

未经审计的半年度报告

华夏精选固定收益配置基金

（依据香港法律以伞形基金形式成立的开放式单位信托，同
属华夏精选基金的子基金）

自 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

华夏精选固定收益配置基金
(华夏精选基金的子基金)

目录

	页码
管理及行政	1
基金管理人向基金份额持有人的报告	2 - 3
未审计的财务报表	
损益及其他全面收益表	4
财务状况表	5 - 6
基金份额持有人应占资产净值变动表	7
现金流量表	8
投资表现报表 (未审计)	9 - 11
投资组合持有变动表 (未审计)	12 - 28
金融衍生工具的详情 (未审计)	29
投资组合列表 (未审计)	30 - 37
股息披露 (未审计)	38

重要提示:

本年度报告内所载的任何意见仅反映基金管理人的意见, 可能发生变更。有关基金的更多资料, 请参阅刊载于我们网站的基金说明书:

<https://www.chinaamc.com.hk/product/chinaamc-select-fixed-income-allocation-fund/>

投资者制定投资决策时不得依赖本报告所载的资料。

华夏精选固定收益配置基金
(华夏精选基金的子基金)

管理及行政

基金管理人

华夏基金(香港)有限公司
香港中环花园道1号
中银大厦37楼

基金管理人董事

甘添
李丰名
李一梅
孙立强
阳琨

基金管理人的法律顾问

的近律师事务所
香港中环遮打道18号
历山大厦5楼

受托人、行政管理人及基金登记机构

中银国际英国保诚信托有限公司
香港太古城英皇道1111号
15楼1501-1057 & 1513-1516室

审计师

安永会计师事务所
香港鲗鱼涌英皇道979号
太古坊一座27楼

保管人

中国银行(香港)有限公司
香港中环花园道1号
中国银行大厦14楼

华夏精选固定收益配置基金

（华夏精选基金的子基金）

基金管理人向基金份额持有人的报告

简介

华夏精选固定收益配置基金（“本子基金”）同属华夏精选基金的子基金，是按照 2012 年 1 月 12 日签订的信托契约并依据香港法律成立的伞形单位信托（经不时修订或补充）。本子基金旨在透过将本子基金不少于 70% 的资产净值直接或间接投资于全球市场的固定收益及债务工具，以达致资本增值。

市场回顾

2024 年中，市场表现明显偏离年初初始预期。尽管通胀持续，劳动力市场状况良好，但美联储利率一直保持稳定，而全球其他央行已转而步入降息周期。2024 年年中，由于美国经济仍有望实现软着陆，人们对市场整体风险保持乐观态度。多数资产类别的波动性有所下降，大宗商品和股票的表现优于债券。债券市场方面，美国国债收益率上行波动，10 年期收益率年初至今上涨约 40 个基点。同时，信用利差持续收窄，延续了 2023 年信用债优于利率债和高收益债券优于投资级债券的走势。

2024 年上半年，美国国债利率从年初低位小幅上涨。10 年期基准收益率从 2024 年初的 3.8% 飙升至 4 月中旬的 4.7% 以上，随后降至目前的 4.3% 左右；同时，2 年期和 10 年期国债收益率曲线大部分时间出现了 20-50 个基点的小范围反转。未来，我们预计下一季度美国国债收益率将继续在一定范围内波动，多头和空头头寸将达到相对均衡的水平，大量竞价发行会遏制收益率的快速下降。但是，当我们接近美联储预期的首次降息时，美国国债收益率不会大幅上涨，中期收益率曲线可能会更加倾斜。基于此，我们目前在利率问题上保持相对中立的态度。我们倾向于将资金配置为 5-7 年期的国债，这样可以在一定程度上更好地防范投资风险，同时获得更高的回报。对于 10 年期国债，我们建议在利率上涨时适时增加长期头寸。

全球信用利差超过了我们的初始预期，第一季度多数行业的信用利差单方面收紧，第二季度则在较低水平上小幅波动。这一表现有两个主要原因。一方面，上年末美国利率下行和金融状况缓解为一季度信贷扩张提供了支撑。这反过来也增强了企业的盈利能力和流动性等信贷基本面。另一方面，美国以外全面收益投资者（尤其是亚洲和中东地区投资者）的强劲需求，不仅有效吸收了年初至今发行的大量信用债，还将信用利差推至相对于其自身估值记录或与美国国债和抵押担保证券相比的历史高点。目前，我们对美国的信用利差仍持谨慎态度。从估值角度来看，目前 BBB 级和 A 级信用之间的利差相对较小，进一步收紧的空间有限。无论利率是因通胀压力加剧而上涨，还是因风险事件而下降，预计信用利差均仍会扩大。从根本性因素来看，虽然大型企业债券融资成本并未明显增加，但盈利能力弱、经营活动现金流量减少的低质量发行机构仍可能面临债务偿还困难的问题。与此同时，银行小企业贷款利率飙升，大量公司债券将于 2025 年到期。从供需来看，下半年进入降息周期，因此预计新债发行量会下降，投资者需求会有所增加，这为信贷市场提供了技术支持。

华夏精选固定收益配置基金

（华夏精选基金的子基金）

基金管理人向基金份额持有人的报告（续）

市场回顾（续）

尽管历史估值很高，但中国发行的美元债券关联性较低，是一种具有吸引力的风险分散方式。欧洲和澳大利亚等市场的金融业交易价格仍然高于美国大型银行。美元计价的新兴市场债券。年初至今，公司债券的表现明显优于主权债券。随着定价趋于考虑政治风险，且大宗商品价格再次上涨，某些商品出口国的债券可能会伺机提供投资价值。总体而言，今年以来，自本次加息周期开始以来相对滞后的债券行业发生了反转。例如，金融债券和公司债券之间的利差收窄，而 30 年期信用利差相对于 10 年期利差有所扩大。这些变化表明，市场已开始为未来的降息定价。我们对这些领域保持相对中立的态度，并对整体信贷期限保持谨慎。我们倾向于均衡配置，在市场波动中寻找行业轮换机会，而非押注于单一地区或行业。

