

华夏科技龙头两年持有期混合型证券投资基金
(原华夏科技龙头两年定期开放混合型证券投资
基金转型)

2023 年第 2 季度报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：华夏基金管理有限公司

报告送出日期：二〇二三年七月二十日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 7 月 18 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

基金管理人于 2023 年 2 月 20 日发布公告，以通讯方式召开华夏科技龙头两年定期开放混合型证券投资基金的基金份额持有人大会，审议《关于华夏科技龙头两年定期开放混合型证券投资基金转型为华夏科技龙头两年持有期混合型证券投资基金有关事项的议案》，会议议案于 2023 年 3 月 28 日获得通过，大会决议自同日起生效。自 2023 年 4 月 27 日起，华夏科技龙头两年定期开放混合型证券投资基金正式转型为华夏科技龙头两年持有期混合型证券投资基金。

本报告中财务资料未经审计。

华夏科技龙头两年持有期混合型证券投资基金的报告期自 2023 年 4 月 27 日起至 2023 年 6 月 30 日止，原华夏科技龙头两年定期开放混合型证券投资基金的报告期自 2023 年 4 月 1 日起至 2023 年 4 月 26 日止。如无特殊说明，本报告中“本基金”指华夏科技龙头两年持有期混合型证券投资基金及原华夏科技龙头两年定期开放混合型证券投资基金。

§2 基金产品概况

2.1 基金产品概况

2.1.1 华夏科技龙头两年持有期混合型证券投资基金

基金简称	华夏科技龙头两年持有混合
基金主代码	010180
交易代码	010180
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2023 年 4 月 27 日
报告期末基金份额总额	1,992,850,477.65 份
投资目标	在严格控制风险的前提下，精选科技龙头主题投资标的，追求超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	主要投资策略包括资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、股票期权投资策略、国债期货投资策略等。在股票投资策略上，本基金所指的科技龙头是指科技产业中拥有稳定或独特盈利模式、较高的“护城河”、具备“定价权”、优秀的管理层、市场空间广阔，已经或者未来有望成为所在领域龙头的相关企业。在具体行业配置方面，本基金界定的科技龙头主题相关上市公司包括信息技术、电子通信、集成电路、半导体、高端制造、新能源、新材料、科技含量较高的医药研发设备和医疗器械、节能环保、国防电子等领域的公司。
业绩比较基准	中证 TMT150 指数收益率*60%+中证港股通综合指数收益率*20%+中债综合（全价）指数收益率*20%。
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险和预期收益低于股票基金，高于债券基金与货币市场基金，属于中风险品种。本基金还将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。
基金管理人	华夏基金管理有限公司
基金托管人	中国光大银行股份有限公司

注：本基金以通讯方式召开基金份额持有人大会审议《关于华夏科技龙头两年定期开放混合型证券投资基金转型为华夏科技龙头两年持有期混合型证券投资基金有关事项的议案》，该议案自 2023 年 3 月 28 日生效，自 2023 年 4 月 27 日起，华夏科技龙头两年定期开放混合型证券投资基金正式转型为华夏科技龙头两年持有期混合型证券投资基金。

2.1.2 华夏科技龙头两年定期开放混合型证券投资基金

基金简称	华夏科技龙头两年定开混合
基金主代码	010180
交易代码	010180
基金运作方式	契约型定期开放式
基金合同生效日	2020 年 10 月 26 日
报告期末基金份额总额	2,036,507,265.61 份
投资目标	在严格控制风险的前提下，精选科技龙头主题投资标的，追求超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	主要投资策略包括资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、股票期权投资策略、国债期货投资策略、参与转融通证券出借业务等。在股票投资策略上，本基金所指的科技龙头是指科技产业中拥有稳定或独特盈利模式、较高的“护城河”、具备“定价权”、优秀的管理层、市场空间广阔，已经或者未来有望成为所在领域龙头的相关企业。在具体行业配置方面，本基金界定的科技龙头主题相关上市公司包括信息技术、电子通信、集成电路、半导体、高端制造、高端装备、新能源、新材料、医药生物、节能环保、国防军工、航空航天等领域的公司。

业绩比较基准	中证 TMT 150 指数收益率*60%+中证港股通综合指数收益率*20%+中债综合（全价）指数收益率*20%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险和预期收益低于股票基金，高于债券基金与货币市场基金，属于中风险品种。本基金还将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。
基金管理人	华夏基金管理有限公司
基金托管人	中国光大银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

