
602	601566	九牧王	45,400	452,638.00	0.04
603	603886	元祖股份	24,800	452,104.00	0.04
604	002724	海洋王	55,000	452,100.00	0.04
605	000533	顺钠股份	95,700	448,833.00	0.04
606	002567	唐人神	59,500	446,250.00	0.04
607	603879	永悦科技	69,500	444,105.00	0.04
608	300232	洲明科技	50,200	441,760.00	0.04
609	000567	海德股份	41,506	441,208.78	0.04
610	601098	中南传媒	43,100	438,327.00	0.04
611	300122	智飞生物	7,100	433,881.00	0.04
612	600018	上港集团	88,500	433,650.00	0.04
613	600299	安迪苏	53,500	428,000.00	0.04
614	601616	广电电气	116,700	423,621.00	0.04

615	688132	邦彦技术	19,700	422,171.00	0.04
616	300753	爱朋医疗	24,400	418,948.00	0.04
617	002611	东方精工	83,800	415,648.00	0.04
618	600309	万华化学	5,400	414,828.00	0.04
619	605060	联德股份	22,100	413,270.00	0.04
620	600727	鲁北化工	62,800	413,224.00	0.04
621	301061	匠心家居	8,300	412,925.00	0.04
622	301391	卡莱特	3,600	412,128.00	0.04
623	688393	安必平	16,400	409,508.00	0.04
624	600983	惠而浦	46,000	408,940.00	0.04
625	603989	艾华集团	19,000	408,880.00	0.04
626	300717	华信新材	24,300	407,997.00	0.04
627	002743	富煌钢构	68,200	407,836.00	0.04
628	688585	上纬新材	48,000	406,560.00	0.04
629	603216	梦天家居	30,900	405,408.00	0.04
630	603901	永创智能	34,000	404,600.00	0.04
631	601218	吉鑫科技	101,100	404,400.00	0.04
632	300124	汇川技术	6,400	404,096.00	0.04
633	600851	海欣股份	58,700	403,269.00	0.04
634	688619	罗普特	28,600	402,116.00	0.04
635	002790	瑞尔特	38,500	401,940.00	0.04
636	300573	兴齐眼药	2,200	401,104.00	0.04
637	300509	新美星	55,300	399,819.00	0.04
638	002327	富安娜	44,200	395,590.00	0.04
639	600999	招商证券	29,000	395,560.00	0.04
640	600758	辽宁能源	108,700	393,494.00	0.04
641	688301	奕瑞科技	1,200	390,312.00	0.04
642	300133	华策影视	66,300	389,181.00	0.04
643	300239	东宝生物	62,000	386,260.00	0.04
644	300078	思创医惠	87,000	381,060.00	0.04
645	000928	中钢国际	65,000	378,950.00	0.03
646	688599	天合光能	13,200	376,596.00	0.03
647	002381	双箭股份	48,700	369,146.00	0.03
648	600566	济川药业	11,700	367,731.00	0.03
649	600754	锦江酒店	12,200	364,780.00	0.03
650	605189	富春染织	21,800	353,160.00	0.03
651	603839	安正时尚	42,400	351,920.00	0.03
652	300693	盛弘股份	11,700	349,947.00	0.03
653	002099	海翔药业	47,900	344,401.00	0.03
654	600363	联创光电	10,100	343,400.00	0.03
655	300037	新宙邦	7,240	342,452.00	0.03
656	300115	长盈精密	25,800	341,850.00	0.03
657	000601	韶能股份	79,300	339,404.00	0.03
658	688120	华海清科	1,800	337,860.00	0.03

659	301239	普瑞眼科	3,900	335,400.00	0.03
660	688030	山石网科	16,600	332,332.00	0.03
661	300464	星徽股份	55,100	331,702.00	0.03
662	688389	普门科技	14,600	328,646.00	0.03
663	002035	华帝股份	52,900	328,509.00	0.03
664	300843	胜蓝股份	14,200	326,316.00	0.03
665	003006	百亚股份	21,500	325,940.00	0.03
666	603927	中科软	10,800	323,784.00	0.03
667	300831	派瑞股份	26,400	323,664.00	0.03
668	300932	三友联众	19,700	320,716.00	0.03
669	688005	容百科技	8,052	320,469.60	0.03
670	002126	银轮股份	17,000	317,390.00	0.03
671	300130	新国都	13,100	317,020.00	0.03
672	688187	时代电气	8,600	312,438.00	0.03
673	600085	同仁堂	5,800	311,460.00	0.03
674	688016	心脉医疗	1,600	311,408.00	0.03
675	603730	岱美股份	21,300	308,637.00	0.03
676	300043	星辉娱乐	83,000	307,930.00	0.03
677	688136	科兴制药	15,200	307,800.00	0.03
678	002558	巨人网络	27,600	307,464.00	0.03
679	603333	尚纬股份	53,100	303,201.00	0.03
680	688007	光峰科技	11,400	295,032.00	0.03
681	688410	山外山	10,000	292,000.00	0.03
682	003021	兆威机电	3,100	291,369.00	0.03
683	300623	捷捷微电	18,300	290,421.00	0.03
684	002312	川发龙麟	40,400	288,860.00	0.03
685	600717	天津港	69,900	287,289.00	0.03
686	002624	完美世界	23,900	282,976.00	0.03
687	002920	德赛西威	2,100	271,971.00	0.02
688	000430	张家界	41,000	266,910.00	0.02
689	002158	汉钟精机	11,800	262,668.00	0.02
690	301181	标榜股份	9,100	256,893.00	0.02
691	603558	健盛集团	26,200	253,878.00	0.02
692	301308	江波龙	2,700	248,535.00	0.02
693	002182	宝武镁业	12,400	243,784.00	0.02
694	000960	锡业股份	16,900	242,008.00	0.02
695	600763	通策医疗	3,100	236,995.00	0.02
696	688153	唯捷创芯	3,600	235,800.00	0.02
697	000935	四川双马	12,800	229,376.00	0.02
698	000639	西王食品	51,800	228,956.00	0.02
699	600489	中金黄金	22,900	228,084.00	0.02
700	600420	国药现代	23,200	227,128.00	0.02
701	002730	电光科技	23,800	225,624.00	0.02
702	601600	中国铝业	39,500	222,780.00	0.02