华夏基金（香港）有限公司

2024 年 8 月 16 日

华夏精选固定收益配置基金

(华夏精选基金的子基金)

损益及其他全面收益表 (未审计)

自 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

	自 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 (未审计) 美元	自 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 (未审计) 美元
收入		
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产 产生的利息收入	2,265,926	1,166,356
银行存款利息收入	2,435	44,180
杂项收入	243	885
	<u>2,268,604</u>	<u>1,211,421</u>
费用		
管理费	(375,604)	(167,654)
受托人费用	(80,248)	(42,181)
托管费和银行费用	(29,469)	(21,252)
审计师薪酬	(6,811)	(10,377)
交易手续费	(10,185)	(7,005)
法律和专业服务费	(14,856)	(47)
其他费用	(25,123)	(39,012)
	<u>(542,296)</u>	<u>(287,528)</u>
减: 由基金管理人承担的费用	114,841	21,862
	<u>(427,455)</u>	<u>(265,666)</u>
投资及汇兑差额前利润	1,841,149	945,755
投资 (损失) / 利得及汇兑差额 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产 及负债产生的净 (损失) / 利得	(553,470)	621,730
汇兑差额	(81,568)	(6,203)
投资 (损失) / 利得及汇兑差额净额	<u>(635,038)</u>	<u>615,527</u>
税前利润	<u>1,206,111</u>	<u>1,561,282</u>
预扣税	-	-
基金份额持有人应占资产净值增加	<u><u>1,206,111</u></u>	<u><u>1,561,282</u></u>

华夏精选固定收益配置基金
(华夏精选基金的子基金)

财务状况表 (未审计)

2024 年 6 月 30 日

	2024 年 6 月 30 日 (未审计) 美元	2023 年 12 月 31 日 (已审计) 美元
资产		
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	128,386,818	109,802,793
定期存款	10,000	-
应收利息	1,103,311	1,005,737
应收认购款	799,080	199,890
预付款	1,746	1,704
应收基金管理人的款项	170,037	124,280
应收经纪人的款项	11,550,195	-
现金及现金等价物	4,686,229	1,462,367
总资产	<u>146,707,416</u>	<u>112,596,771</u>
负债		
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	128,586	77,342
应付管理费	194,273	178,917
应付受托人费用	12,814	12,926
应计费用和其他应付款	37,526	30,587
应付赎回款项	128,768	109,821
应付经纪人的款项	20,817,713	-
应付税费	373	373
总负债 (不含基金份额持有人应占资产净值)	<u>21,320,053</u>	<u>409,966</u>
基金份额持有人应占资产净值	<u>125,387,363</u>	<u>112,186,805</u>
总负债	<u>146,707,416</u>	<u>112,596,771</u>

华夏精选固定收益配置基金
(华夏精选基金的子基金)

财务状况表 (未审计) (续)

2024 年 6 月 30 日

	2024 年 6 月 30 日 (未审计)	2023 年 12 月 31 日 (已审计)
已发行基金份额数目		
- I 类 (美元)	3,190,714.19	3,190,714.19
- I 类 (港元)	2,168,358.93	2,168,358.93
- A 类 (美元)	476,720.28	490,365.84
- A 类 (港元)	4,674,433.07	4,577,710.53
- A 类 (人民币)	2,768,556.12	237,080.76
- R 类 (人民币)	77,362,099.57	49,325,978.33
- R 类 (人民币) (对冲)	339,465,913.53	314,332,694.84
- I 类 (美元派息)	743,383.88	743,383.88
份额净值		
- I 类 (美元)	11.9528 美元	11.6583 美元
- I 类 (港元)	11.1656 港元	10.8935 港元
- A 类 (美元)	11.2309 美元	10.9689 美元
- A 类 (港元)	11.2097 港元	10.9512 港元
- A 类 (人民币)	11.7821 人民币	11.2375 人民币
- R 类 (人民币)	1.1884 人民币	1.1335 人民币
- R 类 (人民币) (对冲)	1.0001 人民币	0.9901 人民币
- I 类 (美元派息)	11.3606 美元	11.0809 美元

注：本未经审计的半年度报告是根据国际会计准则委员会颁布的《国际财务报告准则》（“IFRS”）以及香港证券及期货事务监察委员会（“SFC”）制定的《单位信托及互惠基金守则》附录 E 所列明之相关披露规定编制。

本未经审计的半年度报告采用与截至 2023 年 12 月 31 日止年度的年度报告一致的会计政策，相关政策已载于该年度报告财务报表附注 2。

华夏精选固定收益配置基金
(华夏精选基金的子基金)

基金份额持有人应占资产净值变动表 (未审计)

自 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

	基金份额数目	美元
2023 年 1 月 1 日	58,794,552.25	57,681,637
认购的基金份额		
- A 类 (美元)	59,982.05	629,143
- A 类 (港元)	5,222,828.65	6,999,818
- A 类 (人民币)	121,462.58	185,015
- R 类 (人民币)	31,843,159.81	4,822,743
- R 类 (人民币) (对冲)	21,748,316.93	3,096,319
	<u>58,995,750.02</u>	<u>15,733,038</u>
赎回的基金份额		
- A 类 (美元)	(166,435.97)	(1,743,804)
- A 类 (港元)	(5,642,627.70)	(7,576,093)
- A 类 (人民币)	(93.70)	(141)
- R 类 (人民币)	(27,974,368.99)	(4,269,306)
- R 类 (人民币) (对冲)	(26,747,316.93)	(3,703,510)
	<u>(60,530,843.29)</u>	<u>(17,292,854)</u>
基金份额持有人应占资产净值增加	-	1,561,282
2023 年 6 月 30 日	<u>57,259,458.98</u>	<u>57,683,103</u>