3.1.1 华夏科技龙头两年持有期混合型证券投资基金

单位：人民币元

主要财务指标	报告期 (2023年4月27日-2023年6月30日)
1.本期已实现收益	-4,691,505.77
2.本期利润	46,226,037.64
3.加权平均基金份额本期利润	0.0230
4.期末基金资产净值	1,423,212,788.73
5.期末基金份额净值	0.7142

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自 2023 年 4 月 27 日起,“华夏科技龙头两年定期开放混合型证券投资基金”正式转型为“华夏科技龙头两年持有期混合型证券投资基金”。

3.1.2 华夏科技龙头两年定期开放混合型证券投资基金

单位: 人民币元

主要财务指标	报告期
	(2023 年 4 月 1 日-2023 年 4 月 26 日)
1.本期已实现收益	5,549,023.69
2.本期利润	-153,123,423.32
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0746
4.期末基金资产净值	1,407,326,994.46
5.期末基金份额净值	0.6910

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自 2023 年 4 月 27 日起,“华夏科技龙头两年定期开放混合型证券投资基金”正式转型为“华夏科技龙头两年持有期混合型证券投资基金”。

3.2 基金净值表现

3.2.1 华夏科技龙头两年持有期混合型证券投资基金

(报告期: 2023年4月27日-2023年6月30日)

3.2.1.1 本报告期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

阶段	净值增长率①	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	①-③	②-④

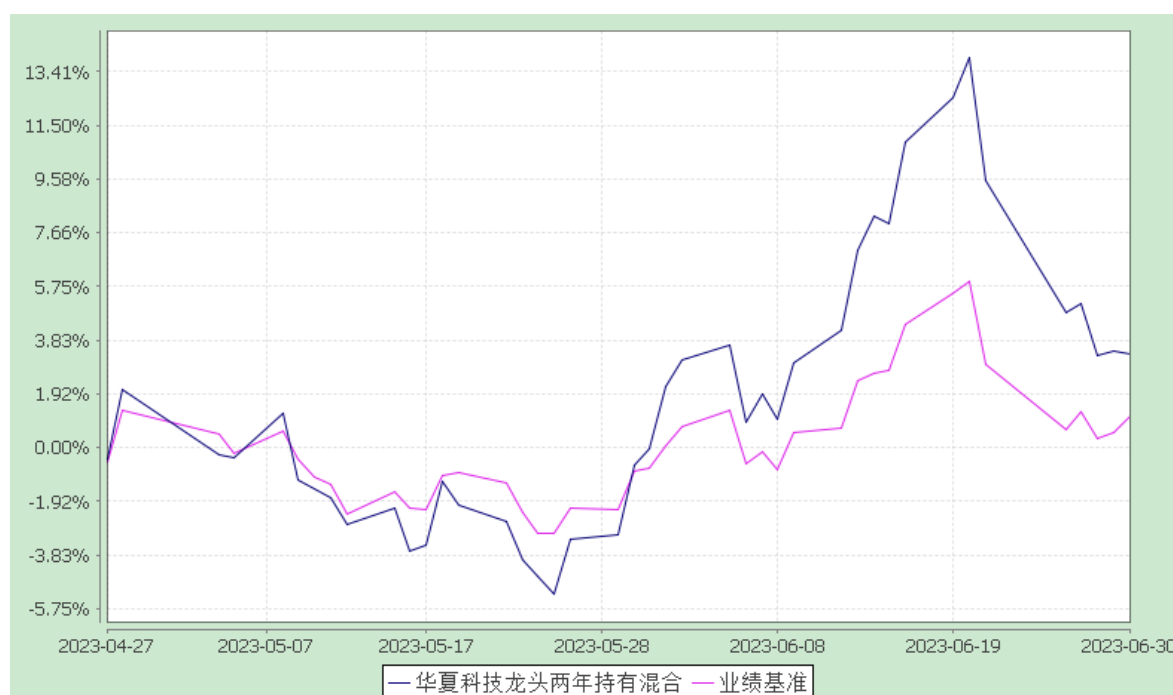
				④		
自基金转型起至今	3.36%	1.72%	1.10%	1.04%	2.26%	0.68%

3.2.1.2 自基金转型以来基金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

华夏科技龙头两年持有期混合型证券投资基金

基金份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2023 年 4 月 27 日-2023 年 6 月 30 日)