703	000538	云南白药	4,500	221,175.00	0.02
704	000031	大悦城	73,300	217,701.00	0.02
705	300820	英杰电气	3,800	217,664.00	0.02
706	002105	信隆健康	33,300	215,784.00	0.02
707	688680	海优新材	3,200	210,080.00	0.02
708	300762	上海瀚讯	13,900	209,612.00	0.02
709	600985	淮北矿业	12,600	209,538.00	0.02
710	688633	星球石墨	6,700	209,241.00	0.02
711	688443	智翔金泰	5,200	207,740.00	0.02
712	300428	立中集团	9,800	206,976.00	0.02
713	603300	华铁应急	32,300	206,720.00	0.02
714	002204	大连重工	44,400	202,908.00	0.02
715	688062	迈威生物	6,200	202,678.00	0.02
716	688261	东微半导	2,400	200,616.00	0.02
717	600605	汇通能源	7,200	199,944.00	0.02
718	603369	今世缘	4,100	199,875.00	0.02
719	300532	今天国际	12,100	198,682.00	0.02
720	301319	唯特偶	3,400	198,594.00	0.02
721	301322	绿通科技	4,800	197,568.00	0.02
722	605258	协和电子	7,100	197,167.00	0.02
723	002532	天山铝业	32,700	196,527.00	0.02
724	605598	上海港湾	7,300	195,348.00	0.02
725	601618	中国中冶	63,800	195,228.00	0.02
726	300586	美联新材	24,100	194,969.00	0.02
727	300083	创世纪	30,700	194,331.00	0.02
728	600926	杭州银行	19,400	194,194.00	0.02
729	600549	厦门钨业	11,300	194,134.00	0.02
730	300415	伊之密	11,000	193,930.00	0.02
731	300395	菲利华	5,300	193,768.00	0.02
732	601838	成都银行	17,200	193,672.00	0.02
733	300121	阳谷华泰	21,800	193,584.00	0.02
734	600674	川投能源	12,800	193,536.00	0.02
735	600338	西藏珠峰	15,900	193,344.00	0.02
736	688519	南亚新材	7,500	193,200.00	0.02
737	300371	汇中股份	15,800	192,602.00	0.02
738	301157	华塑科技	4,500	192,600.00	0.02
739	000686	东北证券	27,100	192,410.00	0.02
740	601111	中国国航	26,200	192,308.00	0.02
741	300432	富临精工	18,300	192,150.00	0.02
742	300920	润阳科技	9,100	191,555.00	0.02
743	002437	誉衡药业	76,100	191,011.00	0.02
744	301093	华兰股份	5,900	190,570.00	0.02
745	300034	钢研高纳	9,360	190,476.00	0.02
746	000988	华工科技	6,400	190,464.00	0.02

747	000776	广发证券	13,300	190,057.00	0.02
748	600620	天宸股份	20,200	189,880.00	0.02
749	600061	国投资本	28,100	189,394.00	0.02
750	300937	药易购	6,000	188,700.00	0.02
751	002673	西部证券	29,600	188,552.00	0.02
752	300119	瑞普生物	11,500	188,485.00	0.02
753	300033	同花顺	1,200	188,244.00	0.02
754	301009	可靠股份	17,600	187,616.00	0.02
755	301287	康力源	5,200	187,408.00	0.02
756	688156	路德环境	7,800	187,356.00	0.02
757	002304	洋河股份	1,700	186,830.00	0.02
758	300921	南凌科技	7,600	186,808.00	0.02
759	301227	森鹰窗业	6,900	186,783.00	0.02
760	688212	澳华内镜	3,000	186,090.00	0.02
761	605318	法狮龙	11,500	184,805.00	0.02
762	603828	柯利达	48,255	184,334.10	0.02
763	600782	新钢股份	52,800	184,272.00	0.02
764	301097	天益医疗	3,500	184,205.00	0.02
765	300474	景嘉微	2,600	183,846.00	0.02
766	301159	三维天地	4,000	182,520.00	0.02
767	603790	雅运股份	12,900	180,729.00	0.02
768	301037	保立佳	9,000	179,370.00	0.02
769	300453	三鑫医疗	23,400	178,542.00	0.02
770	603079	圣达生物	12,100	176,297.00	0.02
771	603197	保隆科技	3,100	174,840.00	0.02
772	600618	氯碱化工	19,100	173,810.00	0.02
773	688106	金宏气体	7,200	173,448.00	0.02
774	600039	四川路桥	23,100	173,019.00	0.02
775	688777	中控技术	3,800	172,330.00	0.02
776	600875	东方电气	11,500	168,130.00	0.02
777	600389	江山股份	9,590	166,866.00	0.02
778	301359	东南电子	6,200	164,982.00	0.02
779	688296	和达科技	9,100	163,527.00	0.02
780	002996	顺博合金	14,700	160,524.00	0.01
781	300994	久祺股份	10,900	160,230.00	0.01
782	603501	韦尔股份	1,500	160,065.00	0.01
783	603813	原尚股份	9,900	159,885.00	0.01
784	603096	新经典	8,100	159,408.00	0.01
785	000019	深粮控股	21,100	159,094.00	0.01
786	600406	国电南瑞	7,100	158,472.00	0.01
787	000869	张裕 A	6,500	156,910.00	0.01
788	000404	长虹华意	26,600	156,674.00	0.01
789	600750	江中药业	7,500	156,600.00	0.01
790	688489	三未信安	3,300	155,166.00	0.01