	基金份额数目	美元
2024 年 1 月 1 日	375,066,287.31	112,186,805
认购的基金份额		
- A 类 (美元)	165,631.09	1,837,471
- A 类 (港元)	2,346,786.43	3,333,955
- A 类 (人民币)	2,580,144.00	4,159,265
- R 类 (人民币)	28,036,121.24	4,458,072
- R 类 (人民币) (对冲)	55,633,218.69	7,664,084
	<u>88,761,901.45</u>	<u>21,452,847</u>
赎回的基金份额		
- A 类 (美元)	(179,276.65)	(1,982,913)
- A 类 (港元)	(2,250,063.89)	(3,185,883)
- A 类 (人民币)	(48,668.65)	(77,360)
- R 类 (人民币) (对冲)	(30,500,000.00)	(4,212,244)
	<u>(32,978,009.19)</u>	<u>(9,458,400)</u>
基金份额持有人应占资产净值增加	-	1,206,111
2024 年 6 月 30 日	<u>430,850,179.57</u>	<u>125,387,363</u>

华夏精选固定收益配置基金
(华夏精选基金的子基金)

现金流量表 (未审计)

自 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

	自 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 (未审计) 美元	自 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 (未审计) 美元
经营活动产生的现金流量		
税前利润	1,206,111	1,561,282
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产增加	(18,584,025)	(9,865,276)
定期存款 (增加) / 减少	(10,000)	2,000,000
应收利息增加	(97,574)	(152,838)
应收基金管理人的款项 (增加) / 减少	(45,757)	11,713
应收经纪人的款项增加	(11,550,195)	(4,524,925)
预付款项 (增加) / 减少	(42)	3
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债增加	51,244	80,434
应付管理费增加	15,356	13,749
应付受托人费用 (减少) / 增加	(112)	401
应计费用和其他应付款增加 / (减少)	6,939	(8,527)
应付经纪人的款项增加	20,817,713	8,956,628
经营活动使用的现金	(8,190,342)	(1,927,356)
已缴税款	-	-
经营活动使用的现金流量净额	(8,190,342)	(1,927,356)
筹资活动产生的现金流量		
发行基金单位所得款项	20,853,657	15,652,592
赎回基金单位支付款项	(9,439,453)	(17,374,420)
筹资活动产生 / (使用) 的现金流量净额	11,414,204	(1,721,828)
现金及现金等价物增加 / (减少) 净额	3,223,862	(3,649,184)
期初现金及现金等价物	1,462,367	5,448,876
期末现金及现金等价物	4,686,229	1,799,692
现金及现金等价物余额分析		
银行存款	4,686,229	1,799,692
经营活动产生的现金流量净额包括:		
银行存款利息收入	2,435	44,180

华夏精选固定收益配置基金
(华夏精选基金的子基金)

投资表现报表 (未审计)

基金份额持有人应占资产净值
(根据国际财务报告准则计算)

	每份额资产净值	基金份额持有人应占资产净值
截至 2024 年 6 月 30 日 (未审计)		
- I 类 (美元)	11.9528 美元	38,137,877 美元
- I 类 (港元)	11.1656 港元	3,100,697 美元
- A 类 (美元)	11.2309 美元	5,354,019 美元
- A 类 (港元)	11.2097 港币	6,710,740 美元
- A 类 (人民币)	11.7821 人民币	4,473,259 美元
- R 类 (人民币)	1.1884 人民币	12,607,698 美元
- R 类 (人民币) (对冲)	1.0001 人民币	46,557,778 美元
- I 类 (美元派息)	11.3606 美元	8,445,295 美元
截至 2023 年 12 月 31 日 (已审计)		
- I 类 (美元)	11.6583 美元	37,198,207 美元
- I 类 (港元)	10.8935 港元	3,024,360 美元
- A 类 (美元)	10.9689 美元	5,378,770 美元
- A 类 (港元)	10.9512 港元	6,418,663 美元
- A 类 (人民币)	11.2375 人民币	374,111 美元
- R 类 (人民币)	1.1335 人民币	7,851,173 美元
- R 类 (人民币) (对冲)	0.9901 人民币	43,704,144 美元
- I 类 (美元派息)	11.0809 美元	8,237,377 美元
截至 2022 年 12 月 31 日 (已审计)		
- I 类 (美元)	10.8878 美元	34,934,397 美元
- I 类 (港元)	10.1561 港元	2,824,579 美元
- A 类 (美元)	10.2622 美元	6,134,335 美元
- A 类 (港元)	10.2263 港元	7,279,506 美元
- A 类 (人民币)	10.2212 人民币	3,074 美元
- R 类 (人民币) (对冲)	0.9526 人民币	6,505,745 美元
截至 2021 年 12 月 31 日 (已审计)		
- I 类 (美元)	11.4254 美元	53,797,916 美元
- I 类 (港元)	10.6587 港元	2,964,160 美元
- A 类 (美元)	10.7826 美元	15,622,002 美元
- A 类 (港元)	10.7485 港元	13,520,203 美元
- A 类 (人民币)	9.8704 人民币	1,554 美元
- R 类 (人民币) (对冲)	0.9934 人民币	781,756 美元
- R 类 (美元)	0.9856 美元	10,836,817 美元

华夏精选固定收益配置基金
(华夏精选基金的子基金)

投资表现报表 (未审计) (续)

