

---

# 华夏智胜新锐股票型证券投资基金

## 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：广发证券股份有限公司

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。

基金托管人广发证券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 7 月 7 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 .....	7
§4 管理人报告 .....	8
§5 托管人报告 .....	13
§6 审计报告 .....	14
§7 年度财务报表 .....	16
7.1 资产负债表.....	16
7.2 利润表.....	17
7.3 净资产变动表.....	18
7.4 报表附注.....	19
§8 投资组合报告 .....	47
8.1 期末基金资产组合情况.....	47
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	48
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 .....	48
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	64
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	66
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 .....	66
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 .....	67
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 .....	67
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 .....	67
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	67
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	67
8.12 投资组合报告附注 .....	67
§9 基金份额持有人信息 .....	68
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	68
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	68
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 .....	68
§10 开放式基金份额变动 .....	68
§11 重大事件揭示 .....	69
§12 影响投资者决策的其他重要信息 .....	71
§13 备查文件目录 .....	71

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华夏智胜新锐股票型证券投资基金	
基金简称	华夏智胜新锐股票	
基金主代码	018728	
交易代码	018728	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2023 年 7 月 7 日	
基金管理人	华夏基金管理有限公司	
基金托管人	广发证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,560,564,323.22 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华夏智胜新锐股票 A	华夏智胜新锐股票 C
下属分级基金的交易代码	018728	018729
报告期末下属分级基金的份额总额	618,237,331.58 份	942,326,991.64 份

### 2.2 基金产品说明

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

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华夏基金管理有限公司	广发证券股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李彬	罗琦
	联系电话	400-818-6666	020-66338888
	电子邮箱	service@ChinaAMC.com	gzluoqi@gf.com.cn
客户服务电话		400-818-6666	95575
传真		010-63136700	020-87553363-6847
注册地址		北京市顺义区安庆大街甲3号院	广东省广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街2号618室
办公地址		北京市西城区金融大街33号通	广州市天河区马场路26号广发证券

	泰大厦B座8层	大厦34楼
邮政编码	100033	510627
法定代表人	张佑君	林传辉

#### 2.4 信息披露方式

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

#### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	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 7 月 7 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日	
	华夏智胜新锐股票 A	华夏智胜新锐股票 C
本期已实现收益	-2,706,732.13	-4,430,444.07
本期利润	-9,498,708.40	-14,109,037.54
加权平均基金份额本期利润	-0.0162	-0.0152
本期加权平均净值利润率	-1.66%	-1.56%
本期基金份额净值增长率	-1.54%	-1.73%
3.1.2 期末数据和指标	2023 年末	
	华夏智胜新锐股票 A	华夏智胜新锐股票 C
期末可供分配利润	-9,543,332.66	-16,344,949.34
期末可供分配基金份额利润	-0.0154	-0.0173
期末基金资产净值	608,693,998.92	925,982,042.30
期末基金份额净值	0.9846	0.9827
3.1.3 累计期末指标	2023 年末	
	华夏智胜新锐股票 A	华夏智胜新锐股票 C

基金份额累计净值增长率	-1.54%	-1.73%
-------------	--------	--------

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

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

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

④本基金合同于 2023 年 7 月 7 日生效。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

##### 华夏智胜新锐股票 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.19%	0.88%	-2.98%	0.98%	4.17%	-0.10%
自基金合同生效起至今	-1.54%	0.87%	-9.83%	0.97%	8.29%	-0.10%

##### 华夏智胜新锐股票 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.09%	0.88%	-2.98%	0.98%	4.07%	-0.10%
自基金合同生效起至今	-1.73%	0.87%	-9.83%	0.97%	8.10%	-0.10%

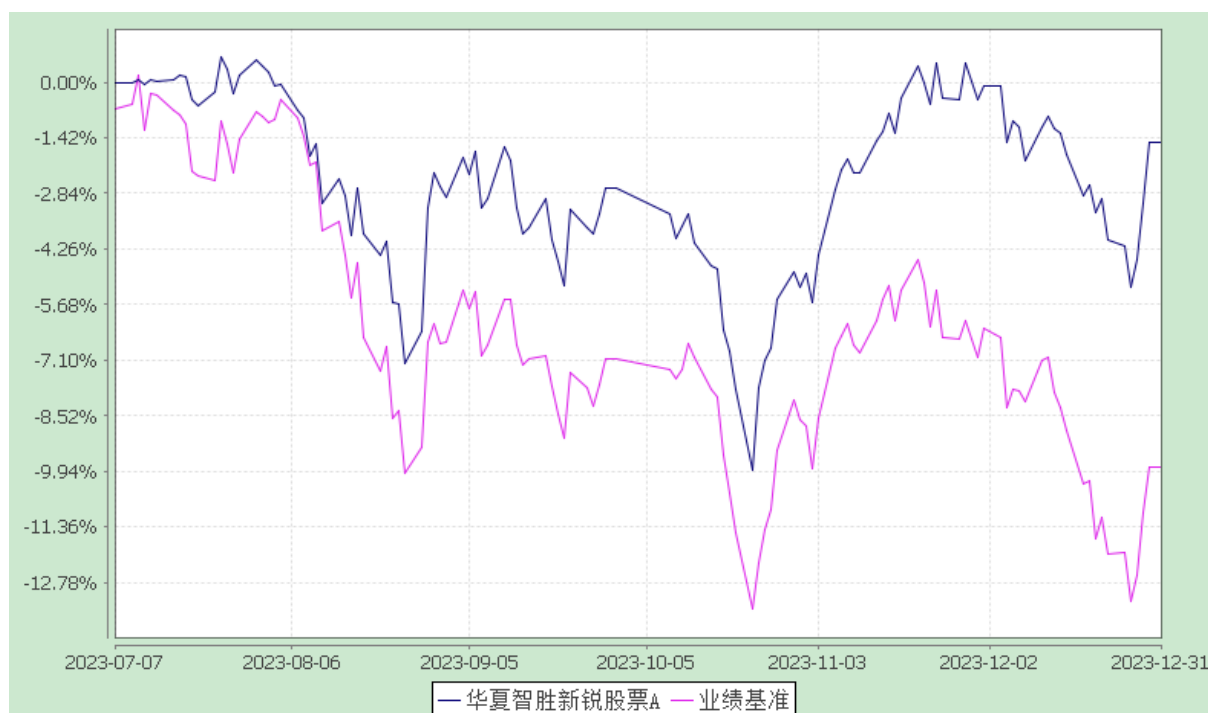
#### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

##### 华夏智胜新锐股票型证券投资基金

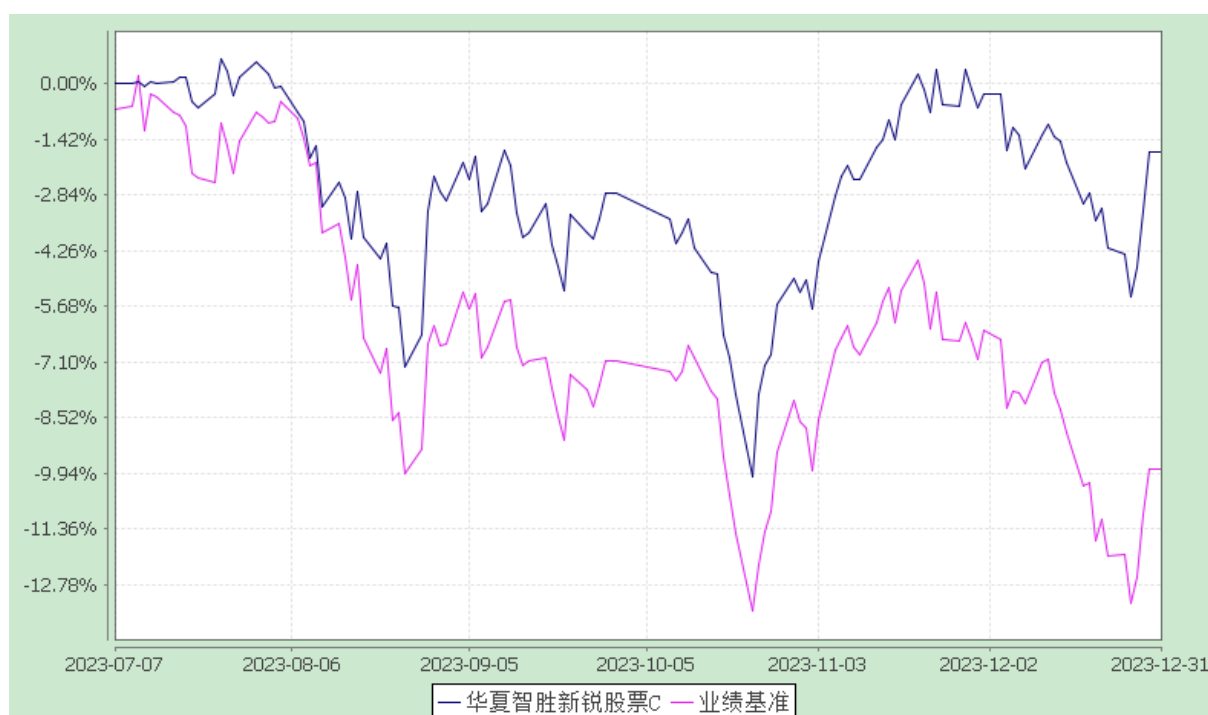
##### 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2023 年 7 月 7 日至 2023 年 12 月 31 日)