791	300002	神州泰岳	17,500	154,875.00	0.01
792	002237	恒邦股份	14,300	154,154.00	0.01
793	605268	王力安防	15,600	151,944.00	0.01
794	002130	沃尔核材	18,700	141,185.00	0.01
795	002107	沃华医药	22,400	135,968.00	0.01
796	603599	广信股份	9,160	132,820.00	0.01
797	002218	拓日新能	29,000	130,790.00	0.01
798	688161	威高骨科	3,100	128,495.00	0.01
799	603385	惠达卫浴	15,400	123,354.00	0.01
800	600628	新世界	17,500	122,675.00	0.01
801	002910	庄园牧场	10,800	118,152.00	0.01
802	600063	皖维高新	27,400	117,820.00	0.01
803	600331	宏达股份	22,700	116,451.00	0.01
804	300760	迈瑞医疗	400	116,240.00	0.01
805	001202	炬申股份	6,600	115,962.00	0.01
806	600558	大西洋	28,300	115,181.00	0.01
807	002847	盐津铺子	1,650	114,642.00	0.01
808	688737	中自科技	3,400	112,540.00	0.01
809	002320	海峡股份	19,100	111,353.00	0.01
810	600399	抚顺特钢	11,000	106,920.00	0.01
811	601077	渝农商行	26,200	106,896.00	0.01
812	000517	荣安地产	41,900	102,655.00	0.01
813	600343	航天动力	10,300	100,425.00	0.01
814	300876	蒙泰高新	4,000	100,080.00	0.01
815	300953	震裕科技	1,800	99,324.00	0.01
816	301047	义翘神州	1,200	98,880.00	0.01
817	603103	横店影视	5,500	97,790.00	0.01
818	601890	亚星锚链	9,800	97,020.00	0.01
819	002493	荣盛石化	9,300	96,255.00	0.01
820	601665	齐鲁银行	24,100	94,231.00	0.01
821	688186	广大特材	5,200	93,704.00	0.01
822	600729	重庆百货	3,300	93,060.00	0.01
823	601058	赛轮轮胎	7,800	91,650.00	0.01
824	603489	八方股份	1,660	91,217.00	0.01
825	601528	瑞丰银行	18,000	89,100.00	0.01
826	000531	穗恒运 A	13,200	88,308.00	0.01
827	002244	滨江集团	12,100	87,967.00	0.01
828	002430	杭氧股份	3,000	87,630.00	0.01
829	300274	阳光电源	1,000	87,590.00	0.01
830	001965	招商公路	8,900	86,953.00	0.01
831	002928	华夏航空	11,900	84,966.00	0.01
832	688278	特宝生物	1,600	83,760.00	0.01
833	605123	派克新材	900	82,080.00	0.01
834	600990	四创电子	3,990	79,680.30	0.01

835	601966	玲珑轮胎	4,100	78,843.00	0.01
836	300738	奥飞数据	7,400	78,366.00	0.01
837	688390	固德威	600	78,348.00	0.01
838	600741	华域汽车	4,400	71,632.00	0.01
839	605003	众望布艺	3,500	69,090.00	0.01
840	603848	好太太	4,400	68,112.00	0.01
841	300082	奥克股份	9,600	66,912.00	0.01
842	002396	星网锐捷	3,700	66,859.00	0.01
843	600223	福瑞达	6,900	66,447.00	0.01
844	688711	宏微科技	1,600	66,384.00	0.01
845	688168	安博通	1,800	65,088.00	0.01
846	688676	金盘科技	1,800	64,494.00	0.01
847	002939	长城证券	8,000	64,000.00	0.01
848	002188	中天服务	9,600	63,168.00	0.01
849	600391	航发科技	3,300	63,096.00	0.01
850	603299	苏盐井神	7,300	62,196.00	0.01
851	600184	光电股份	5,400	61,722.00	0.01
852	603876	鼎胜新材	4,600	57,638.00	0.01
853	603301	振德医疗	2,300	56,350.00	0.01
854	688337	普源精电	1,200	52,644.00	0.00
855	603132	金徽股份	3,800	51,984.00	0.00
856	688548	广钢气体	4,048	51,612.00	0.00
857	300723	一品红	1,700	50,711.00	0.00
858	002025	航天电器	1,000	48,020.00	0.00
859	688563	航材股份	744	45,004.56	0.00
860	600584	长电科技	1,500	44,790.00	0.00
861	301526	国际复材	9,723	43,267.35	0.00
862	001216	华瓷股份	3,300	43,065.00	0.00
863	002460	赣锋锂业	1,000	42,800.00	0.00
864	002916	深南电路	600	42,594.00	0.00
865	301179	泽宇智能	1,600	41,520.00	0.00
866	601021	春秋航空	807	40,511.40	0.00
867	301031	中熔电气	300	39,228.00	0.00
868	601996	丰林集团	13,200	37,620.00	0.00
869	688287	观典防务	3,800	37,506.00	0.00
870	000895	双汇发展	1,400	37,394.00	0.00
871	603959	百利科技	4,200	37,338.00	0.00
871	300699	光威复材	1,400	37,338.00	0.00
873	000415	渤海租赁	17,400	37,236.00	0.00
874	300642	透景生命	2,100	37,065.00	0.00
875	688008	澜起科技	600	35,256.00	0.00
876	688536	思瑞浦	234	34,234.20	0.00
877	301291	明阳电气	1,206	34,202.16	0.00
878	601801	皖新传媒	4,800	33,360.00	0.00

879	688208	道通科技	1,400	33,250.00	0.00
880	002332	仙琚制药	2,600	33,202.00	0.00
881	603296	华勤技术	423	32,888.25	0.00
882	001332	锡装股份	1,000	32,850.00	0.00
883	601139	深圳燃气	4,700	32,383.00	0.00
884	002352	顺丰控股	800	32,320.00	0.00
885	300553	集智股份	900	32,220.00	0.00
886	000429	粤高速 A	3,800	32,148.00	0.00
887	688019	安集科技	200	31,952.00	0.00
888	603712	七一二	1,000	31,510.00	0.00
889	600690	海尔智家	1,400	29,400.00	0.00
890	300251	光线传媒	3,500	28,525.00	0.00
891	000029	深深房 A	2,400	28,224.00	0.00
892	000009	中国宝安	2,400	28,176.00	0.00
893	301348	蓝箭电子	613	27,321.41	0.00
894	688281	华秦科技	200	27,132.00	0.00
895	688702	盛科通信	549	26,450.82	0.00
896	688582	芯动联科	648	25,058.16	0.00
897	688700	东威科技	400	24,408.00	0.00
898	301559	中集环科	1,315	23,985.60	0.00
899	301486	致尚科技	482	22,774.50	0.00
900	600893	航发动力	600	22,428.00	0.00
901	301511	德福科技	982	22,261.94	0.00
902	600854	春兰股份	4,200	22,134.00	0.00
903	002016	世荣兆业	3,500	22,015.00	0.00
904	688652	京仪装备	416	21,736.00	0.00
905	301525	儒竞科技	266	21,668.36	0.00
906	301498	乖宝宠物	554	21,500.74	0.00
907	301371	敷尔佳	564	21,195.12	0.00
908	301370	国科恒泰	1,240	19,852.40	0.00
909	688627	精智达	222	19,473.84	0.00
910	688586	江航装备	1,700	18,853.00	0.00
911	301488	豪恩汽电	262	18,101.58	0.00
912	301468	博盈特焊	598	18,071.56	0.00
913	301381	赛维时代	571	16,952.99	0.00
914	301172	君逸数码	438	16,714.08	0.00
915	301182	凯旺科技	700	16,366.00	0.00
916	301362	民爆光电	420	16,178.40	0.00
917	688612	威迈斯	422	16,023.34	0.00
918	601096	宏盛华源	3,918	15,907.08	0.00
919	301393	昊帆生物	260	15,436.20	0.00
920	688610	埃科光电	275	14,025.00	0.00
921	601083	锦江航运	1,263	13,981.41	0.00
922	301510	固高科技	396	13,863.96	0.00