每份额的最高发行价格和最低赎回价格¹

	每份额的 最高发行 价格	每份额的 最低赎回 价格
自 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 (未审计)		
- I 类 (港元)	11.1886 港元	10.8762 港元
- I 类 (美元)	11.9776 美元	11.6435 美元
- A 类 (美元)	11.2546 美元	10.9544 美元
- A 类 (港元)	11.2341 港元	10.9329 港元
- A 类 (人民币)	11.8083 人民币	11.2678 人民币
- R 类 (人民币)	1.1910 人民币	1.1366 人民币
- R 类 (人民币) (对冲)	1.0032 人民币	0.9870 人民币
- I 类 (美元派息)	11.3842 美元	11.0669 美元
截至 2023 年 12 月 31 日止年度 (已审计)		
- I 类 (港元)	10.8972 港元	10.1823 港元
- I 类 (美元)	11.6591 美元	10.8917 美元
- A 类 (美元)	10.9699 美元	10.2658 美元
- A 类 (港元)	10.9553 港币	10.2527 港币
- A 类 (人民币)	11.3486 人民币	10.0240 人民币
- R 类 (人民币)	1.1447 人民币	1.0184 人民币
- R 类 (人民币) (对冲)	0.9907 人民币	0.9529 人民币
- I 类 (美元派息)	11.0817 美元	10.7616 美元
截至 2022 年 12 月 31 日止年度 (已审计)		
- I 类 (港元)	10.6607 港元	10.0145 港元
- I 类 (美元)	11.4286 美元	10.6637 美元
- A 类 (美元)	10.7852 美元	10.0508 美元
- A 类 (港元)	10.7502 港元	10.0856 港元
- A 类 (人民币)	10.7177 人民币	9.5746 人民币
- R 类 (人民币) (对冲)	0.9944 人民币	0.9363 人民币
截至 2021 年 12 月 31 日止年度 (已审计)		
- I 类 (港元)	10.8334 港元	10.4553 港元
- I 类 (美元)	11.6339 美元	11.2183 美元
- A 类 (美元)	10.9927 美元	10.5932 美元
- A 类 (港元)	10.9395 港元	10.5495 港元
- A 类 (人民币)	10.2688 人民币	9.7483 人民币
- I 类 (美元派息)	10.7771 美元	10.7616 美元
- R 类 (美元)	1.0048 美元	0.9683 美元
- R 类 (人民币) (对冲)	1.0000 人民币	0.9721 人民币
截至 2020 年 12 月 31 日止年度 (已审计)		
- I 类 (港元)	10.6071 港元	10.5553 港元
- I 类 (美元)	11.4111 美元	10.3474 美元
- A 类 (美元)	10.8126 美元	9.8351 美元
- A 类 (港币)	10.7171 港元	9.7517 港元
- I 类 (美元派息)	10.7733 美元	9.7690 美元

华夏精选固定收益配置基金
(华夏精选基金的子基金)

投资表现报表 (未审计) (续)

每份额的最高发行价格和最低赎回价格¹

	每份额的 最高发行 价格	每份额的 最低赎回 价格
截至 2019 年 12 月 31 日止年度 (已审计)		
- I 类 (港元)	10.6213 港元	10.0892 港元
- I 类 (美元)	10.6506 美元	10.1111 美元
- A 类 (美元)	10.1357 美元	9.9875 美元
- A 类 (港元)	10.1447 港元	10.0000 港元
- I 类 (美元派息)	10.0953 美元	10.0000 美元
自 2018 年 8 月 28 日 (成立日期) 至 2018 年 12 月 31 日		
- I 类 (港元)	10.0840 港元	9.9521 港元
- I 类 (美元)	10.1075 美元	9.9533 美元

¹ 所示本子基金的过往业绩并不预示其未来业绩。

华夏精选固定收益配置基金
(华夏精选基金的子基金)

投资组合持有变动表 (未审计)

自 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

	2024 年 1 月 1 日	持有量的变动 增加	红利/ 股息	处置	2024 年 6 月 30 日
债务证券					
ABBVIE INC 5.4% S/A 15MAR2054	-	400,000	-	(400,000)	-
ABU DHABI COMMERCIAL BANK PJSC 0.08% S/A PERP	300,000	-	-	(300,000)	-
AFRICAN DEVELOPMENT BANK A 5.75% PERP	-	1,700,000	-	(1,700,000)	-
AGRICULTURAL BANK OF CHINA LTD/SEOUL 0% A 07FEB2024 CD	2,000,000	-	-	(2,000,000)	-
AIA GROUP LTD 2.7% S/A PERP	-	1,000,000	-	-	1,000,000
AIA GROUP LTD 5.375% S/A 15APR2034 REGS	-	500,000	-	(500,000)	-
AMERICAN HONDA FINANCE CORP 4.9% S/A 10JAN2034	-	700,000	-	(700,000)	-
ANTOFAGASTA PLC 2.375% S/A 14OCT2030 REGS	-	200,000	-	(200,000)	-
AOZORA BANK LTD 5.9% S/A 02MAR2026	1,000,000	-	-	(1,000,000)	-
ARES CAPITAL CORP 7% S/A 15JAN2027	800,000	-	-	-	800,000
ASAHI MUTUAL LIFE INSURANCE CO 6.9% S/A PERP	800,000	-	-	-	800,000
ASTRAZENECA PLC 4.375% S/A 17AUG2048	-	1,800,000	-	(1,800,000)	-
ASTRAZENECA PLC 4.8% S/A 06AUG2030	-	3,000,000	-	(3,000,000)	-
ASTRAZENECA PLC 4.9% S/A 02FEB2031	-	800,000	-	(800,000)	-
ASTRAZENECA PLC 5% S/A 26FEB2034	-	400,000	-	(400,000)	-
AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANK GROUP LTD 5.731% S/A 18SEP2034	-	500,000	-	(500,000)	-
AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GROUP LTD 2.95% S/A 22JUL2030 REGS	-	1,500,000	-	-	1,500,000
AVALONBAY COMMUNITIES INC 5.35% S/A 1JUN2034	-	400,000	-	(400,000)	-
BAE SYSTEMS PLC 5.3% S/A 26MAR2034 REGS	-	200,000	-	(200,000)	-
BAIC FINANCE INVESTMENT CO LTD 2% S/A 16MAR2024	1,660,000	-	-	(1,660,000)	-
BANCO BBVA PERU SA 6.2% S/A 7JUN2034	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA 5.381% S/A 13MAR2029	-	200,000	-	(200,000)	-
BANCO DO BRASIL SA/CAYMAN 6% S/A 18MAR2031 REGS	-	700,000	-	(700,000)	-
BANCO SANTANDER SA 5.538% S/A 14MAR2030	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-