##### 华夏智胜新锐股票 A



华夏智胜新锐股票 C



注：①本基金合同于 2023 年 7 月 7 日生效。

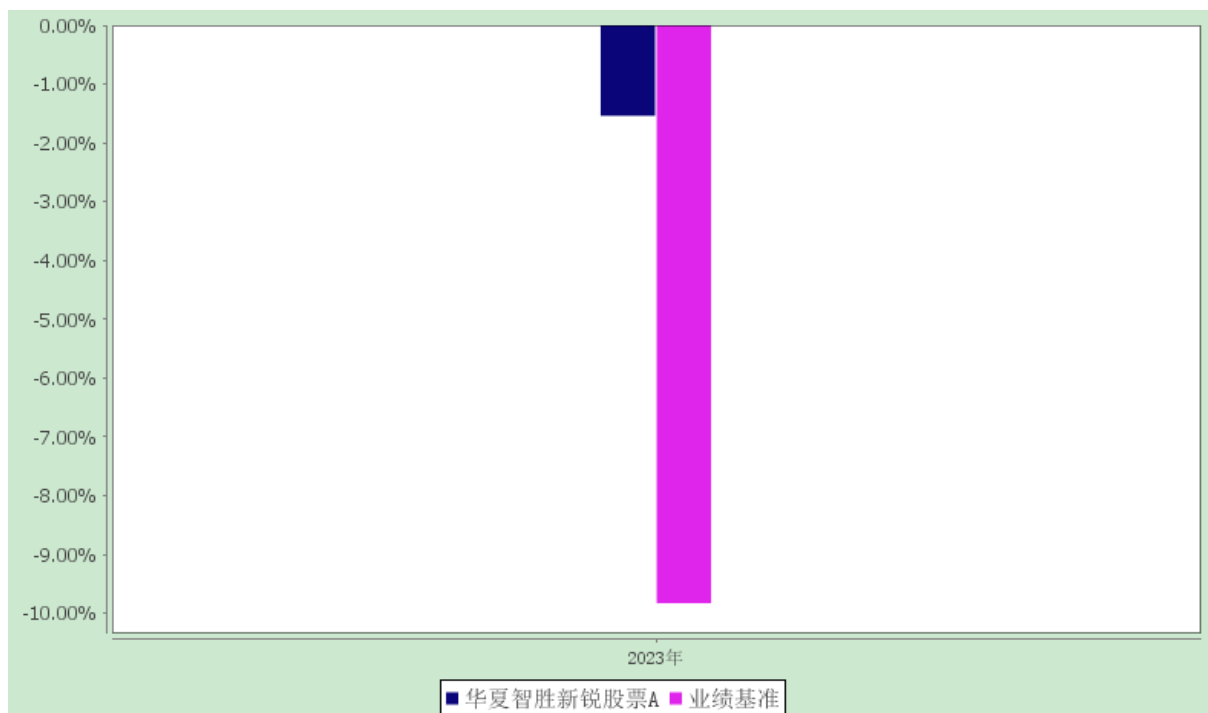
②根据本基金的基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同中投资范围、投资限制的有关约定。

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

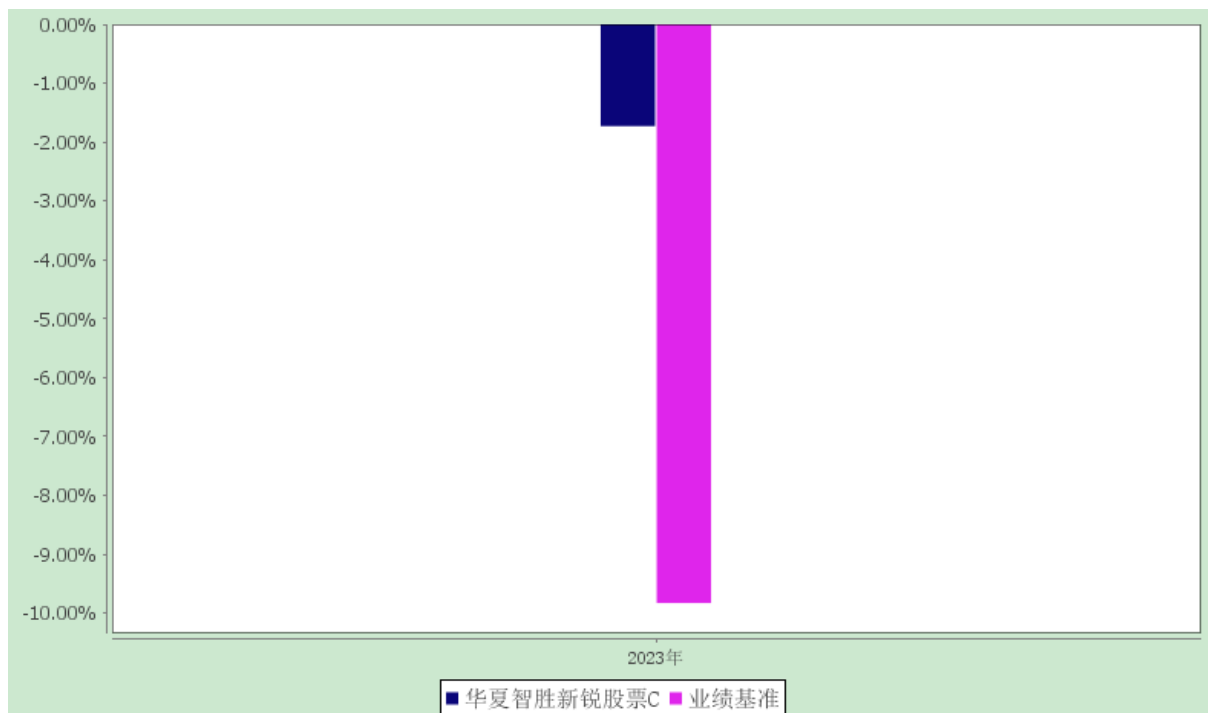
华夏智胜新锐股票型证券投资基金

自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图

华夏智胜新锐股票 A



华夏智胜新锐股票 C



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

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自基金合同生效以来无利润分配事项。



## §4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

华夏基金管理有限公司成立于 1998 年 4 月 9 日,是经中国证监会批准成立的首批全国性基金管理公司之一。公司总部设在北京,在北京、上海、深圳、成都、南京、杭州、广州、青岛、武汉及沈阳设有分公司,在香港、深圳、上海、北京设有子公司。公司是首批全国社保基金管理人、首批企业年金基金管理人、境内首批 QDII 基金管理人、境内首只 ETF 基金管理人、境内首只沪港通 ETF 基金管理人、首批内地与香港基金互认基金管理人、首批基本养老保险基金投资管理人资格、首家加入联合国责任投资原则组织的公募基金公司、首批公募 FOF 基金管理人、首批公募养老目标基金管理人、首批个人养老金基金管理人、境内首批中日互通 ETF 基金管理人、首批商品期货 ETF 基金管理人、首批公募 MOM 基金管理人、首批纳入互联互通 ETF 基金管理人、首批北交所主题基金管理人以及特定客户资产管理人、保险资金投资管理人、公募 REITs 管理人,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、华夏中证文娱传媒 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	2023-07-07	-	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。

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，华夏智胜新锐股票 A 基金份额净值为 0.9846 元，本报告期份额净值增长率为-1.54%；华夏智胜新锐股票 C 基金份额净值为 0.9827 元，本报告期份额净值增长率为-1.73%，同期业绩比较基准增长率为-9.83%。

#### 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。展望 2024 年，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。会计师事务所在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

本基金本报告期未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

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

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

## §5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对华夏智胜新锐股票型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金托管业务管理办法》等相关法律法规的规定和基金合同、托管协议的约定勤勉履行基金托管人职责，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告期内，华夏基金管理有限公司在本基金各重要方面的运作符合基金合同、托管协议的约定，本基金托管人未发现本基金在投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基

金费用开支及利润分配等方面存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对华夏基金管理有限公司编制和披露的华夏智胜新锐股票型证券投资基金 2023 年年度报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## §6 审计报告

普华永道中天审字（2024）第 21471 号

华夏智胜新锐股票型证券投资基金全体基金份额持有人：

### 6.1 审计意见

#### （一）我们审计的内容

我们审计了华夏智胜新锐股票型证券投资基金(以下简称“华夏智胜新锐股票”)的财务报表,包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表, 2023 年 7 月 7 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日止期间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新锐股票 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年 7 月 7 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日止期间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新锐股票, 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

华夏智胜新锐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新锐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新锐股票、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新锐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新锐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新锐股票不能持续经营。

(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：华夏智胜新锐股票型证券投资基金

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
<b>资产：</b>		
货币资金	7.4.7.1	89,642,984.45
结算备付金		2,069,768.62
存出保证金		1,964,457.60
交易性金融资产	7.4.7.2	1,440,221,308.32
其中：股票投资		1,439,467,258.74
基金投资		-
债券投资		754,049.58
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
其他投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
应收清算款		-
应收股利		-
应收申购款		7,400,169.44
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.5	-
资产总计		1,541,298,688.43
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-

应付清算款		-
应付赎回款		4,675,582.39
应付管理人报酬		1,281,773.78
应付托管费		256,354.78
应付销售服务费		308,472.05
应付投资顾问费		-
应交税费		1.96
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.6	100,462.25
负债合计		6,622,647.21
<b>净资产：</b>		
实收基金	7.4.7.7	1,560,564,323.22
未分配利润	7.4.7.8	-25,888,282.00
净资产合计		1,534,676,041.22
负债和净资产总计		1,541,298,688.43

注：①报告截止日 2023 年 12 月 31 日，华夏智胜新锐股票 A 基金份额净值 0.9846 元，华夏智胜新锐股票 C 基金份额净值 0.9827 元；华夏智胜新锐股票基金份额总额 1,560,564,323.22 份（其中 A 类 618,237,331.58 份，C 类 942,326,991.64 份）。

②本基金合同于 2023 年 7 月 7 日生效，本报告期自 2023 年 7 月 7 日至 2023 年 12 月 31 日。

## 7.2 利润表

会计主体：华夏智胜新锐股票型证券投资基金

本报告期：2023 年 7 月 7 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期
		2023 年 7 月 7 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		-13,175,083.76
1.利息收入		723,543.74
其中：存款利息收入	7.4.7.9	433,035.86
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		290,507.88
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,570,453.70
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-1,054,025.68
基金投资收益	7.4.7.11	-
债券投资收益	7.4.7.12	1,104,841.61
资产支持证券投资收益	7.4.7.13	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-

衍生工具收益	7.4.7.15	-973,786.24
股利收益	7.4.7.16	2,493,424.01
其他投资收益		-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-16,470,569.74
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	1,001,488.54
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>10,432,662.18</b>
1.管理人报酬		7,152,568.86
2.托管费		1,430,513.89
3.销售服务费		1,748,777.95
4.投资顾问费		-
5.利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6.信用减值损失	7.4.7.20	-
7.税金及附加		1.48
8.其他费用	7.4.7.21	100,800.00
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-23,607,745.94</b>
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-23,607,745.94</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		<b>-</b>
<b>六、综合收益总额</b>		<b>-23,607,745.94</b>