923	301210	金杨股份	281	12,779.88	0.00
924	301566	达利凯普	576	12,752.64	0.00
925	301456	盘古智能	407	12,368.73	0.00
926	300550	和仁科技	800	11,992.00	0.00
927	688602	康鹏科技	1,066	11,789.96	0.00
928	603367	辰欣药业	800	11,712.00	0.00
929	688719	爱科赛博	194	11,659.40	0.00
930	301550	斯菱股份	260	11,328.20	0.00
931	301292	海科新源	583	11,281.05	0.00
932	301508	中机认检	419	11,178.92	0.00
933	601001	晋控煤业	900	11,097.00	0.00
934	688330	宏力达	368	10,454.88	0.00
935	688603	天承科技	140	10,379.60	0.00
936	301528	多浦乐	148	10,198.68	0.00
937	301329	信音电子	458	10,181.34	0.00
938	301372	科净源	231	10,069.29	0.00
939	301261	恒工精密	198	10,068.30	0.00
940	301202	朗威股份	306	9,730.80	0.00
941	301395	仁信新材	520	9,718.80	0.00
942	688716	中研股份	267	9,716.13	0.00
943	301413	安培龙	164	9,543.16	0.00
944	301500	飞南资源	455	9,504.95	0.00
945	301418	协昌科技	189	9,487.80	0.00
946	301516	中远通	604	9,368.04	0.00
947	300918	南山智尚	900	9,297.00	0.00
948	301272	英华特	173	9,234.74	0.00
949	301469	恒达新材	275	9,099.75	0.00
950	301519	舜禹股份	442	8,932.82	0.00
951	301518	长华化学	385	8,858.85	0.00
952	301568	思泰克	246	8,752.68	0.00
953	600522	中天科技	700	8,743.00	0.00
954	301520	万邦医药	160	8,438.40	0.00
955	688638	誉辰智能	141	8,414.88	0.00
956	301459	丰茂股份	208	8,286.72	0.00
957	688720	艾森股份	165	8,223.60	0.00
958	301489	思泉新材	128	8,206.08	0.00
959	688651	盛邦安全	178	8,196.90	0.00
960	301517	陕西华达	185	8,082.65	0.00
961	301578	辰奕智能	118	8,061.76	0.00
962	301548	崇德科技	136	8,022.64	0.00
963	688657	浩辰软件	101	7,901.23	0.00
964	688066	航天宏图	185	7,814.40	0.00
965	688671	碧兴物联	226	7,751.80	0.00
966	688693	锆威特	178	7,726.98	0.00

967	603275	众辰科技	193	7,662.10	0.00
968	301533	威马农机	225	7,461.00	0.00
969	603062	麦加芯彩	126	7,284.06	0.00
970	301555	惠柏新材	224	7,266.56	0.00
971	002133	广宇集团	2,000	6,980.00	0.00
972	301505	苏州规划	194	6,947.14	0.00
973	600319	亚星化学	1,200	6,936.00	0.00
974	301529	福赛科技	182	6,894.16	0.00
975	300487	蓝晓科技	125	6,632.50	0.00
976	600819	耀皮玻璃	1,300	6,617.00	0.00
977	301345	涛涛车业	108	6,577.20	0.00
978	301515	港通医疗	230	6,502.10	0.00
979	688648	中邮科技	303	6,493.29	0.00
980	001378	德冠新材	205	6,410.35	0.00
981	688258	卓易信息	124	6,138.00	0.00
982	688450	光格科技	167	6,082.14	0.00
983	603004	鼎龙科技	195	6,082.05	0.00
984	603119	浙江荣泰	226	5,394.62	0.00
985	603896	寿仙谷	158	5,093.92	0.00
986	001306	夏厦精密	64	4,823.04	0.00
987	603075	热威股份	182	4,242.42	0.00
988	001358	兴欣新材	87	3,841.92	0.00
989	001239	永达股份	189	3,764.88	0.00
990	603231	索宝蛋白	161	3,466.33	0.00
991	603273	天元智能	178	3,376.66	0.00
992	603276	恒兴新材	134	3,333.92	0.00
993	603373	安邦护卫	88	3,058.00	0.00
994	688329	艾隆科技	102	2,535.72	0.00
995	000967	盈峰环境	500	2,375.00	0.00
996	603613	国联股份	99	2,178.99	0.00
997	002017	东信和平	115	1,197.15	0.00
998	002459	晶澳科技	56	1,160.32	0.00
999	603610	麒盛科技	52	619.84	0.00
1,000	002839	张家港行	100	388.00	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	002594	比亚迪	21,757,759.00	6.05
2	601336	新华保险	20,528,279.98	5.70

3	600201	生物股份	18,887,287.00	5.25
4	002032	苏泊尔	17,874,051.00	4.97
5	000729	燕京啤酒	17,574,547.47	4.88
6	600038	中直股份	17,373,130.02	4.83
7	000426	兴业银锡	17,336,610.00	4.82
8	000725	京东方 A	17,204,539.00	4.78
9	003012	东鹏控股	17,130,284.00	4.76
10	002739	万达电影	17,068,075.36	4.74
11	603113	金能科技	17,003,176.00	4.72
12	601318	中国平安	16,949,474.00	4.71
13	688777	中控技术	16,352,313.44	4.54
14	601137	博威合金	16,251,385.00	4.52
15	601688	华泰证券	16,196,433.00	4.50
16	603993	洛阳钼业	16,107,112.00	4.48
17	600161	天坛生物	16,041,569.50	4.46
18	002027	分众传媒	15,932,060.00	4.43
19	000338	潍柴动力	15,805,151.00	4.39
20	002249	大洋电机	15,596,303.60	4.33
21	600489	中金黄金	15,433,536.00	4.29
22	000987	越秀资本	15,398,260.60	4.28
23	000932	华菱钢铁	15,314,823.00	4.26
24	600535	天士力	15,039,688.00	4.18
25	000623	吉林敖东	14,553,884.00	4.04
26	002683	广东宏大	14,385,194.42	4.00
27	688819	天能股份	14,149,696.87	3.93
28	688981	中芯国际	14,113,114.01	3.92
29	002179	中航光电	14,099,967.60	3.92
30	002152	广电运通	13,778,052.00	3.83
31	688390	固德威	13,676,491.15	3.80
32	603233	大参林	13,648,914.60	3.79
33	002635	安洁科技	13,626,382.00	3.79
34	000997	新大陆	13,525,298.00	3.76
35	002203	海亮股份	13,114,210.37	3.64
36	002918	蒙娜丽莎	13,057,761.00	3.63
37	600879	航天电子	12,967,404.96	3.60
38	603208	江山欧派	12,948,958.90	3.60
39	600643	爱建集团	12,741,634.20	3.54
40	600901	江苏金租	12,656,346.80	3.52
41	601857	中国石油	12,557,698.00	3.49
42	600968	海油发展	12,513,368.00	3.48
43	002938	鹏鼎控股	12,448,031.00	3.46
44	601600	中国铝业	12,371,451.00	3.44
45	601319	中国人保	12,351,045.00	3.43
46	601601	中国太保	12,339,206.00	3.43