华夏精选固定收益配置基金
(华夏精选基金的子基金)

投资组合持有变动表 (未审计) (续)

自 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

	2024 年 1 月 1 日	增加	持有量的变动 红利/ 股息	处置	2024 年 6 月 30 日
债务证券 (续)					
BANCO SANTANDER SA 5.552% S/A 14MAR2028	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-
BANCO SANTANDER SA 6.35% S/A 14MAR2034	-	1,200,000	-	(1,200,000)	-
BANCO SANTANDER SA S+1.38% Q 14MAR2028	-	2,000,000	-	(1,000,000)	1,000,000
BANK OF AMERICA CORP 5.468% S/A 23JAN2035	-	250,000	-	(250,000)	-
BANK OF EAST ASIA LTD 4.875% S/A 22APR2032	-	520,000	-	-	520,000
BANK OF EAST ASIA LTD 5.125% S/A 07JUL2028	-	500,000	-	(500,000)	-
BANK OF EAST ASIA LTD 5.825% S/A PERP	-	1,000,000	-	-	1,000,000
BANK OF EAST ASIA LTD 5.875% S/A PERP	-	2,500,000	-	-	2,500,000
BANK OF EAST ASIA LTD 6.625% S/A 13MAR2027	-	500,000	-	-	500,000
BANK OF EAST ASIA LTD 6.75% S/A 27JUN2034	-	800,000	-	(600,000)	200,000
BANK OF MONTREAL 4.8% S/A PERP	-	1,000,000	-	-	1,000,000
BANK OF NEW ZEALAND 2.87% S/A 27JAN2032 REGS	-	500,000	-	-	500,000
BANK OF NEW ZEALAND 5.076% S/A 30JAN2029 REGS	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-
BANK OF NOVA SCOTIA 4.65% S/A PERP	-	900,000	-	-	900,000
BARCLAYS PLC 8% Q PERP (CALLED)	600,000	-	-	(600,000)	-
BAT CAPITAL CORP 5.834% S/A 20FEB2031	-	300,000	-	-	300,000
BAT CAPITAL CORP 6% S/A 20FEB2034	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-
BECTON DICKINSON AND CO 5.11% S/A 08FEB2034	-	750,000	-	(750,000)	-
BK OF NOVA SCOTIA 8% Q 27JAN2084	-	500,000	-	(500,000)	-
BLACKROCK FUNDING INC 4.7% S/A 14MAR2029	-	500,000	-	(500,000)	-
BLACKROCK FUNDING INC 5% S/A 14MAR2034	-	750,000	-	(750,000)	-
BLACKROCK FUNDING INC 5.25% S/A 14MAR2054	-	300,000	-	(300,000)	-
BLUE OWL CREDIT INCOME CORP 6.65% S/A 15MAR2031	-	200,000	-	(200,000)	-
BLUESTAR FINANCE HLDGS LTD 3.1% S/A PERP	1,200,000	-	-	(1,200,000)	-

华夏精选固定收益配置基金
(华夏精选基金的子基金)

投资组合持有变动表 (未审计) (续)

自 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

	2024 年 1 月 1 日	增加	持有量的变动 红利/ 股息	处置	2024 年 6 月 30 日
债务证券 (续)					
BNP PARIBAS SA 6.625% S/A PERP REGS (CALLED)	2,000,000	-	-	(2,000,000)	-
BOC AVIATION USA CORP 5.25% S/A 14JAN2030 REGS	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-
BOEING CO 6.298% S/A 01MAY2029	-	300,000	-	(300,000)	-
BOEING CO 6.858% S/A 1MAY2054	-	300,000	-	(300,000)	-
BOEING CO 7.008% S/A 1MAY2064 REGS	-	300,000	-	(300,000)	-
BP CAPITAL MARKETS PLC 6.45% S/A PERP	-	750,000	-	-	750,000
BPCE SA 5.281% S/A 30MAY2035 REGS	-	800,000	-	(800,000)	-
BPCE SA 5.936% S/A 30MAY2035 REGS	-	700,000	-	(700,000)	-
BRAZILIAN GOVERNMENT INTL BOND 6.125% S/A 15MAR2034	-	300,000	-	(300,000)	-
BRAZILIAN GOVERNMENT INTL BOND 7.125% S/A 13MAY2054	-	500,000	-	(500,000)	-
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO 4.9% S/A 22FEB2027	-	200,000	-	(200,000)	-
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO 4.9% S/A 22FEB2029	-	200,000	-	(200,000)	-
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO 5.1% S/A 22FEB2031	-	400,000	-	(400,000)	-
BURLINGTON NORTHERN SANTA FE LLC 5.5% S/A 15MAR2055	-	600,000	-	(600,000)	-
CAMPBELL SOUP CO 5.4% S/A 21MAR2034	-	400,000	-	(400,000)	-
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP 5.7% S/A 01FEB2030	-	700,000	-	(700,000)	-
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP 6.051% S/A 1FEB2035	-	1,300,000	-	(1,300,000)	-
CATERPILLAR FINANCIAL SERVICES CORP 5% S/A 14MAY2027	-	500,000	-	-	500,000
CATHAYLIFE SINGAPORE PTE LTD 5.95% S/A 05JUL2034	-	900,000	-	-	900,000
CBQ FINANCE LTD 5.375% S/A 28MAR2029	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-
CELESTIAL DYNASTY LTD 4.25% S/A 27JUN2029	-	400,000	-	(400,000)	-
CELESTIAL MILES LTD 5.75% S/A PERP (CALLED)	2,000,000	-	-	(2,000,000)	-
CHINA CINDA 2020 I MANAGEMENT LTD 1.25% S/A 20JAN2024	2,300,000	-	-	(2,300,000)	-
CHINA CINDA 2020 I MANAGEMENT LTD 5.75% S/A 28MAY2029	-	1,000,000	-	-	1,000,000