注：本基金合同于 2023 年 7 月 7 日生效，本报告期自 2023 年 7 月 7 日至 2023 年 12 月 31 日。

### 7.3 净资产变动表

会计主体：华夏智胜新锐股票型证券投资基金

本报告期：2023 年 7 月 7 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 7 月 7 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-
二、本期期初净资产	1,500,299,612.84	-	1,500,299,612.84
三、本期增减变动额 （减少以“-”号填列）	60,264,710.38	-25,888,282.00	34,376,428.38
（一）、综合收益总额	-	-23,607,745.94	-23,607,745.94
（二）、本期基金份额 交易产生的净资产变 动数（净资产减少以 “-”号填列）	60,264,710.38	-2,280,536.06	57,984,174.32

其中：1.基金申购款	626,461,400.67	-13,450,746.03	613,010,654.64
2.基金赎回款	-566,196,690.29	11,170,209.97	-555,026,480.32
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	1,560,564,323.22	-25,888,282.00	1,534,676,041.22

注：本基金合同于 2023 年 7 月 7 日生效，本报告期自 2023 年 7 月 7 日至 2023 年 12 月 31 日。报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：张佑君，主管会计工作负责人：朱威，会计机构负责人：朱威

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

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

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

本基金可根据相关法律法规和《基金合同》的约定，参与融资业务。本基金的投资组合比例为：

股票投资占基金资产的比例为 80%-95%。每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券。其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布和修订的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则(以下合称“企业会计准则”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会发布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》和中国证监会、中国基金业协会允许的如财务报表附注 7.4.4 所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本会计报表的实际编制期间为 2023 年 7 月 7 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日。

##### 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
活期存款	10,398,119.92
等于：本金	10,393,616.21
加：应计利息	4,503.71
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	79,244,864.53
等于：本金	79,239,307.83
加：应计利息	5,556.70
合计	89,642,984.45

注：其他存款为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

## 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	1,455,728,878.48	-	1,439,467,258.74	-16,261,619.74	
贵金属投资- 金交所黄金 合约	-	-	-	-	
债券	交易所 市场	754,000.00	49.58	754,049.58	-
	银行间 市场	-	-	-	-
	合计	754,000.00	49.58	754,049.58	-
资产支持证 券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	1,456,482,878.48	49.58	1,440,221,308.32	-16,261,619.74	

## 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

## 7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

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

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IM2403	中证 1000 期货 IM2403 合约	14	16,370,480.00	-208,950.00
合计	-	-	-	-208,950.00
减：可抵销期货暂 收款	-	-	-	-208,950.00
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
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	462.25
应付证券出借违约金	-

应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	100,000.00
合计	100,462.25

#### 7.4.7.7 实收基金

华夏智胜新锐股票 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年7月7日（基金合同生效日）至2023年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	511,273,756.06	511,273,756.06
本期申购	213,128,744.89	213,128,744.89
本期赎回（以“-”号填列）	-106,165,169.37	-106,165,169.37
本期末	618,237,331.58	618,237,331.58

华夏智胜新锐股票 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年7月7日（基金合同生效日）至2023年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	989,025,856.78	989,025,856.78
本期申购	413,332,655.78	413,332,655.78
本期赎回（以“-”号填列）	-460,031,520.92	-460,031,520.92
本期末	942,326,991.64	942,326,991.64

注：本基金在募集期间共募集有效净认购资金 1,499,978,350.33 元，根据本基金招募说明书的规定，认购资金在募集期间产生的利息 321,262.51 元在本基金合同生效后折算为 321,262.51 份基金份额，计入基金份额持有人账户。

#### 7.4.7.8 未分配利润

华夏智胜新锐股票 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-2,706,732.13	-6,791,976.27	-9,498,708.40
本期基金份额交易产生的变动数	284,347.08	-328,971.34	-44,624.26
其中：基金申购款	-181,626.02	-2,380,560.32	-2,562,186.34
基金赎回款	465,973.10	2,051,588.98	2,517,562.08
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-2,422,385.05	-7,120,947.61	-9,543,332.66

华夏智胜新锐股票 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-4,430,444.07	-9,678,593.47	-14,109,037.54
本期基金份额交易产生的变动数	-1,045,292.61	-1,190,619.19	-2,235,911.80
其中：基金申购款	-3,632,205.09	-7,256,354.60	-10,888,559.69
基金赎回款	2,586,912.48	6,065,735.41	8,652,647.89
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-5,475,736.68	-10,869,212.66	-16,344,949.34

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 7 月 7 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	280,268.38
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	135,805.02
结算备付金利息收入	16,962.46
其他	-
合计	433,035.86

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

7.4.7.10 股票投资收益

7.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

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

7.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 7 月 7 日（基金合同生效日）至 2023 年
----	---------------------------------------

	12 月 31 日
卖出股票成交总额	3,367,118,881.39
减：卖出股票成本总额	3,363,424,559.53
减：交易费用	4,748,347.54
买卖股票差价收入	-1,054,025.68

#### 7.4.7.11 基金投资收益

无。

#### 7.4.7.12 债券投资收益

##### 7.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年7月7日（基金合同生效日）至2023年12月31日
债券投资收益——利息收入	403.90
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	1,104,437.71
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	1,104,841.61

##### 7.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年7月7日（基金合同生效日）至2023年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	3,901,760.69
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	2,796,800.00
减：应计利息总额	366.73
减：交易费用	156.25
买卖债券差价收入	1,104,437.71

#### 7.4.7.13 资产支持证券投资收益

无。

#### 7.4.7.14 贵金属投资收益

无。

#### 7.4.7.15 衍生工具收益

##### 7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

##### 7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益



单位：人民币元

项目	本期 2023年7月7日（基金合同生效日）至2023年12月31日
股指期货投资收益	-973,786.24

#### 7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年7月7日（基金合同生效日）至2023年12月31日
股票投资产生的股利收益	2,493,424.01
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,493,424.01

#### 7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

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

#### 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年7月7日（基金合同生效日）至2023年12月31日
----	--------------------------------------

基金赎回费收入	1,001,488.54
合计	1,001,488.54

7.4.7.19 持有基金产生的费用

无。

7.4.7.20 信用减值损失

无。

7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2023年7月7日（基金合同生效日）至2023年12月31日
审计费用	40,000.00
信息披露费	60,000.00
证券出借违约金	-
其他	800.00
合计	100,800.00

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年7月7日（基金合同生效日）至2023年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
中信证券	8,182,515,092.06	100.00%

7.4.10.1.2 权证交易

无。

7.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年7月7日（基金合同生效日）至2023年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例
中信证券	3,901,760.69	100.00%

7.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

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

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7月7日（基金合同生效日）至2023年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
中信证券	2,150,936.98	100.00%	-	-

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

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7月7日（基金合同生效日）至2023年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	7,152,568.86
其中：应支付销售机构的客户维护费	2,464,710.49
应支付基金管理人的净管理费	4,687,858.37

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

②基金管理人报酬计算公式为：日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×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7月7日（基金合同生效日）至2023年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,430,513.89

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

②基金托管费计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×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7月7日（基金合同生效日）至2023年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华夏智胜新锐股票 A	华夏智胜新锐股票 C	合计
中信证券	-	655,023.93	655,023.93
广发证券	-	644,190.69	644,190.69
中信证券（华南）	-	164,297.49	164,297.49
华夏基金管理有 限公司	-	28,839.97	28,839.97
华夏财富	-	13,708.85	13,708.85
中信期货	-	2,959.96	2,959.96
中信证券（山 东）	-	2,125.06	2,125.06
合计	-	1,511,145.95	1,511,145.95

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

②基金销售服务费计算公式为：C 类日基金销售服务费 = 前一日 C 类基金资产净值 × 0.40% / 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自有资金投资本基金的情况

无。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年7月7日（基金合同生效日）至2023年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
广发证券活期存款	10,398,119.92	280,268.38
中信证券券商存款	79,244,864.53	135,805.02

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

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

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2023年7月7日（基金合同生效日）至2023年12月31日
--------------------------------------

关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
中信证券	301559	中集环科	新股发行	13,144	318,347.68
中信证券	301517	陕西华达	新股发行	1,841	49,467.67

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

7.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配事项。

7.4.12 期末（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	-
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	-
688702	盛科通信	2023-09-06	6 个月	新发流	42.66	48.18	549	23,420.34	26,450.82	-

				通受限						
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	-
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	-
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	-
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	-
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	-
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	-
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	-

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	-
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	-
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	-
301459	丰茂股份	2023-12-06	6 个月	新发流通受限	31.90	39.84	208	6,635.20	8,286.72	-
688720	艾森股份	2023-11-29	6 个月	新发流	28.03	49.84	165	4,624.95	8,223.60	-



				通受限						
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	-
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	-
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	-

301529	福赛科技	2023-08-31	6 个月	新发流通受限	36.60	37.88	182	6,661.20	6,894.16	-
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	-
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	-
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	12.05	19.92	189	2,277.45	3,764.88	-

				通受限						
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	7,540	754,000.00	754,049.58	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

无。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金管理人主要通过定性分析和定量分析的方法，估测各种金融工具风险可能产生的损失。本基金管理人从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重性；从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用的金融工具特征，通过特定的风险量化指标、模型和日常的量化报告，参考压力测试结果，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时对各种风险进行监督、检

查和评估，并制定相应决策，将风险控制在预期可承受的范围内。

#### 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	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	1,439,467,258.74	93.80
交易性金融资产—基金投资	-	-
交易性金融资产—债券投资	754,049.58	0.05
交易性金融资产—贵金属投资	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-
其他	-	-
合计	1,440,221,308.32	93.85

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

②由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

##### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）
		本期末 2023 年 12 月 31 日
	-5%	-58,292,565.35
	+5%	58,292,565.35

#### 7.4.14 公允价值

##### 7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

#### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

##### 7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	1,438,205,483.02
第二层次	1,652,791.60
第三层次	363,033.70
合计	1,440,221,308.32

##### 7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

##### 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

###### 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 7 月 7 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	286,305.70	286,305.70
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	76,728.00	76,728.00
其中：计入损益的利得或损失	-	76,728.00	76,728.00
计入其他综合	-	-	-

收益的利得或损失 (若有)			
期末余额	-	363,033.70	363,033.70
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	76,728.00	76,728.00

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

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	363,033.70	平均价格亚式期权模型	预期年化波动率	0.2716-2.1988	负相关