47	601108	财通证券	12,134,656.60	3.37
48	601198	东兴证券	11,956,763.00	3.32
49	000878	云南铜业	11,914,103.00	3.31
50	600808	马钢股份	11,856,108.00	3.29
51	000069	华侨城 A	11,812,359.00	3.28
52	002697	红旗连锁	11,688,368.00	3.25
53	603027	千禾味业	11,594,768.60	3.22
54	600827	百联股份	11,582,812.48	3.22
55	601958	金钼股份	11,549,040.00	3.21
56	300143	盈康生命	11,515,462.91	3.20
57	603737	三棵树	11,347,606.00	3.15
58	002410	广联达	11,342,514.00	3.15
59	600699	均胜电子	11,341,694.00	3.15
60	300750	宁德时代	11,293,778.35	3.14
61	002773	康弘药业	11,281,814.02	3.13
62	600109	国金证券	11,224,858.00	3.12
63	600019	宝钢股份	11,087,253.32	3.08
64	601998	中信银行	11,065,942.20	3.07
65	002641	公元股份	11,058,534.00	3.07
66	603605	珀莱雅	11,056,860.40	3.07
67	605009	豪悦护理	11,046,314.89	3.07
68	002266	浙富控股	10,974,733.92	3.05
69	002128	电投能源	10,905,172.00	3.03
70	300653	正海生物	10,897,910.65	3.03
71	601211	国泰君安	10,775,037.00	2.99
72	603613	国联股份	10,707,872.00	2.98
73	002250	联化科技	10,631,617.00	2.95
74	000737	北方铜业	10,578,971.00	2.94
75	603228	景旺电子	10,511,506.70	2.92
76	601333	广深铁路	10,492,749.00	2.92
77	002373	千方科技	10,490,391.00	2.91
78	002422	科伦药业	10,424,331.00	2.90
79	601939	建设银行	10,415,808.00	2.89
80	600066	宇通客车	10,349,519.00	2.88
81	601021	春秋航空	10,302,172.65	2.86
82	688772	珠海冠宇	10,201,035.35	2.83
83	600941	中国移动	10,162,224.89	2.82
84	002384	东山精密	10,134,659.00	2.82
85	001979	招商蛇口	10,090,231.00	2.80
86	000553	安道麦 A	10,068,656.00	2.80
87	688088	虹软科技	10,062,172.46	2.80
88	601988	中国银行	10,042,000.00	2.79
89	600845	宝信软件	10,035,533.00	2.79
90	000967	盈峰环境	10,027,292.00	2.79

91	688012	中微公司	9,996,933.39	2.78
92	600583	海油工程	9,929,103.00	2.76
93	000567	海德股份	9,876,889.25	2.74
94	002928	华夏航空	9,876,145.75	2.74
95	002299	圣农发展	9,806,254.00	2.72
96	600908	无锡银行	9,792,831.00	2.72
97	600458	时代新材	9,731,533.00	2.70
98	002608	江苏国信	9,689,296.00	2.69
99	600985	淮北矿业	9,637,821.00	2.68
100	002745	木林森	9,620,522.00	2.67
101	601816	京沪高铁	9,612,696.00	2.67
102	601966	玲珑轮胎	9,572,464.00	2.66
103	000627	天茂集团	9,444,531.00	2.62
104	300332	天壕能源	9,430,890.00	2.62
105	601608	中信重工	9,402,485.22	2.61
106	002984	森麒麟	9,334,455.00	2.59
107	600500	中化国际	9,298,345.70	2.58
108	002600	领益智造	9,271,612.00	2.58
109	000100	TCL 科技	9,212,423.70	2.56
110	600315	上海家化	9,165,881.84	2.55
111	603551	奥普家居	9,139,446.00	2.54
112	000333	美的集团	9,133,209.00	2.54
113	600390	五矿资本	9,130,679.00	2.54
114	000050	深天马 A	9,106,531.00	2.53
115	601989	中国重工	9,097,317.00	2.53
116	688239	航宇科技	9,096,436.35	2.53
117	605296	神农集团	9,058,116.90	2.52
118	600377	宁沪高速	9,043,334.00	2.51
119	601686	友发集团	9,032,590.00	2.51
120	300602	飞荣达	8,997,240.58	2.50
121	002583	海能达	8,965,655.00	2.49
122	002056	横店东磁	8,922,076.00	2.48
123	601888	中国中免	8,911,426.00	2.48
124	601728	中国电信	8,887,640.00	2.47
125	601328	交通银行	8,877,787.00	2.47
126	601006	大秦铁路	8,856,635.00	2.46
127	300433	蓝思科技	8,855,159.00	2.46
128	603444	吉比特	8,843,492.00	2.46
129	688617	惠泰医疗	8,824,006.36	2.45
130	000596	古井贡酒	8,799,522.00	2.45
131	300308	中际旭创	8,734,922.00	2.43
132	300638	广和通	8,711,381.20	2.42
133	603466	风语筑	8,710,008.54	2.42
134	688007	光峰科技	8,675,651.60	2.41