华夏精选固定收益配置基金
(华夏精选基金的子基金)

投资组合持有变动表 (未审计) (续)

自 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

	2024 年 1 月 1 日	增加	持有量的变动 红利/ 股息	处置	2024 年 6 月 30 日
债务证券 (续)					
CHINA CINDA FINANCE 2014 LTD 5.625% S/A 14MAY2024 REGS	-	1,800,000	-	(1,800,000)	-
CHINA CINDA FINANCE 2017 I LTD 4.1% S/A 09MAR2024	1,000,000	-	-	(1,000,000)	-
CHINA CITIC BANK INTL LTD 4.625% S/A 28FEB2029 (CALLED)	2,000,000	-	-	(2,000,000)	-
CHINA CITIC BANK INTL LTD 6% S/A 05DEC2023	1,300,000	-	-	(420,000)	880,000
CHINA CONSTRUCTION BANK CORP/MACAU S+0.5% Q 21DEC2024	382,000	-	-	(382,000)	-
CHINA CONSTRUCTION BANK CORP/MACAU S+1.03161% Q 24OCT2024	1,000,000	-	-	(1,000,000)	-
CHINA DEVELOPMENT BANK FINANCIAL LEASING CO LTD 2.875% S/A 28SEP2030	-	700,000	-	(700,000)	-
CHINA GREAT WALL INTL HLDGS IV LTD 3.95% S/A PERP	-	2,000,000	-	-	2,000,000
CHINA GREAT WALL INTL HLDGS VI LTD 7.15% S/A PERP	-	600,000	-	-	600,000
CHINA HONGQIAO GROUP LTD 6.25% S/A 08JUN2024	-	991,000	-	(991,000)	-
CHINA HONGQIAO GROUP LTD 7.75% S/A 27MAR2025	-	700,000	-	-	700,000
CHINA LIFE INSURANCE OVERSEAS CO LTD/HONG KONG 5.35% S/A 15AUG2033	-	500,000	-	-	500,000
CHINA OVERSEAS FINANCE CAYMAN VI LTD 5.95% S/A 08MAY2024	1,300,000	-	-	(1,300,000)	-
CHINA PING AN INSURANCE OVERSEAS HLDGS LTD 6.125% S/A 16MAY2034	-	300,000	-	-	300,000
CHINA RESOURCES LAND LTD 3.75% S/A PERP	-	2,000,000	-	(2,000,000)	-
CHINA RESOURCES LAND LTD 6% S/A 27FEB2024	2,609,000	-	-	(2,609,000)	-
CHINA TAIPING INSURANCE HLDGS CO LTD 6.4% S/A PERP	1,000,000	-	-	-	1,000,000
CHIYU BANKING CORP LTD 5.75% S/A 07APR2032	-	250,000	-	-	250,000
CHONG HING BANK LTD 5.7% S/A PERP	-	1,350,000	-	-	1,350,000
CICC HONG KONG FINANCE 2016 MTN LTD S+0.95% Q 18JAN2027	-	4,000,000	-	(4,000,000)	-
CIGNA GROUP/THE 5% S/A 15MAY2029	-	500,000	-	(500,000)	-
CIGNA GROUP/THE 5.125% S/A 31MAY2031	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-
CIGNA GROUP/THE 5.25% S/A 15FEB2034	-	300,000	-	(300,000)	-
CIMIC FINANCE USA PTY LTD 7% S/A 25MAR2034 REGS	-	500,000	-	(500,000)	-

华夏精选固定收益配置基金
(华夏精选基金的子基金)

投资组合持有变动表 (未审计) (续)

自 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

	2024 年 1 月 1 日	增加	持有量的变动 红利/ 股息	处置	2024 年 6 月 30 日
债务证券 (续)					
CITIBANK NA 5.438% S/A 30APR2026	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-
CITIBANK NA 5.57% S/A 30APR2034	-	1,700,000	-	(700,000)	1,000,000
CITIBANK NA S+0.59% Q 30APR2026	-	1,200,000	-	(1,200,000)	-
CITIGROUP INC 5.449% S/A 11JUN2035	-	1,500,000	-	(1,500,000)	-
CITIGROUP INC 7.125% Q PERP	-	1,100,000	-	(1,100,000)	-
CITIGROUP INC 7.2% Q PERP	-	700,000	-	(700,000)	-
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC 5.841% S/A 23JAN2030	-	300,000	-	(300,000)	-
CLP POWER HK FINANCE LTD 3.55% S/A PERP	500,000	-	-	-	500,000
CNOOC NEXEN FINANCE 2014 ULC 4.25% S/A 30APR2024	-	433,000	-	(433,000)	-
COASTAL EMERALD LTD 6.5% S/A PERP	-	3,000,000	-	(1,000,000)	2,000,000
COCA-COLA CO 5% S/A 13MAY2034	-	600,000	-	(600,000)	-
COLUMBIA PIPELINES HOLDING CO LLC 5.681% S/A 15JAN2034 REGS	-	200,000	-	(200,000)	-
COMCAST CORP 5.1% S/A 1JUN2029	-	700,000	-	(700,000)	-
COMCAST CORP 5.3% S/A 1JUN2034	-	300,000	-	(300,000)	-
COMCAST CORP 5.65% S/A 1JUN2054	-	1,200,000	-	(1,200,000)	-
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA 5.837% S/A 13MAR2034 REGS	-	500,000	-	(500,000)	-
CORP NACIONAL DEL COBRE DE CHILE 6.3% S/A 08SEP2053 REGS	-	750,000	-	(750,000)	-
CORP NACIONAL DEL COBRE DE CHILE 6.44% S/A 26JAN2036 REGS	-	750,000	-	-	750,000
COSAN LUXEMBOURG SA 7.25% S/A 27JUN2031 REGS	-	200,000	-	(200,000)	-
CRCC CHENGAN LTD 3.97% S/A PERP (CALLED)	3,000,000	-	-	(3,000,000)	-
CREDIT AGRICOLE SA 5.134% S/A 11MAR2027 REGS	-	1,700,000	-	(1,700,000)	-
CREDIT AGRICOLE SA 6.251% S/A 10JAN2035	-	1,250,000	-	(1,250,000)	-
CREDIT AGRICOLE SA 7.875% Q PERP REGS (CALLED)	2,100,000	-	-	(2,100,000)	-
CREDIT AGRICOLE SA S+0.87% Q 11MAR2027 REGS	-	1,700,000	-	(1,700,000)	-
CROWN CASTLE INC 5.6% S/A 01JUN2029	200,000	-	-	(200,000)	-