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

截至 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	1,439,467,258.74	93.39
	其中：股票	1,439,467,258.74	93.39
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	754,049.58	0.05
	其中：债券	754,049.58	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	91,712,753.07	5.95
8	其他各项资产	9,364,627.04	0.61
9	合计	1,541,298,688.43	100.00

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	40,701,187.00	2.65
C	制造业	977,348,414.55	63.68
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	31,697,045.00	2.07
E	建筑业	31,038,613.00	2.02
F	批发和零售业	27,804,861.00	1.81
G	交通运输、仓储和邮政业	21,677,334.21	1.41
H	住宿和餐饮业	622,152.00	0.04
I	信息传输、软件和信息技术服务业	172,731,951.62	11.26
J	金融业	44,139,534.00	2.88
K	房地产业	20,209,397.08	1.32
L	租赁和商务服务业	21,466,676.00	1.40
M	科学研究和技术服务业	22,296,114.28	1.45
N	水利、环境和公共设施管理业	10,134,978.00	0.66
O	居民服务、修理和其他服务业	25,540.00	0.00
P	教育	5,374,907.00	0.35
Q	卫生和社会工作	319,564.00	0.02
R	文化、体育和娱乐业	11,626,663.00	0.76
S	综合	252,327.00	0.02
	合计	1,439,467,258.74	93.80

### 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	603530	神马电力	390,400	8,096,896.00	0.53
2	688100	威胜信息	275,457	7,966,216.44	0.52
3	600312	平高电气	614,060	7,792,421.40	0.51
4	002724	海洋王	946,500	7,780,230.00	0.51
5	300768	迪普科技	520,400	7,691,512.00	0.50

6	600007	中国国贸	385,916	7,479,052.08	0.49
7	601138	工业富联	485,400	7,339,248.00	0.48
8	688183	生益电子	637,500	7,248,375.00	0.47
9	002247	聚力文化	3,091,100	7,233,174.00	0.47
10	000612	焦作万方	1,250,840	7,192,330.00	0.47
11	002811	郑中设计	729,900	7,189,515.00	0.47
12	002027	分众传媒	1,118,500	7,068,920.00	0.46
13	603259	药明康德	96,100	6,992,236.00	0.46
14	000338	潍柴动力	510,700	6,971,055.00	0.45
15	002111	威海广泰	749,700	6,792,282.00	0.44
16	002774	快意电梯	813,200	6,749,560.00	0.44
17	000725	京东方 A	1,717,700	6,699,030.00	0.44
18	002153	石基信息	673,240	6,557,357.60	0.43
19	600037	歌华有线	844,100	6,524,893.00	0.43
20	002879	长缆科技	402,340	6,445,486.80	0.42
21	601857	中国石油	910,200	6,426,012.00	0.42
22	601318	中国平安	159,200	6,415,760.00	0.42
23	300550	和仁科技	426,500	6,393,235.00	0.42
24	002128	电投能源	445,600	6,358,712.00	0.41
25	002410	广联达	370,120	6,343,856.80	0.41
26	000953	河化股份	1,155,200	6,318,944.00	0.41
27	300155	安居宝	1,061,100	6,281,712.00	0.41
28	300750	宁德时代	38,400	6,269,184.00	0.41
29	601398	工商银行	1,304,000	6,233,120.00	0.41
30	601288	农业银行	1,702,100	6,195,644.00	0.40
31	600261	阳光照明	1,891,700	6,185,859.00	0.40
32	002381	双箭股份	812,900	6,161,782.00	0.40
33	300069	金利华电	381,800	6,146,980.00	0.40
34	002296	辉煌科技	742,000	6,121,500.00	0.40
35	688585	上纬新材	719,900	6,097,553.00	0.40
36	002923	润都股份	490,882	6,057,483.88	0.39
37	300271	华宇软件	733,400	6,006,546.00	0.39
38	601811	新华文轩	437,900	5,981,714.00	0.39
39	000951	中国重汽	444,400	5,937,184.00	0.39
40	002212	天融信	602,500	5,892,450.00	0.38
41	600828	茂业商业	1,609,500	5,874,675.00	0.38
42	601728	中国电信	1,085,400	5,872,014.00	0.38
43	601137	博威合金	373,200	5,795,796.00	0.38
44	301176	逸豪新材	345,290	5,790,513.30	0.38
45	002109	兴化股份	1,195,800	5,668,092.00	0.37
46	000061	农产品	864,600	5,593,962.00	0.36
47	600519	贵州茅台	3,200	5,523,200.00	0.36
48	605066	天正电气	590,400	5,419,872.00	0.35
49	603377	东方时尚	1,276,700	5,374,907.00	0.35

50	601018	宁波港	1,491,855	5,311,003.80	0.35
51	002715	登云股份	320,785	5,206,340.55	0.34
52	688109	品茗科技	184,700	5,202,999.00	0.34
53	688235	百济神州	36,530	5,079,131.20	0.33
54	688681	科汇股份	322,800	4,987,260.00	0.32
55	002851	麦格米特	201,700	4,961,820.00	0.32
56	002594	比亚迪	24,940	4,938,120.00	0.32
57	300323	华灿光电	670,400	4,907,328.00	0.32
58	600488	津药药业	986,200	4,832,380.00	0.31
59	601567	三星医疗	233,000	4,776,500.00	0.31
60	688578	艾力斯	109,700	4,570,102.00	0.30
61	600612	老凤祥	64,414	4,444,566.00	0.29
62	002171	楚江新材	589,800	4,411,704.00	0.29
63	000063	中兴通讯	165,500	4,382,440.00	0.29
64	603758	秦安股份	380,800	4,356,352.00	0.28
65	002718	友邦吊顶	252,600	4,296,726.00	0.28
66	002215	诺普信	516,900	4,269,594.00	0.28
67	300286	安科瑞	163,900	4,249,927.00	0.28
68	600182	S 佳通	283,100	4,195,542.00	0.27
69	688296	和达科技	231,812	4,165,661.64	0.27
70	000503	国新健康	315,900	4,163,562.00	0.27
71	601333	广深铁路	1,607,100	4,162,389.00	0.27
72	000928	中钢国际	710,900	4,144,547.00	0.27
73	603680	今创集团	436,346	4,123,469.70	0.27
74	603328	依顿电子	504,100	4,108,415.00	0.27
75	601019	山东出版	434,500	4,075,610.00	0.27
76	601888	中国中免	48,600	4,067,334.00	0.27
77	603989	艾华集团	186,220	4,007,454.40	0.26
78	600986	浙文互联	732,500	3,999,450.00	0.26
79	688232	新点软件	110,200	3,989,240.00	0.26
80	000062	深圳华强	353,500	3,983,945.00	0.26
81	000333	美的集团	72,200	3,944,286.00	0.26
82	603669	灵康药业	708,944	3,920,460.32	0.26
83	600562	国睿科技	282,985	3,916,512.40	0.26
84	601985	中国核电	518,900	3,891,750.00	0.25
85	688136	科兴制药	191,200	3,871,800.00	0.25
86	300386	飞天诚信	357,100	3,831,683.00	0.25
87	002252	上海莱士	473,000	3,784,000.00	0.25
88	300843	胜蓝股份	164,600	3,782,508.00	0.25
89	000100	TCL 科技	879,100	3,780,130.00	0.25
90	000990	诚志股份	460,400	3,779,884.00	0.25
91	002130	沃尔核材	499,002	3,767,465.10	0.25
92	688216	气派科技	135,100	3,738,217.00	0.24
93	688244	永信至诚	66,964	3,735,921.56	0.24

94	688315	诺禾致源	159,800	3,729,732.00	0.24
95	688737	中自科技	112,000	3,707,200.00	0.24
96	300893	松原股份	126,500	3,697,595.00	0.24
97	688055	龙腾光电	757,000	3,694,160.00	0.24
98	688308	欧科亿	132,400	3,693,960.00	0.24
99	688768	容知日新	100,200	3,688,362.00	0.24
100	603303	得邦照明	286,700	3,684,095.00	0.24
101	688138	清溢光电	162,000	3,664,440.00	0.24
102	600941	中国移动	36,700	3,650,916.00	0.24
103	300215	电科院	689,600	3,647,984.00	0.24
104	688625	呈和科技	93,012	3,647,930.64	0.24
105	300411	金盾股份	520,200	3,636,198.00	0.24
106	300412	迦南科技	637,800	3,629,082.00	0.24
107	688622	禾信仪器	100,800	3,623,760.00	0.24
108	600028	中国石化	649,400	3,623,652.00	0.24
109	000625	长安汽车	215,300	3,623,499.00	0.24
110	688489	三未信安	77,000	3,620,540.00	0.24
111	000858	五粮液	25,800	3,619,998.00	0.24
112	000997	新大陆	184,300	3,614,123.00	0.24
113	603659	璞泰来	172,548	3,611,429.64	0.24
114	300150	世纪瑞尔	744,200	3,609,370.00	0.24
115	300440	运达科技	483,900	3,605,055.00	0.23
116	688325	赛微微电	91,915	3,602,148.85	0.23
117	688661	和林微纳	78,600	3,601,452.00	0.23
118	300866	安克创新	40,500	3,588,300.00	0.23
119	605166	聚合顺	361,700	3,588,064.00	0.23
120	688163	赛伦生物	179,386	3,585,926.14	0.23
121	002950	奥美医疗	377,600	3,579,648.00	0.23
122	603980	吉华集团	765,200	3,573,484.00	0.23
123	600746	江苏索普	487,500	3,568,500.00	0.23
124	601601	中国太保	149,800	3,562,244.00	0.23
125	688669	聚石化学	190,000	3,560,600.00	0.23
126	300321	同大股份	183,800	3,556,530.00	0.23
127	603277	银都股份	132,300	3,548,286.00	0.23
128	603192	汇得科技	180,560	3,548,004.00	0.23
129	603823	百合花	360,530	3,547,615.20	0.23
130	603321	梅轮电梯	415,300	3,546,662.00	0.23
131	688128	中国电研	172,800	3,545,856.00	0.23
132	600161	天坛生物	114,501	3,542,660.94	0.23
133	688626	翔宇医疗	66,469	3,542,133.01	0.23
134	603283	赛腾股份	48,800	3,540,928.00	0.23
135	603900	莱绅通灵	529,700	3,538,396.00	0.23
136	301037	保立佳	177,440	3,536,379.20	0.23
137	002900	哈三联	258,900	3,533,985.00	0.23