注：①自 2023 年 4 月 27 日起，“华夏科技龙头两年定期开放混合型证券投资基金”正式转型为“华夏科技龙头两年持有期混合型证券投资基金”。

②根据本基金的基金合同规定，本基金自转型之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同中投资范围、投资限制的有关约定。

3.2.2 华夏科技龙头两年定期开放混合型证券投资基金

(报告期：2023 年 4 月 1 日-2023 年 4 月 26 日)

3.2.2.1 本报告期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

阶段	净值增长率①	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	①-③	②-④

				④		
2023 年 4 月 1 日至 2023 年 4 月 26 日	-9.80%	1.95%	-3.12%	1.51%	-6.68%	0.44%
过去三个月	-10.06%	1.81%	3.95%	1.21%	-14.01%	0.60%
过去六个月	-6.28%	1.56%	16.67%	1.10%	-22.95%	0.46%
过去一年	-1.41%	1.68%	18.51%	1.12%	-19.92%	0.56%
自基金合同生效起至 2023 年 4 月 26 日	-30.90%	1.69%	-12.53%	1.09%	-18.37%	0.60%

3.2.2.2 自基金合同生效日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

华夏科技龙头两年定期开放混合型证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2020 年 10 月 26 日-2023 年 4 月 26 日)



§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

4.1.1 华夏科技龙头两年持有期混合型证券投资基金

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘平	本基金	2023-04-27	-	16 年	硕士。2007 年 2

	的基金经理				月加入华夏基金管理有限公司。历任行业研究员、投资经理、机构投资部总监、华夏优势增长混合型证券投资基金基金经理（2015年11月30日至2020年7月28日期间）、华夏领先股票型证券投资基金基金经理（2020年7月21日至2023年3月16日期间）等。
--	-------	--	--	--	---

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《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.2 华夏科技龙头两年定期开放混合型证券投资基金

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘平	本基金的基金经理	2020-10-26	2023-04-26	16年	硕士。2007年2月加入华夏基金管理有限公司。历任行业研究员、投资经理、机构投资部总监、华夏优势增长混合型证券投资基金基金经理（2015年11月30日至2020年7月28日期间）、华夏领先股票型证券投资基金基金经理（2020年7月21日至2023年3月16

					日期间)等。
--	--	--	--	--	--------

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《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

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 公平交易专项说明

4.3.1 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，本公司严格执行了《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 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 61 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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2 季度国内经济方面，1 季度的经济因为在去年年底放开疫情管控而强劲反弹，但是经济增速的反弹在 2 季度阶段性放缓，消费意愿较弱，需求疲软，央行于 6 月 20 日下调了 LPR（贷款市场报价利率）10 个基点。国际经济方面，美国经济表现出的韧性超预期，美联储继续年内第三次加息，于 5 月 3 日将联邦基金利率目标区间上调 25 个基点到 5% 至 5.25% 之间，从 2 季度开始美元对人民币汇率持续走强。

全球主要市场来看，美股表现最为强劲，A 股表现疲软，香港的恒生指数延续一季度的疲态。美国经济数据强劲，纳斯达克指数延续 1 季度上涨，2 季度涨约 12.8%，创今年以来

新高。受到地缘政治的影响，恒生指数在 2 季度跌 7.9%，恒生科技指数跌 9.1%，虽然 6 月中旬因美国国务卿访华而有阶段性的小幅反弹但整体仍是下跌。A 股沪深 300 指数跌超 5%，主要因为经济增速并没有延续一季度的快速反弹而是阶段性放缓。在 A 股市场中，行业表现分化严重，分行业来看，通信、传媒是因 AI 而成为涨幅居前的行业，消费者服务（-23.9%）和食品饮料（-11.3%）行业因 2 季度经济复苏的强度不及预期而继续下跌。2 季度 A 股市场的主线有两条：一条是中特估，比如银行石油石化股等普遍上涨，部分个股创历史新高，主要因为国债收益率下行，流动性宽裕，银行的股息率有吸引力；另一条主线仍然是延续了一季度的 AI，其中游戏、传媒和算力芯片这三个是领涨的，而应用方向都是在高位盘整的，即 TMT 行业内部也产生分化，通信（光模块为代表的算力）、传媒（AIGC 的游戏）分别上涨 12.8% 和 7.1%，但是以应用为主的计算机行业在 2 季度下跌 4.6% 即高位调整。

2 季度，本基金主要降低了 AI 应用端的个股持仓权重，对部分估值较贵的个股进行了部分锁盈，同时也增配了一些 AI 在教育端落地的个股配置，阶段性参与了 AI 算力的投资机会，主要是光模块，进一步降低了对港股的配置。增加了半导体板块的配置。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