华夏精选固定收益配置基金
(华夏精选基金的子基金)

投资组合持有变动表 (未审计) (续)

自 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

	2024 年 1 月 1 日	增加	持有量的变动 红利/ 股息	处置	2024 年 6 月 30 日
债务证券 (续)					
CROWN CASTLE INC 5.8% S/A 01MAR2034	300,000	-	-	(300,000)	-
CSL FINANCE PLC 5.106% S/A 03APR2034	-	500,000	-	(500,000)	-
CSL FINANCE PLC 5.417% S/A 03APR2054	-	250,000	-	(250,000)	-
CUMMINS INC 5.15% S/A 20FEB2034	-	300,000	-	(300,000)	-
CUMMINS INC 5.45% S/A 20FEB2054	-	700,000	-	(700,000)	-
DAH SING BANK LTD 5% S/A 15JAN2029	2,500,000	-	-	(2,500,000)	-
DAI-ICHI LIFE INSURANCE CO LTD 5.1% S/A PERP REGS	350,000	-	-	-	350,000
DAIMLER FINANCE NORTH AMERICA LLC 5% S/A 1JAN2037	-	250,000	-	(250,000)	-
DAIMLER FINANCE NORTH AMERICA LLC 5.375% S/A 18JAN2034	-	300,000	-	(300,000)	-
DAIMLER FINANCE NORTH AMERICA LLC 5.375% S/A 25JUN2034	-	550,000	-	(550,000)	-
DAIMLER FINANCE NORTH AMERICA LLC S+0.96% Q 25SEP2027	-	550,000	-	-	550,000
DBS GROUP HLDGS LTD S+0.61% Q 12SEP2025 REGS	500,000	-	-	(500,000)	-
DEUTSCHE BANK AG/NEW YORK 5.414% S/A 10MAY2029	-	1,000,000	-	(500,000)	500,000
DEUTSCHE BANK AG/NEW YORK 5.706% S/A 08FEB2029	-	900,000	-	(900,000)	-
DEUTSCHE BANK AG/NEW YORK 6.819% S/A 20NOV2029	1,000,000	-	-	-	1,000,000
DIAMONDBACK ENERGY INC 5.15% S/A 30JAN2030	-	600,000	-	(600,000)	-
DIAMONDBACK ENERGY INC 5.2% S/A 18APR2027	-	600,000	-	(600,000)	-
DIAMONDBACK ENERGY INC 5.4% S/A 18APR2034	-	600,000	-	(600,000)	-
DIAMONDBACK ENERGY INC 5.9% S/A 18APR2064	-	250,000	-	(250,000)	-
ELECT GLOBAL INVESTMENTS LTD 4.1% S/A PERP	-	3,000,000	-	(1,120,000)	1,880,000
ELI LILLY & CO 4.7% S/A 09FEB2034	-	1,700,000	-	(1,700,000)	-
ELI LILLY & CO 5% S/A 09FEB2054	-	250,000	-	(250,000)	-
ENTERGY CORP 7.125% S/A 1DEC2054	-	350,000	-	-	350,000
EQUINIX INC 5.5% S/A 15JUN2034	-	200,000	-	(200,000)	-

华夏精选固定收益配置基金
(华夏精选基金的子基金)

投资组合持有变动表 (未审计) (续)

自 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

	2024 年 1 月 1 日	持有量的变动 增加	红利/ 股息	处置	2024 年 6 月 30 日
债务证券 (续)					
ESIC SUKUK LTD 5.831% S/A 14FEB2029	-	1,250,000	-	(1,250,000)	-
EXELON CORP 5.45% S/A 15MAR2034	-	2,000,000	-	(2,000,000)	-
EXPORT-IMPORT BANK OF THAILAND 5.354% S/A 16MAY2029	-	600,000	-	(600,000)	-
F&G ANNUITIES & LIFE INC 6.5% S/A 4JUN2029	-	250,000	-	(250,000)	-
FAR EAST HORIZON LTD 6.625% S/A 16APR2027	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-
FEDERATION DES CAISSES DES JARDINS DU QUEBEC 5.25% S/A 26APR2029	-	400,000	-	(400,000)	-
FIFTH THIRD BANCORP 5.631% S/A 29JAN2032	-	600,000	-	(600,000)	-
FORD MOTOR CREDIT CO LLC 6.125% S/A 08MAR2034	-	750,000	-	-	750,000
FORTUNE STAR BVI LTD 5.05% S/A 27JAN2027	-	250,000	-	-	250,000
FWD GROUP LTD 5.75% S/A 09JUL2024	-	1,000,000	-	-	1,000,000
FWD GROUP LTD 7.635% S/A 02JUL2031	-	1,200,000	-	-	1,200,000
GATX CORP 6.05% S/A 05JUN2054	-	300,000	-	(300,000)	-
GEELY AUTOMOBILE HLDGS LTD 4% S/A PERP	1,000,000	-	-	-	1,000,000
GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC 5.4% S/A 08MAY2027	-	775,000	-	(775,000)	-
GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC 5.75% S/A 08FEB2031	-	400,000	-	(400,000)	-
HANA BANK 5.75% S/A 24OCT2028 REGS	500,000	-	-	-	500,000
HANWHA TOTAL PETROHEMICAL CO LTD 5.5% S/A 18JUL2029	-	800,000	-	(800,000)	-
HASBRO INC 6.05% S/A 14MAY2034	-	300,000	-	(300,000)	-
HEALTH CARE SERVICE CORP 5.2% S/A 15JUN2029 REGS	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-
HEALTH CARE SERVICE CORP 5.875% S/A 15JUN2054 REGS	-	700,000	-	(700,000)	-
HOME DEPOT INC 4.75% S/A 25JUN2029	-	200,000	-	(200,000)	-
HOME DEPOT INC 4.85% S/A 25JUN2031	-	900,000	-	(900,000)	-
HOME DEPOT INC 4.875% S/A 25JUN2027	-	200,000	-	(200,000)	-
HOME DEPOT INC 4.95% S/A 25JUN2034	-	200,000	-	(200,000)	-