138	300931	通用电梯	418,300	3,530,452.00	0.23
139	300719	安达维尔	264,700	3,528,451.00	0.23
140	600383	金地集团	808,500	3,525,060.00	0.23
141	000020	深华发 A	272,200	3,524,990.00	0.23
142	601211	国泰君安	236,300	3,516,144.00	0.23
143	600236	桂冠电力	634,300	3,514,022.00	0.23
144	300599	雄塑科技	437,800	3,511,156.00	0.23
145	002271	东方雨虹	182,200	3,498,240.00	0.23
146	600900	长江电力	149,800	3,496,332.00	0.23
147	002925	盈趣科技	179,400	3,492,918.00	0.23
148	003816	中国广核	1,122,700	3,491,597.00	0.23
149	300030	阳普医疗	450,100	3,488,275.00	0.23
150	600816	建元信托	1,212,500	3,479,875.00	0.23
151	601088	中国神华	111,000	3,479,850.00	0.23
152	002551	尚荣医疗	856,400	3,476,984.00	0.23
153	000601	韶能股份	811,700	3,474,076.00	0.23
154	300543	朗科智能	318,000	3,472,560.00	0.23
155	301283	聚胶股份	105,600	3,472,128.00	0.23
156	688045	必易微	81,000	3,469,230.00	0.23
157	002582	好想你	451,500	3,463,005.00	0.23
158	002152	广电运通	282,200	3,459,772.00	0.23
159	688030	山石网科	172,600	3,455,452.00	0.23
160	002461	珠江啤酒	435,800	3,442,820.00	0.22
161	688020	方邦股份	71,000	3,442,080.00	0.22
162	605158	华达新材	452,750	3,440,900.00	0.22
163	300800	力合科技	251,700	3,440,739.00	0.22
164	300641	正丹股份	609,300	3,436,452.00	0.22
165	600795	国电电力	825,900	3,435,744.00	0.22
166	002650	加加食品	841,700	3,434,136.00	0.22
167	600737	中粮糖业	415,400	3,422,896.00	0.22
168	300259	新天科技	942,400	3,420,912.00	0.22
169	601628	中国人寿	120,400	3,413,340.00	0.22
170	002399	海普瑞	290,860	3,411,787.80	0.22
171	002636	金安国纪	382,300	3,406,293.00	0.22
172	000425	徐工机械	622,700	3,399,942.00	0.22
173	601898	中煤能源	350,300	3,394,407.00	0.22
174	002376	新北洋	445,400	3,393,948.00	0.22
175	600552	凯盛科技	254,500	3,392,485.00	0.22
176	600025	华能水电	391,900	3,382,097.00	0.22
177	601609	金田股份	497,900	3,370,783.00	0.22
178	300698	万马科技	92,200	3,365,300.00	0.22
179	002188	中天服务	510,800	3,361,064.00	0.22
180	603898	好莱客	305,200	3,348,044.00	0.22
181	300717	华信新材	198,900	3,339,531.00	0.22

182	600696	岩石股份	185,600	3,338,944.00	0.22
183	603928	兴业股份	249,300	3,333,141.00	0.22
184	605598	上海港湾	124,300	3,326,268.00	0.22
185	600231	凌钢股份	1,544,010	3,319,621.50	0.22
186	301046	能辉科技	122,300	3,316,776.00	0.22
187	002996	顺博合金	303,700	3,316,404.00	0.22
188	601231	环旭电子	218,900	3,307,579.00	0.22
189	002803	吉宏股份	160,700	3,303,992.00	0.22
190	688209	英集芯	184,700	3,298,742.00	0.21
191	002412	汉森制药	485,500	3,291,690.00	0.21
192	600637	东方明珠	434,500	3,267,440.00	0.21
193	301200	大族数控	86,500	3,267,105.00	0.21
194	300078	思创医惠	745,100	3,263,538.00	0.21
195	600066	宇通客车	245,300	3,250,225.00	0.21
196	600989	宝丰能源	219,480	3,241,719.60	0.21
197	603993	洛阳钼业	621,800	3,233,360.00	0.21
198	688697	纽威数控	171,700	3,233,111.00	0.21
199	000069	华侨城 A	1,038,600	3,230,046.00	0.21
200	600050	中国联通	736,200	3,224,556.00	0.21
201	300670	大烨智能	410,600	3,214,998.00	0.21
202	000761	本钢板材	899,400	3,210,858.00	0.21
203	600959	江苏有线	1,021,400	3,207,196.00	0.21
204	688616	西力科技	235,116	3,206,982.24	0.21
205	688619	罗普特	227,302	3,195,866.12	0.21
206	600080	金花股份	428,200	3,190,090.00	0.21
207	603421	鼎信通讯	339,200	3,188,480.00	0.21
208	002730	电光科技	336,000	3,185,280.00	0.21
209	603978	深圳新星	192,100	3,185,018.00	0.21
210	600750	江中药业	151,900	3,171,672.00	0.21
211	600938	中国海油	151,200	3,170,664.00	0.21
212	688660	电气风电	616,700	3,169,838.00	0.21
213	688683	莱尔科技	123,800	3,166,804.00	0.21
214	000559	万向钱潮	609,600	3,163,824.00	0.21
215	603828	柯利达	826,600	3,157,612.00	0.21
216	301033	迈普医学	72,400	3,152,296.00	0.21
217	000019	深粮控股	417,500	3,147,950.00	0.21
218	002884	凌霄泵业	181,300	3,147,368.00	0.21
219	603508	思维列控	199,500	3,132,150.00	0.20
220	603992	松霖科技	172,500	3,129,150.00	0.20
221	300381	溢多利	421,200	3,104,244.00	0.20
222	600650	锦江在线	323,700	3,097,809.00	0.20
223	688639	华恒生物	24,600	3,097,140.00	0.20
224	600594	益佰制药	543,500	3,092,515.00	0.20
225	603766	隆鑫通用	597,900	3,085,164.00	0.20

226	603337	杰克股份	142,700	3,082,320.00	0.20
227	002277	友阿股份	764,800	3,082,144.00	0.20
228	601827	三峰环境	408,600	3,068,586.00	0.20
229	601390	中国中铁	539,700	3,065,496.00	0.20
230	688231	隆达股份	139,085	3,061,260.85	0.20
231	000590	启迪药业	341,500	3,059,840.00	0.20
232	603590	康辰药业	79,900	3,042,592.00	0.20
233	603217	元利科技	166,408	3,035,281.92	0.20
234	688225	亚信安全	165,500	3,035,270.00	0.20
235	300762	上海瀚讯	200,543	3,024,188.44	0.20
236	600718	东软集团	326,600	3,021,050.00	0.20
237	000930	中粮科技	454,600	3,018,544.00	0.20
238	688360	德马科技	149,990	3,010,299.30	0.20
239	002633	申科股份	256,600	2,999,654.00	0.20
240	600935	华塑股份	888,600	2,994,582.00	0.20
241	600370	三房巷	1,236,500	2,992,330.00	0.19
242	000738	航发控制	150,200	2,988,980.00	0.19
243	301179	泽宇智能	115,100	2,986,845.00	0.19
244	605060	联德股份	159,000	2,973,300.00	0.19
245	603511	爱慕股份	190,500	2,948,940.00	0.19
246	300318	博晖创新	469,600	2,930,304.00	0.19
247	301391	卡莱特	25,500	2,919,240.00	0.19
248	603166	福达股份	422,000	2,916,020.00	0.19
249	603333	尚纬股份	509,400	2,908,674.00	0.19
250	603602	纵横通信	197,300	2,908,202.00	0.19
251	600660	福耀玻璃	77,400	2,893,986.00	0.19
252	603132	金徽股份	211,300	2,890,584.00	0.19
253	000531	穗恒运 A	429,400	2,872,686.00	0.19
254	600688	上海石化	999,700	2,859,142.00	0.19
255	688078	龙软科技	70,365	2,837,116.80	0.18
256	300535	达威股份	161,100	2,820,861.00	0.18
257	002105	信隆健康	432,500	2,802,600.00	0.18
258	002753	永东股份	339,300	2,799,225.00	0.18
259	688329	艾隆科技	112,288	2,791,479.68	0.18
260	688350	富淼科技	168,700	2,788,611.00	0.18
261	688127	蓝特光学	118,500	2,759,865.00	0.18
262	600851	海欣股份	400,400	2,750,748.00	0.18
263	002946	新乳业	239,200	2,746,016.00	0.18
264	000952	广济药业	343,400	2,743,766.00	0.18
265	600971	恒源煤电	246,000	2,742,900.00	0.18
266	688511	天微电子	87,142	2,742,358.74	0.18
267	600252	中恒集团	1,077,700	2,705,027.00	0.18
268	300243	瑞丰高材	275,400	2,690,658.00	0.18
269	600276	恒瑞医药	59,400	2,686,662.00	0.18