转型前，截至 2023 年 4 月 26 日，本基金份额净值为 0.6910 元，2023 年 4 月 1 日至 4 月 26 日份额净值增长率为-9.80%，同期业绩比较基准增长率为-3.12%；转型后，截至 2023 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 0.7142 元，2023 年 4 月 27 日至 6 月 30 日本报告期间份额净值增长率为 3.36%，同期业绩比较基准增长率为 1.10%。

4.5 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

5.1 华夏科技龙头两年持有期混合型证券投资基金

（报告期：2023年4月27日-2023年6月30日）

5.1.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	1,235,456,007.14	85.53
	其中：股票	1,235,456,007.14	85.53
2	基金投资	-	-

3	固定收益投资	70,727,117.81	4.90
	其中：债券	70,727,117.81	4.90
	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	137,768,289.13	9.54
8	其他资产	442,501.33	0.03
9	合计	1,444,393,915.41	100.00

注：本基金本报告期末通过港股通机制投资香港股票的公允价值为 188,217,570.22 元，占基金资产净值比例为 13.22%。

5.1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	-	-
C	制造业	406,260,478.06	28.55
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	35,447.47	0.00
E	建筑业	19,748,140.64	1.39
F	批发和零售业	29,133.72	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	535,268,354.32	37.61
J	金融业	16,196,047.28	1.14
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	22,566.57	0.00

O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	23,782.86	0.00
R	文化、体育和娱乐业	69,654,486.00	4.89
S	综合	-	-
	合计	1,047,238,436.92	73.58

5.1.3 积极投资按行业分类的股票投资组合

5.1.3.1 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
通讯服务	117,888,935.82	8.28
信息技术	70,328,634.40	4.94
保健	-	-
必需消费品	-	-
材料	-	-
房地产	-	-
非必需消费品	-	-
工业	-	-
公用事业	-	-
金融	-	-
能源	-	-
合计	188,217,570.22	13.22

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

5.1.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	00700	腾讯控股	385,600	117,888,935.82	8.28
2	002230	科大讯飞	1,588,300	107,940,868.00	7.58
3	688111	金山办公	143,325	67,680,931.50	4.76
4	300161	华中数控	1,202,300	64,347,096.00	4.52
5	300454	深信服	532,766	60,335,749.50	4.24
6	688012	中微公司	385,421	60,299,115.45	4.24
7	00268	金蝶国际	6,200,000	59,906,572.48	4.21
8	002920	德赛西威	321,410	50,078,892.10	3.52
9	002063	远光软件	4,213,921	36,576,834.28	2.57
10	688981	中芯国际	700,000	35,364,000.00	2.48

注：所用证券代码采用当地市场代码。

5.1.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	70,727,117.81	4.97
	其中：政策性金融债	70,727,117.81	4.97
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）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	70,727,117.81	4.97

5.1.6 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	230401	23 农发 01	700,000	70,727,117.81	4.97
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

5.1.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.1.8 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。

5.1.9 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.1.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.1.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无股指期货投资。

5.1.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末无股指期货投资。

5.1.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.1.11.1 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。

5.1.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无国债期货投资。

5.1.11.3 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。

5.1.12 投资组合报告附注

5.1.12.1 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。

5.1.12.2 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。

5.1.12.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	442,501.33
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	442,501.33

5.1.12.4 报告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。

5.1.12.5 报告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。

5.1.12.6 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。

5.2 华夏科技龙头两年定期开放混合型证券投资基金

（报告期：2023年4月1日-2023年4月26日）

5.2.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	1,311,310,116.44	92.56
	其中：股票	1,311,310,116.44	92.56
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	67,792,023.83	4.79
8	其他资产	37,542,106.83	2.65
9	合计	1,416,644,247.10	100.00

注：本基金本报告期末通过港股通机制投资香港股票的公允价值为 229,993,263.94 元，占基金资产净值比例为 16.34%。

5.2.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	-	-
C	制造业	465,180,192.09	33.05
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	34,694.07	0.00
E	建筑业	18,176,306.64	1.29
F	批发和零售业	26,195.40	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	560,972,419.43	39.86
J	金融业	16,162,782.92	1.15
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	26,726.15	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	7,681.50	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	177,009.30	0.01
R	文化、体育和娱乐业	20,552,845.00	1.46
S	综合	-	-
	合计	1,081,316,852.50	76.83