135	300900	广联航空	8,667,608.00	2.41
136	000686	东北证券	8,663,442.00	2.41
137	002946	新乳业	8,603,873.00	2.39
138	601658	邮储银行	8,525,915.00	2.37
139	002244	滨江集团	8,511,188.00	2.36
140	688018	乐鑫科技	8,439,812.04	2.35
141	000598	兴蓉环境	8,427,117.00	2.34
142	688639	华恒生物	8,410,320.83	2.34
143	000063	中兴通讯	8,379,143.00	2.33
144	688050	爱博医疗	8,282,671.21	2.30
145	600276	恒瑞医药	8,264,976.60	2.30
146	601138	工业富联	8,239,387.00	2.29
147	601827	三峰环境	8,209,765.00	2.28
148	300232	洲明科技	8,187,130.00	2.27
149	300115	长盈精密	8,152,222.00	2.27
150	301239	普瑞眼科	8,112,917.00	2.25
151	688002	睿创微纳	8,095,001.12	2.25
152	600867	通化东宝	8,038,585.00	2.23
153	600158	中体产业	8,001,163.00	2.22
154	601801	皖新传媒	7,992,256.00	2.22
155	603355	莱克电气	7,986,081.68	2.22
156	002214	大立科技	7,981,568.00	2.22
157	600284	浦东建设	7,979,558.41	2.22
158	000761	本钢板材	7,974,418.00	2.22
159	601628	中国人寿	7,971,473.00	2.22
160	002294	信立泰	7,946,999.00	2.21
161	002966	苏州银行	7,914,325.00	2.20
162	002563	森马服饰	7,913,959.00	2.20
163	002695	煌上煌	7,868,530.00	2.19
164	002064	华峰化学	7,864,839.00	2.19
165	600600	青岛啤酒	7,856,379.80	2.18
166	002038	双鹭药业	7,852,472.00	2.18
167	600886	国投电力	7,840,195.00	2.18
168	002959	小熊电器	7,815,422.00	2.17
169	601398	工商银行	7,813,295.00	2.17
170	002698	博实股份	7,795,219.25	2.17
171	000563	陕国投 A	7,771,992.00	2.16
172	600482	中国动力	7,730,649.00	2.15
173	300723	一品红	7,723,688.89	2.15
174	002651	利君股份	7,705,544.00	2.14
175	002749	国光股份	7,704,988.00	2.14
176	603259	药明康德	7,691,569.00	2.14
177	000423	东阿阿胶	7,638,559.00	2.12
178	002020	京新药业	7,633,558.00	2.12

179	002811	郑中设计	7,630,113.00	2.12
180	601717	郑煤机	7,628,926.00	2.12
181	600028	中国石化	7,596,062.00	2.11
182	603225	新凤鸣	7,587,004.00	2.11
183	688616	西力科技	7,574,914.49	2.10
184	600398	海澜之家	7,547,283.00	2.10
185	603920	世运电路	7,522,720.00	2.09
186	688366	昊海生科	7,451,890.41	2.07
187	601222	林洋能源	7,441,247.00	2.07
188	000543	皖能电力	7,436,433.00	2.07
189	600098	广州发展	7,429,934.00	2.06
190	002815	崇达技术	7,382,082.19	2.05
191	002568	百润股份	7,374,201.40	2.05
192	003006	百亚股份	7,330,849.78	2.04
193	600566	济川药业	7,300,911.00	2.03
194	600502	安徽建工	7,276,759.00	2.02
195	000858	五粮液	7,275,646.00	2.02
196	002774	快意电梯	7,257,504.00	2.02
197	000690	宝新能源	7,249,002.60	2.01
198	300017	网宿科技	7,240,596.00	2.01
199	002718	友邦吊顶	7,225,474.00	2.01
200	600395	盘江股份	7,222,393.00	2.01
201	300760	迈瑞医疗	7,202,134.00	2.00

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	002594	比亚迪	20,968,916.35	5.83
2	601336	新华保险	20,527,068.00	5.70
3	600489	中金黄金	17,346,057.00	4.82
4	000426	兴业银锡	17,154,895.00	4.77
5	600201	生物股份	16,860,013.00	4.68
6	002032	苏泊尔	16,013,250.00	4.45
7	000729	燕京啤酒	15,736,644.24	4.37
8	000878	云南铜业	15,412,391.00	4.28
9	688777	中控技术	14,997,055.05	4.17
10	000987	越秀资本	14,862,019.33	4.13
11	002739	万达电影	14,818,288.00	4.12
12	601137	博威合金	14,402,060.00	4.00
13	002152	广电运通	14,384,085.00	4.00

14	003012	东鹏控股	14,327,648.00	3.98
15	000623	吉林敖东	14,122,617.00	3.92
16	601333	广深铁路	13,820,435.12	3.84
17	600535	天士力	13,812,798.00	3.84
18	603113	金能科技	13,787,926.88	3.83
19	002918	蒙娜丽莎	13,731,040.35	3.82
20	002683	广东宏大	13,706,552.27	3.81
21	002422	科伦药业	13,567,241.98	3.77
22	601998	中信银行	13,548,401.40	3.76
23	000725	京东方 A	13,391,471.00	3.72
24	688981	中芯国际	13,348,828.78	3.71
25	600038	中直股份	13,347,228.22	3.71
26	600879	航天电子	12,961,944.72	3.60
27	002179	中航光电	12,896,367.42	3.58
28	603605	珀莱雅	12,863,087.04	3.57
29	688390	固德威	12,834,199.55	3.57
30	688819	天能股份	12,606,773.95	3.50
31	601600	中国铝业	12,594,804.00	3.50
32	002027	分众传媒	12,546,874.00	3.49
33	600827	百联股份	12,469,169.30	3.46
34	601958	金钼股份	12,445,289.00	3.46
35	002938	鹏鼎控股	12,303,150.00	3.42
36	000567	海德股份	12,288,699.31	3.41
37	601319	中国人保	12,223,549.00	3.40
38	000997	新大陆	12,206,254.20	3.39
39	002249	大洋电机	12,035,430.00	3.34
40	002203	海亮股份	12,022,578.07	3.34
41	002773	康弘药业	12,003,782.48	3.34
42	600109	国金证券	11,846,657.65	3.29
43	601688	华泰证券	11,836,609.00	3.29
44	002697	红旗连锁	11,660,925.00	3.24
45	600968	海油发展	11,630,428.00	3.23
46	605009	豪悦护理	11,537,109.42	3.21
47	603993	洛阳钼业	11,495,278.00	3.19
48	688012	中微公司	11,446,863.91	3.18
49	688366	昊海生科	11,429,030.39	3.18
50	600583	海油工程	11,401,351.00	3.17
51	601318	中国平安	11,377,842.00	3.16
52	600066	宇通客车	11,261,952.69	3.13
53	002294	信立泰	10,852,291.00	3.02
54	688007	光峰科技	10,794,529.31	3.00
55	300653	正海生物	10,769,931.25	2.99
56	300115	长盈精密	10,570,846.00	2.94
57	002384	东山精密	10,562,604.00	2.94