270	002498	汉缆股份	671,200	2,684,800.00	0.17
271	600299	安迪苏	335,500	2,684,000.00	0.17
272	000039	中集集团	350,000	2,677,500.00	0.17
273	688098	申联生物	357,700	2,675,596.00	0.17
274	000863	三湘印象	674,400	2,663,880.00	0.17
275	300769	德方纳米	43,620	2,662,128.60	0.17
276	002436	兴森科技	178,800	2,633,724.00	0.17
277	600497	驰宏锌锗	520,600	2,629,030.00	0.17
278	002131	利欧股份	1,152,800	2,628,384.00	0.17
279	001218	丽臣实业	120,580	2,605,733.80	0.17
280	603079	圣达生物	178,600	2,602,202.00	0.17
281	300289	利德曼	422,000	2,595,300.00	0.17
282	301061	匠心家居	52,100	2,591,975.00	0.17
283	601068	中铝国际	560,600	2,589,972.00	0.17
284	688105	诺唯赞	79,900	2,558,398.00	0.17
285	688132	邦彦技术	119,300	2,556,599.00	0.17
286	603739	蔚蓝生物	167,900	2,555,438.00	0.17
287	603093	南华期货	211,500	2,538,000.00	0.17
288	300281	金明精机	423,500	2,536,765.00	0.17
289	688689	银河微电	90,843	2,531,794.41	0.16
290	002555	三七互娱	134,000	2,520,540.00	0.16
291	002114	罗平锌电	335,100	2,506,548.00	0.16
292	601939	建设银行	384,700	2,504,397.00	0.16
293	300122	智飞生物	40,800	2,493,288.00	0.16
294	002003	伟星股份	229,000	2,484,650.00	0.16
295	300981	中红医疗	152,500	2,443,050.00	0.16
296	002437	誉衡药业	972,600	2,441,226.00	0.16
297	002415	海康威视	70,300	2,440,816.00	0.16
298	688111	金山办公	7,686	2,430,313.20	0.16
299	300551	古鳌科技	139,600	2,429,040.00	0.16
300	002287	奇正藏药	107,235	2,411,715.15	0.16
301	002007	华兰生物	108,600	2,403,318.00	0.16
302	002706	良信股份	271,400	2,396,462.00	0.16
303	605288	凯迪股份	50,600	2,384,272.00	0.16
304	601158	重庆水务	419,900	2,380,833.00	0.16
305	301123	奕东电子	101,356	2,377,811.76	0.15
306	688067	爱威科技	99,600	2,371,476.00	0.15
307	600558	大西洋	581,600	2,367,112.00	0.15
308	603937	丽岛新材	186,400	2,361,688.00	0.15
309	603790	雅运股份	164,500	2,304,645.00	0.15
310	300956	英力股份	123,300	2,297,079.00	0.15
311	002695	煌上煌	216,300	2,264,661.00	0.15
312	000035	中国天楹	457,300	2,259,062.00	0.15
313	301126	达嘉维康	172,200	2,243,766.00	0.15



314	000404	长虹华意	379,600	2,235,844.00	0.15
315	688161	威高骨科	53,794	2,229,761.30	0.15
316	603886	元祖股份	122,200	2,227,706.00	0.15
317	300851	交大思诺	70,700	2,203,719.00	0.14
318	601668	中国建筑	456,900	2,197,689.00	0.14
319	300752	隆利科技	120,250	2,184,942.50	0.14
320	600796	钱江生化	371,700	2,174,445.00	0.14
321	300969	恒帅股份	23,900	2,147,893.00	0.14
322	601766	中国中车	404,900	2,129,774.00	0.14
323	688568	中科星图	43,300	2,124,298.00	0.14
324	601616	广电电气	583,800	2,119,194.00	0.14
325	300464	星徽股份	348,600	2,098,572.00	0.14
326	688607	康众医疗	102,672	2,092,455.36	0.14
327	300009	安科生物	203,800	2,082,836.00	0.14
328	603813	原尚股份	127,100	2,052,665.00	0.13
329	002641	公元股份	407,500	2,049,725.00	0.13
330	300103	达刚控股	321,600	2,042,160.00	0.13
331	603515	欧普照明	116,000	2,016,080.00	0.13
332	601633	长城汽车	79,000	1,992,380.00	0.13
333	002801	微光股份	90,600	1,970,550.00	0.13
334	600797	浙大网新	300,000	1,968,000.00	0.13
335	002643	万润股份	117,400	1,947,666.00	0.13
336	688981	中芯国际	35,800	1,898,116.00	0.12
337	000513	丽珠集团	54,200	1,897,542.00	0.12
338	300642	透景生命	105,200	1,856,780.00	0.12
339	300509	新美星	256,600	1,855,218.00	0.12
340	000823	超声电子	188,000	1,799,160.00	0.12
341	000589	贵州轮胎	293,300	1,794,996.00	0.12
342	688569	铁科轨道	64,806	1,789,293.66	0.12
343	000528	柳工	260,400	1,755,096.00	0.11
344	600279	重庆港	388,200	1,727,490.00	0.11
345	600990	四创电子	85,520	1,707,834.40	0.11
346	600741	华域汽车	104,200	1,696,376.00	0.11
347	000702	正虹科技	267,900	1,679,733.00	0.11
348	002138	顺络电子	60,000	1,620,600.00	0.11
349	601688	华泰证券	112,300	1,566,585.00	0.10
350	002295	精艺股份	189,500	1,548,215.00	0.10
351	688655	迅捷兴	99,951	1,509,260.10	0.10
352	600819	耀皮玻璃	289,500	1,473,555.00	0.10
353	300686	智动力	139,100	1,471,678.00	0.10
354	300433	蓝思科技	109,100	1,440,120.00	0.09
355	600388	龙净环保	112,000	1,432,480.00	0.09
356	601328	交通银行	246,600	1,415,484.00	0.09
357	688201	信安世纪	71,500	1,407,120.00	0.09

358	002254	泰和新材	93,900	1,404,744.00	0.09
359	301087	可孚医疗	37,000	1,402,300.00	0.09
360	688181	八亿时空	51,400	1,387,800.00	0.09
361	000627	天茂集团	486,700	1,382,228.00	0.09
362	300932	三友联众	84,900	1,382,172.00	0.09
363	605303	园林股份	112,800	1,376,160.00	0.09
364	301102	兆讯传媒	71,700	1,372,338.00	0.09
365	000969	安泰科技	151,600	1,362,884.00	0.09
366	600184	光电股份	117,100	1,338,453.00	0.09
367	601366	利群股份	243,300	1,328,418.00	0.09
368	002891	中宠股份	50,100	1,320,135.00	0.09
369	300205	天喻信息	120,400	1,307,544.00	0.09
370	688707	振华新材	63,300	1,297,650.00	0.08
371	300447	全信股份	88,800	1,287,600.00	0.08
372	300254	仟源医药	132,600	1,276,938.00	0.08
373	002016	世荣兆业	200,400	1,260,516.00	0.08
374	688057	金达莱	88,700	1,255,992.00	0.08
375	300787	海能实业	73,000	1,227,860.00	0.08
376	002516	旷达科技	248,800	1,226,584.00	0.08
377	603801	志邦家居	72,500	1,215,825.00	0.08
378	002620	瑞和股份	220,300	1,185,214.00	0.08
379	603551	奥普家居	111,600	1,181,844.00	0.08
380	301380	挖金客	24,900	1,179,264.00	0.08
381	600582	天地科技	215,700	1,173,408.00	0.08
382	000030	富奥股份	218,600	1,167,324.00	0.08
383	601702	华峰铝业	65,000	1,166,750.00	0.08
384	301162	国能日新	22,200	1,151,736.00	0.08
385	600548	深高速	128,000	1,150,720.00	0.07
386	301107	瑜欣电子	35,400	1,135,986.00	0.07
387	603216	梦天家居	86,200	1,130,944.00	0.07
388	688601	力芯微	21,500	1,126,385.00	0.07
389	688505	复旦张江	121,600	1,122,368.00	0.07
390	001202	炬申股份	63,700	1,119,209.00	0.07
391	300887	谱尼测试	94,616	1,117,414.96	0.07
392	000050	深天马 A	104,500	1,112,925.00	0.07
393	688670	金迪克	39,000	1,109,940.00	0.07
394	603444	吉比特	4,500	1,103,040.00	0.07
395	600082	海泰发展	318,900	1,100,205.00	0.07
396	601899	紫金矿业	87,900	1,095,234.00	0.07
397	002078	太阳纸业	89,600	1,090,432.00	0.07
398	000060	中金岭南	252,300	1,089,936.00	0.07
399	300753	爱朋医疗	62,400	1,071,408.00	0.07
400	300626	华瑞股份	98,300	1,066,555.00	0.07
401	002540	亚太科技	160,700	1,062,227.00	0.07

402	003041	真爱美家	63,600	1,058,940.00	0.07
403	688026	洁特生物	61,200	1,055,088.00	0.07
404	000933	神火股份	62,700	1,053,360.00	0.07
405	688355	明志科技	52,900	1,052,710.00	0.07
406	300407	凯发电气	110,400	1,042,176.00	0.07
407	300126	锐奇股份	144,200	1,031,030.00	0.07
408	605058	澳弘电子	44,500	1,019,495.00	0.07
409	002588	史丹利	159,600	1,018,248.00	0.07
410	301043	绿岛风	31,000	1,014,630.00	0.07
411	688093	世华科技	55,700	1,014,297.00	0.07
412	601700	风范股份	194,500	974,445.00	0.06
413	300497	富祥药业	103,900	972,504.00	0.06
414	000598	兴蓉环境	169,600	965,024.00	0.06
415	000534	万泽股份	73,500	962,115.00	0.06
416	600778	友好集团	148,000	925,000.00	0.06
417	002578	闽发铝业	204,900	917,952.00	0.06
418	002449	国星光电	95,300	902,491.00	0.06
419	600841	动力新科	152,200	899,502.00	0.06
420	688717	艾罗能源	16,147	898,742.02	0.06
421	000560	我爱我家	393,900	886,275.00	0.06
422	603737	三棵树	18,200	866,502.00	0.06
423	688253	英诺特	34,400	860,344.00	0.06
424	002394	联发股份	101,600	844,296.00	0.06
425	688611	杭州柯林	25,300	829,334.00	0.05
426	603700	宁水集团	57,600	821,952.00	0.05
427	600084	中信尼雅	104,000	817,440.00	0.05
428	688395	正弦电气	35,300	811,547.00	0.05
429	688788	科思科技	20,900	808,412.00	0.05
430	002709	天赐材料	31,700	795,036.00	0.05
431	603897	长城科技	38,400	786,432.00	0.05
432	002367	康力电梯	104,100	782,832.00	0.05
433	603580	艾艾精工	52,500	781,725.00	0.05
434	603927	中科软	25,900	776,482.00	0.05
435	000902	新洋丰	67,300	766,547.00	0.05
436	603221	爱丽家居	77,100	766,374.00	0.05
437	600020	中原高速	206,300	759,184.00	0.05
438	300705	九典制药	22,600	750,998.00	0.05
439	600885	宏发股份	27,000	746,280.00	0.05
440	600126	杭钢股份	139,900	745,667.00	0.05
441	688168	安博通	20,500	741,280.00	0.05
442	603920	世运电路	40,400	738,512.00	0.05
443	603041	美思德	54,100	728,186.00	0.05
444	002334	英威腾	83,400	728,082.00	0.05
445	300994	久祺股份	48,100	707,070.00	0.05