5.2.3 积极投资按行业分类的股票投资组合

5.2.3.1 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例 （%）
通讯服务	135,630,061.75	9.64
信息技术	94,363,202.19	6.71
保健	-	-
必需消费品	-	-
材料	-	-
房地产	-	-
非必需消费品	-	-
工业	-	-
公用事业	-	-
金融	-	-

能源	-	-
合计	229,993,263.94	16.34

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

5.2.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	00700	腾讯控股	441,600	135,630,061.75	9.64
2	00268	金蝶国际	8,856,000	94,363,202.19	6.71
3	002230	科大讯飞	1,416,400	80,706,472.00	5.73
4	688012	中微公司	385,421	67,641,385.50	4.81
5	300454	深信服	544,166	65,169,320.16	4.63
6	002410	广联达	1,111,148	63,313,213.04	4.50
7	688111	金山办公	130,325	56,054,085.75	3.98
8	300161	华中数控	1,202,300	44,845,790.00	3.19
9	600570	恒生电子	920,282	41,964,859.20	2.98
10	688981	中芯国际	700,000	40,712,000.00	2.89

注：所用证券代码采用当地市场代码。

5.2.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.2.6 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.2.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.2.8 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。

5.2.9 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.2.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.2.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无股指期货投资。

5.2.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末无股指期货投资。

5.2.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.2.11.1 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。

5.2.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无国债期货投资。

5.2.11.3 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。

5.2.12 投资组合报告附注

5.2.12.1 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。

5.2.12.2 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。

5.2.12.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	584,839.74
2	应收证券清算款	36,957,267.09
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	37,542,106.83

5.2.12.4 报告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。

5.2.12.5 报告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。

5.2.12.6 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。

§6 开放式基金份额变动

6.1 华夏科技龙头两年持有期混合型证券投资基金

单位：份

基金合同生效日（转型日）基金份额总额	2,036,507,265.61
基金转型日起至报告期期末基金总申购份额	1,107,953.18
减：基金转型日起至报告期期末基金总赎回份额	44,764,741.14
基金转型日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,992,850,477.65

注：自 2023 年 4 月 27 日起，“华夏科技龙头两年定期开放混合型证券投资基金”正式转型为“华夏科技龙头两年持有期混合型证券投资基金”。

6.2 华夏科技龙头两年定期开放混合型证券投资基金

单位：份

报告期期初基金份额总额	2,064,795,130.59
报告期期间基金总申购份额	-
减：报告期期间基金总赎回份额	28,287,864.98
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	2,036,507,265.61

注：自 2023 年 4 月 27 日起，“华夏科技龙头两年定期开放混合型证券投资基金”正式转型为“华夏科技龙头两年持有期混合型证券投资基金”。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 华夏科技龙头两年持有期混合型证券投资基金

7.1.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

7.1.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

7.2 华夏科技龙头两年定期开放混合型证券投资基金

7.2.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

7.2.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 华夏科技龙头两年持有期混合型证券投资基金

8.1.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况。

8.1.2 影响投资者决策的其他重要信息

1、报告期内披露的主要事项

2023 年 4 月 24 日发布华夏科技龙头两年持有期混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换、定期定额申购业务的公告。

2023 年 5 月 11 日发布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。

2023 年 5 月 13 日发布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。

2023 年 5 月 27 日发布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。

2023 年 5 月 31 日发布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。

2、其他相关信息

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、广州和青岛设有分公司，在香港、深圳、上海设有子公司。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、保险资金投资管理资格、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。

8.2 华夏科技龙头两年定期开放混合型证券投资基金

8.2.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况。

8.2.2 影响投资者决策的其他重要信息

1、报告期内披露的主要事项

2023 年 4 月 11 日发布华夏科技龙头两年定期开放混合型证券投资基金转型提示性公告。

2023 年 4 月 24 日发布华夏科技龙头两年定期开放混合型证券投资基金转型提示性公告。

2、其他相关信息

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、广州和青岛设有分公司，在香港、深圳、上海设有子公司。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。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予基金注册的文件；
- 2、《华夏科技龙头两年持有期混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《华夏科技龙头两年持有期混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、《华夏科技龙头两年定期开放混合型证券投资基金基金合同》；
- 5、《华夏科技龙头两年定期开放混合型证券投资基金托管协议》；
- 6、法律意见书；
- 7、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 8、基金托管人业务资格批件、营业执照。

9.2 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。

9.3 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。

二〇二三年七月二十日