58	601939	建设银行	10,459,288.00	2.91
59	002635	安洁科技	10,323,403.72	2.87
60	601198	东兴证券	10,293,301.00	2.86
61	600643	爱建集团	10,287,470.22	2.86
62	002299	圣农发展	10,267,779.10	2.85
63	300143	盈康生命	10,264,521.00	2.85
64	688088	虹软科技	10,244,618.28	2.85
65	600161	天坛生物	10,212,132.60	2.84
66	600901	江苏金租	10,204,433.60	2.84
67	002250	联化科技	10,186,236.00	2.83
68	601857	中国石油	10,174,935.00	2.83
69	605296	神农集团	10,163,587.00	2.82
70	601021	春秋航空	10,156,358.00	2.82
71	600808	马钢股份	10,125,274.00	2.81
72	300602	飞荣达	10,119,183.00	2.81
73	600699	均胜电子	10,107,876.00	2.81
74	600845	宝信软件	10,083,962.88	2.80
75	600019	宝钢股份	10,033,820.64	2.79
76	601988	中国银行	10,020,690.00	2.78
77	000069	华侨城 A	10,018,256.00	2.78
78	603233	大参林	9,995,194.20	2.78
79	000967	盈峰环境	9,972,223.07	2.77
80	600377	宁沪高速	9,928,738.26	2.76
81	603027	千禾味业	9,917,006.40	2.76
82	000543	皖能电力	9,879,022.00	2.75
83	000338	潍柴动力	9,875,793.00	2.74
84	300017	网宿科技	9,841,305.00	2.73
85	600458	时代新材	9,823,529.00	2.73
86	002583	海能达	9,691,414.00	2.69
87	000627	天茂集团	9,591,885.15	2.67
88	001979	招商蛇口	9,563,958.00	2.66
89	688617	惠泰医疗	9,536,571.73	2.65
90	600985	淮北矿业	9,481,986.00	2.63
91	601966	玲珑轮胎	9,466,313.00	2.63
92	601989	中国重工	9,363,807.00	2.60
93	600908	无锡银行	9,345,188.00	2.60
94	002020	京新药业	9,340,660.40	2.60
95	000596	古井贡酒	9,252,303.00	2.57
96	603208	江山欧派	9,249,535.00	2.57
97	601686	友发集团	9,235,287.00	2.57
98	601108	财通证券	9,132,736.00	2.54
99	002698	博实股份	9,036,012.84	2.51
100	000553	安道麦 A	9,019,873.00	2.51
101	002959	小熊电器	8,996,186.00	2.50

102	688336	三生国健	8,986,378.26	2.50
103	000932	华菱钢铁	8,967,177.98	2.49
104	000921	海信家电	8,923,677.00	2.48
105	603737	三棵树	8,918,789.40	2.48
106	000048	京基智农	8,866,498.00	2.46
107	000690	宝新能源	8,827,620.28	2.45
108	002928	华夏航空	8,814,701.00	2.45
109	002410	广联达	8,799,267.00	2.45
110	600600	青岛啤酒	8,780,353.00	2.44
111	002946	新乳业	8,618,326.00	2.39
112	002600	领益智造	8,517,742.00	2.37
113	002966	苏州银行	8,425,912.50	2.34
114	601801	皖新传媒	8,392,851.07	2.33
115	688002	睿创微纳	8,314,418.05	2.31
116	000686	东北证券	8,299,068.00	2.31
117	600315	上海家化	8,293,068.30	2.30
118	002266	浙富控股	8,272,403.00	2.30
119	600158	中体产业	8,269,365.00	2.30
120	002038	双鹭药业	8,153,387.00	2.27
121	002244	滨江集团	8,142,503.00	2.26
122	603613	国联股份	8,035,316.50	2.23
123	601456	国联证券	8,018,871.47	2.23
124	601816	京沪高铁	7,981,358.00	2.22
125	601827	三峰环境	7,957,022.00	2.21
126	300487	蓝晓科技	7,927,793.50	2.20
127	002984	森麒麟	7,902,753.00	2.20
128	601608	中信重工	7,901,104.50	2.20
129	600886	国投电力	7,861,043.00	2.18
130	601006	大秦铁路	7,859,038.00	2.18
131	002695	煌上煌	7,814,722.00	2.17
132	002749	国光股份	7,803,583.50	2.17
133	603466	风语筑	7,800,517.06	2.17
134	600566	济川药业	7,797,547.00	2.17
135	688639	华恒生物	7,788,333.73	2.16
136	603355	莱克电气	7,781,585.00	2.16
137	002273	水晶光电	7,763,150.00	2.16
138	601668	中国建筑	7,736,384.00	2.15
139	002745	木林森	7,719,452.00	2.14
140	600941	中国移动	7,711,214.00	2.14
141	688018	乐鑫科技	7,705,434.11	2.14
142	601128	常熟银行	7,680,502.00	2.13
143	002064	华峰化学	7,677,624.00	2.13
144	603920	世运电路	7,613,537.14	2.12
145	603444	吉比特	7,597,682.00	2.11

146	601328	交通银行	7,596,276.00	2.11
147	000563	陕国投 A	7,591,637.00	2.11
148	688050	爱博医疗	7,589,744.26	2.11
149	600398	海澜之家	7,581,556.00	2.11
150	002373	千方科技	7,579,124.00	2.11
151	603551	奥普家居	7,532,122.00	2.09
152	601717	郑煤机	7,529,613.00	2.09
153	002651	利君股份	7,522,728.00	2.09
154	601658	邮储银行	7,506,302.00	2.09
155	000100	TCL 科技	7,501,631.80	2.08
156	002641	公元股份	7,496,949.00	2.08
157	000761	本钢板材	7,459,922.00	2.07
158	603105	芯能科技	7,443,698.00	2.07
159	300232	洲明科技	7,332,021.00	2.04
160	600395	盘江股份	7,317,785.00	2.03
161	002056	横店东磁	7,312,551.00	2.03
162	300332	天壕能源	7,301,775.00	2.03
163	600098	广州发展	7,251,933.00	2.02
164	002421	达实智能	7,215,409.00	2.00
165	600482	中国动力	7,209,951.00	2.00