446	002249	大洋电机	141,300	702,261.00	0.05
447	300621	维业股份	59,400	682,506.00	0.04
448	300117	嘉寓股份	234,400	679,760.00	0.04
449	601107	四川成渝	153,200	672,548.00	0.04
450	603730	岱美股份	46,400	672,336.00	0.04
451	600285	羚锐制药	39,000	667,290.00	0.04
452	600901	江苏金租	137,000	663,080.00	0.04
453	600363	联创光电	19,500	663,000.00	0.04
454	688793	倍轻松	19,600	659,540.00	0.04
455	688393	安必平	26,400	659,208.00	0.04
456	300239	东宝生物	104,700	652,281.00	0.04
457	000430	张家界	99,500	647,745.00	0.04
458	688499	利元亨	16,933	644,808.64	0.04
459	002035	华帝股份	103,400	642,114.00	0.04
460	600867	通化东宝	58,400	632,472.00	0.04
461	300051	珩升科技	55,600	628,836.00	0.04
462	688314	康拓医疗	19,100	628,581.00	0.04
463	301182	凯旺科技	26,600	621,908.00	0.04
464	600183	生益科技	33,900	620,709.00	0.04
465	002377	国创高新	243,400	615,802.00	0.04
466	600812	华北制药	107,800	614,460.00	0.04
467	301127	天源环保	55,100	605,549.00	0.04
468	002318	久立特材	30,200	600,376.00	0.04
469	600606	绿地控股	260,200	598,460.00	0.04
470	300760	迈瑞医疗	2,000	581,200.00	0.04
471	600936	广西广电	157,400	577,658.00	0.04
472	603258	电魂网络	25,100	576,798.00	0.04
473	603039	泛微网络	12,100	567,490.00	0.04
474	002910	庄园牧场	51,600	564,504.00	0.04
475	603839	安正时尚	67,200	557,760.00	0.04
476	603365	水星家纺	38,600	555,068.00	0.04
477	002283	天润工业	93,700	548,145.00	0.04
478	603096	新经典	26,900	529,392.00	0.03
479	600727	鲁北化工	79,400	522,452.00	0.03
480	002365	永安药业	53,300	521,274.00	0.03
481	300739	明阳电路	33,900	519,009.00	0.03
482	000630	铜陵有色	157,100	515,288.00	0.03
483	000157	中联重科	78,900	515,217.00	0.03
484	001332	锡装股份	15,600	512,460.00	0.03
485	300891	惠云钛业	52,600	510,220.00	0.03
486	000533	顺钠股份	106,400	499,016.00	0.03
487	603950	长源东谷	32,300	497,420.00	0.03
488	688519	南亚新材	19,100	492,016.00	0.03
489	603113	金能科技	60,600	489,042.00	0.03

490	002763	汇洁股份	57,500	483,575.00	0.03
491	601808	中海油服	32,900	480,998.00	0.03
492	300001	特锐德	23,400	470,340.00	0.03
493	002817	黄山胶囊	52,300	458,148.00	0.03
494	600702	舍得酒业	4,700	454,490.00	0.03
495	001216	华瓷股份	34,800	454,140.00	0.03
496	002534	西子洁能	36,000	449,640.00	0.03
497	600201	生物股份	41,000	441,570.00	0.03
498	688193	仁度生物	9,600	433,152.00	0.03
499	688269	凯立新材	11,600	429,316.00	0.03
500	300059	东方财富	30,200	424,008.00	0.03
501	688319	欧林生物	26,600	420,280.00	0.03
502	000573	粤宏远 A	122,600	414,388.00	0.03
503	603298	杭叉集团	16,600	413,008.00	0.03
504	000553	安道麦 A	59,400	412,236.00	0.03
505	000869	张裕 A	17,000	410,380.00	0.03
506	601816	京沪高铁	83,300	409,836.00	0.03
507	600403	大有能源	106,800	405,840.00	0.03
508	301073	君亭酒店	17,800	403,882.00	0.03
509	605189	富春染织	24,800	401,760.00	0.03
510	002841	视源股份	8,700	398,112.00	0.03
511	605007	五洲特纸	27,000	397,170.00	0.03
512	002444	巨星科技	17,500	394,100.00	0.03
513	300553	集智股份	11,000	393,800.00	0.03
514	002107	沃华医药	64,600	392,122.00	0.03
515	601098	中南传媒	38,400	390,528.00	0.03
516	688288	鸿泉物联	16,400	389,664.00	0.03
517	603367	辰欣药业	26,400	386,496.00	0.03
518	300872	天阳科技	28,000	383,040.00	0.02
519	688600	皖仪科技	18,800	379,760.00	0.02
520	600983	惠而浦	42,700	379,603.00	0.02
521	002743	富煌钢构	63,300	378,534.00	0.02
522	000751	锌业股份	116,000	377,000.00	0.02
523	002032	苏泊尔	7,100	376,371.00	0.02
524	002467	二六三	79,100	367,024.00	0.02
525	688358	祥生医疗	9,700	366,466.00	0.02
526	000682	东方电子	45,000	362,250.00	0.02
527	002206	海利得	72,100	361,942.00	0.02
528	301227	森鹰窗业	13,300	360,031.00	0.02
529	688129	东来技术	21,700	359,135.00	0.02
530	601006	大秦铁路	49,700	358,337.00	0.02
531	301042	安联锐视	9,100	356,720.00	0.02
532	002517	恺英网络	31,800	355,206.00	0.02
533	000698	沈阳化工	84,000	354,480.00	0.02

534	600551	时代出版	32,300	351,747.00	0.02
535	300998	宁波方正	15,100	348,508.00	0.02
536	688003	天准科技	9,200	345,184.00	0.02
537	601988	中国银行	86,400	344,736.00	0.02
538	300387	富邦股份	41,000	341,940.00	0.02
539	002048	宁波华翔	26,100	339,561.00	0.02
540	688010	福光股份	13,800	332,028.00	0.02
541	601918	新集能源	62,800	330,956.00	0.02
542	688015	交控科技	17,600	330,176.00	0.02
543	002475	立讯精密	9,500	327,275.00	0.02
544	300889	爱克股份	19,400	325,920.00	0.02
545	603611	诺力股份	17,100	323,703.00	0.02
546	300385	雪浪环境	48,100	323,232.00	0.02
547	601186	中国铁建	42,400	322,664.00	0.02
548	301359	东南电子	12,100	321,981.00	0.02
549	300610	晨化股份	28,400	320,068.00	0.02
550	300015	爱尔眼科	20,200	319,564.00	0.02
551	601618	中国中冶	104,000	318,240.00	0.02
552	603160	汇顶科技	4,600	317,860.00	0.02
553	600845	宝信软件	6,500	317,200.00	0.02
554	002142	宁波银行	15,700	315,727.00	0.02
555	600160	巨化股份	19,000	313,310.00	0.02
556	600535	天士力	18,300	311,466.00	0.02
557	301138	华研精机	10,600	307,400.00	0.02
558	688536	思瑞浦	2,100	307,230.00	0.02
559	603859	能科科技	8,100	305,613.00	0.02
560	603879	永悦科技	47,600	304,164.00	0.02
561	688509	正元地信	62,400	301,392.00	0.02
562	300622	博士眼镜	15,100	299,433.00	0.02
563	600269	赣粤高速	72,000	295,920.00	0.02
564	000975	银泰黄金	19,700	295,500.00	0.02
565	603585	苏利股份	20,600	294,786.00	0.02
566	300349	金卡智能	23,600	293,112.00	0.02
567	002595	豪迈科技	9,800	291,746.00	0.02
568	605018	长华集团	26,100	289,188.00	0.02
569	002214	大立科技	25,100	287,897.00	0.02
570	601113	华鼎股份	83,500	286,405.00	0.02
571	600967	内蒙一机	34,000	280,840.00	0.02
572	301077	星华新材	13,500	274,455.00	0.02
573	300918	南山智尚	26,300	271,679.00	0.02
574	000920	沃顿科技	27,300	271,089.00	0.02
575	688159	有方科技	7,200	271,080.00	0.02
576	003036	泰坦股份	21,800	270,320.00	0.02
577	000960	锡业股份	18,200	260,624.00	0.02

578	002790	瑞尔特	24,800	258,912.00	0.02
579	603811	诚意药业	24,480	253,857.60	0.02
580	601869	长飞光纤	9,200	252,632.00	0.02
581	000551	创元科技	24,100	252,327.00	0.02
582	603279	景津装备	11,300	249,843.00	0.02
583	601921	浙版传媒	31,800	242,952.00	0.02
584	002025	航天电器	4,900	235,298.00	0.02
585	688226	威腾电气	12,400	233,120.00	0.02
586	002267	陕天然气	31,700	232,361.00	0.02
587	300789	唐源电气	10,300	232,162.00	0.02
588	003000	劲仔食品	18,500	226,070.00	0.01
589	002001	新和成	13,200	223,872.00	0.01
590	603111	康尼机电	39,200	218,344.00	0.01
591	600754	锦江酒店	7,300	218,270.00	0.01
592	300596	利安隆	7,300	215,788.00	0.01
593	300384	三联虹普	13,200	210,672.00	0.01
594	002956	西麦食品	14,700	210,651.00	0.01
595	688103	国力股份	4,100	202,458.00	0.01
596	603053	成都燃气	19,100	195,584.00	0.01
597	300388	节能国祯	30,000	192,900.00	0.01
598	300673	佩蒂股份	14,500	192,850.00	0.01
599	688571	杭华股份	25,600	191,488.00	0.01
600	002492	恒基达鑫	31,600	189,284.00	0.01
601	601607	上海医药	10,900	182,357.00	0.01
602	000733	振华科技	3,000	176,520.00	0.01
603	002278	神开股份	29,600	173,752.00	0.01
604	002134	天津普林	15,700	172,229.00	0.01
605	000807	云铝股份	14,000	171,080.00	0.01
606	600863	内蒙华电	42,300	164,970.00	0.01
607	000596	古井贡酒	700	162,960.00	0.01
608	601886	江河集团	24,000	159,840.00	0.01
609	601319	中国人保	30,100	145,684.00	0.01
610	603979	金诚信	3,800	143,488.00	0.01
611	688278	特宝生物	2,700	141,345.00	0.01
612	002649	博彦科技	11,100	136,197.00	0.01
613	003006	百亚股份	8,800	133,408.00	0.01
614	000921	海信家电	6,500	132,600.00	0.01
615	301066	万事利	10,200	131,376.00	0.01
616	300448	浩云科技	24,400	131,272.00	0.01
617	301026	浩通科技	4,100	124,845.00	0.01
618	002842	翔鹭钨业	14,300	124,696.00	0.01
619	300383	光环新网	12,800	124,416.00	0.01
620	300865	大宏立	5,500	123,475.00	0.01
621	603926	铁流股份	9,800	122,598.00	0.01

622	601298	青岛港	19,700	121,746.00	0.01
623	002378	章源钨业	20,800	117,728.00	0.01
624	601139	深圳燃气	16,700	115,063.00	0.01
625	601218	吉鑫科技	28,600	114,400.00	0.01
626	603871	嘉友国际	7,100	112,606.00	0.01
627	688586	江航装备	9,300	103,137.00	0.01
628	603045	福达合金	6,400	101,056.00	0.01
629	600997	开滦股份	13,200	100,716.00	0.01
630	688023	安恒信息	900	99,801.00	0.01
631	603698	航天工程	6,700	96,279.00	0.01
632	300884	狄耐克	7,000	91,560.00	0.01
633	601000	唐山港	25,100	87,850.00	0.01
634	002479	富春环保	17,800	84,906.00	0.01
635	688085	三友医疗	4,300	83,850.00	0.01
636	002088	鲁阳节能	5,800	82,650.00	0.01
637	002133	广宇集团	23,200	80,968.00	0.01
638	300183	东软载波	5,300	79,977.00	0.01
639	300527	中船应急	10,300	78,486.00	0.01
640	603385	惠达卫浴	9,700	77,697.00	0.01
641	301339	通行宝	3,500	70,630.00	0.00
642	002373	千方科技	6,000	67,260.00	0.00
643	300123	亚光科技	9,000	65,970.00	0.00
644	300689	澄天伟业	3,400	65,858.00	0.00
645	600398	海澜之家	8,500	63,070.00	0.00
646	000665	湖北广电	11,400	54,720.00	0.00
647	688480	赛恩斯	1,400	54,208.00	0.00
648	603228	景旺电子	2,400	54,144.00	0.00
649	300741	华宝股份	2,500	53,525.00	0.00
650	000517	荣安地产	21,800	53,410.00	0.00
651	600319	亚星化学	8,300	47,974.00	0.00
652	002546	新联电子	9,500	47,500.00	0.00
653	002830	名雕股份	3,000	44,670.00	0.00
654	301526	国际复材	9,723	43,267.35	0.00
655	000932	华菱钢铁	7,900	40,685.00	0.00
656	600847	万里股份	3,000	35,760.00	0.00
657	000651	格力电器	900	28,953.00	0.00
658	688702	盛科通信	549	26,450.82	0.00
659	300818	耐普矿机	800	26,408.00	0.00
660	300736	百邦科技	2,000	25,540.00	0.00
661	301559	中集环科	1,315	23,985.60	0.00
662	000987	越秀资本	3,900	23,478.00	0.00
663	688652	京仪装备	416	21,736.00	0.00
664	300134	大富科技	2,100	21,672.00	0.00
665	300246	宝莱特	1,900	19,570.00	0.00



666	605388	均瑶健康	1,400	17,556.00	0.00
667	600897	厦门空港	1,400	17,486.00	0.00
668	601096	宏盛华源	3,918	15,907.08	0.00
669	002198	嘉应制药	2,100	15,288.00	0.00
670	601083	锦江航运	1,263	13,981.41	0.00
671	301566	达利凯普	576	12,752.64	0.00
672	600018	上港集团	2,400	11,760.00	0.00
673	002382	蓝帆医疗	1,700	11,356.00	0.00
674	301550	斯菱股份	260	11,328.20	0.00
675	301508	中机认检	419	11,178.92	0.00
676	600429	三元股份	2,200	9,812.00	0.00
677	688716	中研股份	267	9,716.13	0.00
678	301413	安培龙	164	9,543.16	0.00
679	301500	飞南资源	455	9,504.95	0.00
680	301516	中远通	604	9,368.04	0.00
681	002973	侨银股份	800	8,776.00	0.00
682	301568	思泰克	246	8,752.68	0.00
683	301520	万邦医药	160	8,438.40	0.00
684	301459	丰茂股份	208	8,286.72	0.00
685	688720	艾森股份	165	8,223.60	0.00
686	301489	思泉新材	128	8,206.08	0.00
687	688080	映翰通	200	8,116.00	0.00
688	301517	陕西华达	185	8,082.65	0.00
689	301578	辰奕智能	118	8,061.76	0.00
690	301548	崇德科技	136	8,022.64	0.00
691	688657	浩辰软件	101	7,901.23	0.00
692	603062	麦加芯彩	126	7,284.06	0.00
693	301555	惠柏新材	224	7,266.56	0.00
694	301529	福赛科技	182	6,894.16	0.00
695	688648	中邮科技	303	6,493.29	0.00
696	001378	德冠新材	205	6,410.35	0.00
697	603004	鼎龙科技	195	6,082.05	0.00
698	600012	皖通高速	500	5,510.00	0.00
699	001306	夏厦精密	64	4,823.04	0.00
700	603075	热威股份	182	4,242.42	0.00
701	001358	兴欣新材	87	3,841.92	0.00
702	001239	永达股份	189	3,764.88	0.00
703	603231	索宝蛋白	161	3,466.33	0.00
704	603273	天元智能	178	3,376.66	0.00
705	603276	恒兴新材	134	3,333.92	0.00
706	603373	安邦护卫	88	3,058.00	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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	300502	新易盛	17,013,970.00	1.11
2	000811	冰轮环境	15,903,322.00	1.04
3	605058	澳弘电子	14,716,960.00	0.96
4	300750	宁德时代	13,717,483.00	0.89
5	601138	工业富联	13,667,331.00	0.89
6	688981	中芯国际	12,906,529.86	0.84
7	601728	中国电信	12,757,693.00	0.83
8	002996	顺博合金	12,690,666.00	0.83
9	002724	海洋王	12,608,323.00	0.82
10	002027	分众传媒	12,576,801.00	0.82
11	300789	唐源电气	12,570,298.00	0.82
12	002517	恺英网络	12,349,135.00	0.80
13	600261	阳光照明	12,313,576.00	0.80
14	002594	比亚迪	12,266,849.78	0.80
15	002811	郑中设计	12,217,657.00	0.80
16	000725	京东方 A	12,061,201.00	0.79
17	000063	中兴通讯	12,022,546.40	0.78
18	300768	迪普科技	11,978,504.00	0.78
19	603166	福达股份	11,931,368.60	0.78
20	002558	巨人网络	11,727,620.00	0.76

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	300502	新易盛	18,661,935.35	1.22
2	000811	冰轮环境	14,977,333.50	0.98
3	605058	澳弘电子	13,554,067.00	0.88
4	002517	恺英网络	13,211,265.00	0.86
5	300789	唐源电气	12,891,647.50	0.84
6	002558	巨人网络	11,879,145.00	0.77
7	688981	中芯国际	10,925,679.22	0.71
8	300808	久量股份	10,790,997.00	0.70
9	603390	通达电气	10,306,767.00	0.67
10	002605	姚记科技	9,995,853.00	0.65
11	603053	成都燃气	9,834,129.40	0.64
12	600583	海油工程	9,707,462.00	0.63

13	605179	一鸣食品	9,632,617.00	0.63
14	603166	福达股份	9,539,536.00	0.62
15	002981	朝阳科技	9,467,897.75	0.62
16	688095	福昕软件	9,307,155.49	0.61
17	002996	顺博合金	9,301,559.00	0.61
18	002331	皖通科技	9,286,816.00	0.61
19	688435	英方软件	9,272,566.16	0.60
20	300822	贝仕达克	9,049,433.00	0.59

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	4,819,153,438.01
卖出股票收入（成交）总额	3,367,118,881.39

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）	754,049.58	0.05
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	754,049.58	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	7,540	754,049.58	0.05
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-

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	1,964,457.60
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	7,400,169.44
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,364,627.04

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## §9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
华夏智胜新锐股票 A	10,866	56,896.50	242,534,218.17	39.23%	375,703,113.41	60.77%
华夏智胜新锐股票 C	19,681	47,880.04	112,593,823.82	11.95%	829,733,167.82	88.05%
合计	30,547	51,087.32	355,128,041.99	22.76%	1,205,436,281.23	77.24%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	华夏智胜新锐股票 A	516,773.59	0.08%
	华夏智胜新锐股票 C	247,621.82	0.03%
	合计	764,395.41	0.05%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

## §10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华夏智胜新锐股票 A	华夏智胜新锐股票 C
基金合同生效日(2023 年 7 月 7 日) 基金份额总额	511,273,756.06	989,025,856.78
基金合同生效日起至报告期末基金总申购份额	213,128,744.89	413,332,655.78
减: 基金合同生效日起至报告期末基金总赎回份额	106,165,169.37	460,031,520.92
基金合同生效日起至报告期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	618,237,331.58	942,326,991.64

注: 本基金合同于 2023 年 7 月 7 日生效。

## §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, 本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 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, 本基金托管人不涉及公募基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略未发生改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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 40,000 元人民币。本基金本报告期内选聘普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)提供首年审计服务。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	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	4	8,182,515,092.06	100.00%	2,150,936.98	100.00%	-

注：①为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择券商的标准，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本基金合同于 2023 年 7 月 7 日生效，除本表列示外，本基金本报告期末选择其他交易单元作为本基金交易单元。

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	3,901,760.69	100.00%	5,045,000,000.00	100.00%	-	-	-	-

## 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华夏基金管理有限公司关于华夏智胜新锐股票型证券投资基金进行比例配售暨公布认购申请确认比例结果的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-07-07
2	华夏智胜新锐股票型证券投资基金基金合同生效公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-07-08
3	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
4	华夏基金管理有限公司关于华夏智胜新锐股票型证券投资基金限制申购、定期定额申购及转换转入业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-07-26
5	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
6	华夏智胜新锐股票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	中国证监会指定报刊及网站	2023-07-26
7	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
8	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
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	2023-09-28
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	2023-10-11
11	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

本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

## §13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予基金注册的文件；
- 2、《华夏智胜新锐股票型证券投资基金基金合同》；
- 3、《华夏智胜新锐股票型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