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	6,745,428,701.50
卖出股票收入（成交）总额	6,060,238,665.61

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	577,887.55	0.05

8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	577,887.55	0.05

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	113069	博 23 转债	4,590	459,030.18	0.04
2	123228	震裕转债	605	69,618.56	0.01
3	113679	芯能转债	400	45,789.62	0.00
4	118042	奥维转债	30	3,449.19	0.00
5	-	-	-	-	-

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 报告期内，本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求，未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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	940,981.41
2	应收清算款	3,864,612.15
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	3,944,965.26
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,750,558.82

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 价值成长 股票 A	43,454	6,417.09	183,482,145.08	65.80%	95,366,105.89	34.20%
华夏智胜 价值成长 股票 C	41,152	10,916.14	366,093,984.61	81.50%	83,127,129.13	18.50%
合计	84,606	8,605.41	549,576,129.69	75.48%	178,493,235.02	24.52%

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	华夏智胜价值成长股票 A	668,220.98	0.24%
	华夏智胜价值成长股票 C	57,317.17	0.01%
	合计	725,538.15	0.10%

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	华夏智胜价值成长股票 A	0~10
	华夏智胜价值成长股票 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	华夏智胜价值成长股票 A	0
	华夏智胜价值成长股票 C	0
	合计	0

9.4 发起式基金发起资金持有份额情况

截至2021年3月6日，华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金的基金合同生效届满三年。

§10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华夏智胜价值成长股票 A	华夏智胜价值成长股票 C
基金合同生效日(2018 年 3 月 6 日) 基金份额总额	10,903,772.92	-
本报告期期初基金份额总额	65,306,145.82	190,848,098.17
本报告期基金总申购份额	319,604,890.36	733,120,522.26
减：本报告期基金总赎回份额	106,062,785.21	474,747,506.69
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	278,848,250.97	449,221,113.74

§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，张佑君先生担任本基金管理人董事长，杨明辉先生离任本基金管理人董事长。

本报告期内，基金托管人无重大人事变动。

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

本基金本报告期应支付给普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为 60,000 元人民币。截至本报告期末，该事务所已向本基金提供 8 年的审计服务。

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

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人及其高级管理人员在本报告期内无受稽查或处罚等情况。

11.6.2 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，基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

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	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		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	11	8,872,157,660.55	69.42%	1,141,356.25	40.37%	-
招商证券	6	1,436,298,831.01	11.24%	619,450.56	21.91%	-
中信建投证券	4	856,054,328.29	6.70%	369,208.31	13.06%	-
兴业证券	1	772,077,638.60	6.04%	333,008.64	11.78%	-
西部证券	1	471,855,093.93	3.69%	203,514.32	7.20%	-
中金公司	4	372,250,347.47	2.91%	160,558.15	5.68%	-

注：①为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择券商的标准，即：

i 经营行为规范。

ii 公司财务状况良好。

iii 有良好的内控制度，在业内有良好的声誉。

iv 有较强的全方位金融服务能力和水平：能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

v 建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯和服务。

②券商专用交易单元选择程序：

i 本基金管理人根据上述标准进行评估并确定选用的券商。

ii 本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议/证券经纪服务协议。

③除本表列示外，本基金还选择了财通证券、长江证券、第一创业证券、东方证券、东吴证券、方正证券、光大证券、广发证券、国联证券、国泰君安证券、海通证券、华泰证券、华西证券、江海证券、金元证券、联储证券、平安证券、上海证券、申万宏源、申万宏源证券、中泰证券、中银国际证券的交易单元作为本基金交易单元，本报告期无股票交易及应付佣金。

④在上述租用的券商交易单元中，国泰君安证券的部分交易单元、第一创业证券的交易单元为本基金本期新增的交易单元，东北证券的交易单元为本期剔除的交易单元。

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	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
中信证券	2,652,517.41	69.07%	-	-	-	-	-	-
招商证券	380,028.84	9.90%	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	187,795.31	4.89%	-	-	-	-	-	-
兴业证券	236,652.64	6.16%	-	-	-	-	-	-
西部证券	240,287.79	6.26%	-	-	-	-	-	-
中金公司	142,779.40	3.72%	-	-	-	-	-	-

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公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-01-06
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	中国证监会指定报刊及网站	2023-01-19
3	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	中国证监会指定报刊及网站	2023-02-24
4	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	中国证监会指定报刊及网站	2023-03-03
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	中国证监会指定报刊及网站	2023-03-11
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	中国证监会指定报刊及网站	2023-03-23
7	华夏基金管理有限公司关于调整华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金申购、定期定额申购及转换转入业务限额的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-03-28

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	中国证监会指定报刊及网站	2023-03-30
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	中国证监会指定报刊及网站	2023-04-01
10	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	中国证监会指定报刊及网站	2023-04-13
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	中国证监会指定报刊及网站	2023-04-15
12	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	中国证监会指定报刊及网站	2023-04-27
13	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	中国证监会指定报刊及网站	2023-05-13
14	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	中国证监会指定报刊及网站	2023-05-27
15	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	中国证监会指定报刊及网站	2023-05-31
16	华夏基金管理有限公司关于调整华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金申购、定期定额申购及转换转入业务限额的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-07-06
17	华夏基金管理有限公司关于设立武汉分公司的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-07-20
18	华夏基金管理有限公司关于设立沈阳分公司的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-07-26
19	华夏基金管理有限公司公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-09-22
20	华夏基金管理有限公司关于杭州分公司营业场所变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-09-27
21	华夏基金管理有限公司关于设立华夏股权投资基金管理（北京）有限公司的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-10-12

§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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20% 的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比

机构	1	2023-01-01 至 2023-02-01	69,557,649.66	76,962,792.11	69,557,649.66	76,962,792.11	10.57%
产品特有风险							
<p>本基金在报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额20%的情形，在市场流动性不足的情况下，如遇投资者巨额赎回或集中赎回，基金管理人可能无法以合理的价格及时变现基金资产，有可能对基金净值产生一定的影响，甚至可能引发基金的流动性风险。</p> <p>在特定情况下，若持有基金份额占比较高的投资者大量赎回本基金，可能导致在其赎回后本基金资产规模持续低于正常运作水平，面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。</p>							

§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转型的文件；
- 2、《华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金托管协议》；
- 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
二〇二四年三月二十八日