华夏精选固定收益配置基金
(华夏精选基金的子基金)

投资组合持有变动表 (未审计) (续)

自 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

	2024 年 1 月 1 日	持有量的变动 增加	红利/ 股息	处置	2024 年 6 月 30 日
债务证券 (续)					
HOME DEPOT INC 5.1% S/A 24DEC2025	-	400,000	-	(400,000)	-
HOME DEPOT INC 5.15% S/A 25JUN2026	-	900,000	-	(900,000)	-
HOME DEPOT INC 5.3% S/A 25JUN2054	-	200,000	-	(200,000)	-
HOME DEPOT INC 5.4% S/A 25JUN2064	-	200,000	-	(200,000)	-
HOME DEPOT INC S+0.33% Q 24DEC2025	-	400,000	-	-	400,000
HSBC HLDGS PLC 3.803% S/A 11MAR2025 (CALLED)	1,000,000	-	-	(1,000,000)	-
HSBC HLDGS PLC 4.25% S/A 14MAR2024	2,395,000	-	-	(2,395,000)	-
HSBC HLDGS PLC 6.375% S/A PERP	-	1,000,000	-	-	1,000,000
HSBC HLDGS PLC 6.375% S/A PERP	-	200,000	-	-	200,000
HUAFA 2021 I CO LTD 4.25% S/A PERP	-	1,000,000	-	-	1,000,000
HUARONG FINANCE 2019 CO LTD 3.25% S/A 13NOV2024	-	1,500,000	-	-	1,500,000
HUARONG FINANCE 2019 CO LTD 3.375% S/A 24FEB2030	200,000	-	-	-	200,000
HUARONG FINANCE 2019 CO LTD 3.75% S/A 29MAY2024	1,200,000	1,800,000	-	(3,000,000)	-
HUARONG FINANCE 2019 CO LTD 4.25% S/A PERP	600,000	-	-	-	600,000
HUARONG FINANCE II CO LTD 5.5% S/A 16JAN2025	-	1,000,000	-	-	1,000,000
HUMANA INC 5.375% S/A 15APR2031	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-
HYATT HOTELS CORP 5.25% S/A 30JUN2029	-	200,000	-	(200,000)	-
HYATT HOTELS CORP 5.5% S/A 30JUN2034	-	200,000	-	(200,000)	-
HYUNDAI CAPITAL AMERICA 5.25% S/A 08JAN202 REGS	-	250,000	-	(250,000)	-
HYUNDAI CAPITAL AMERICA 5.3% S/A 08JAN2029 REGS	-	250,000	-	(250,000)	-
HYUNDAI CAPITAL AMERICA 5.4% S/A 08JAN2031 REGS	-	250,000	-	(250,000)	-
HYUNDAI CAPITAL AMERICA S+1.04% Q 19MAR2027	-	1,000,000	-	-	1,000,000
HYUNDAI CAPITAL SERVICES INC 5.125% S/A 05FEB2027 REGS	-	400,000	-	(400,000)	-
HYUNDAI CAPITAL SERVICES INC 5.125% S/A 05FEB2029 REGS	-	200,000	-	(200,000)	-

华夏精选固定收益配置基金
(华夏精选基金的子基金)

投资组合持有变动表 (未审计) (续)

自 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

	2024 年 1 月 1 日	持有量的变动 增加	红利/ 股息	处置	2024 年 6 月 30 日
债务证券 (续)					
HYUNDAI CARD CO LTD 5.75% S/A 24APR2029	-	200,000	-	(200,000)	-
IBM INTERNAT CAPITAL PTE LTD 4.6% S/A 05FEB2027	-	5,000,000	-	(5,000,000)	-
IBM INTERNAT CAPITAL PTE LTD 4.6% S/A 05FEB2029	-	700,000	-	(700,000)	-
IBM INTERNAT CAPITAL PTE LTD 4.75% S/A 05FEB2031	-	700,000	-	(700,000)	-
IBM INTERNAT CAPITAL PTE LTD 4.9% S/A 05FEB2034	-	300,000	-	(300,000)	-
IBM INTERNAT CAPITAL PTE LTD 5.25% S/A 05FEB2044	-	700,000	-	(700,000)	-
IBM INTERNAT CAPITAL PTE LTD 5.3% S/A 05FEB2054	-	700,000	-	(700,000)	-
INDIKA ENERGY TBK PT 8.75% S/A 05JUL2029 REGS	-	550,000	-	(550,000)	-
ING GROEP NV 6.75% S/A PERP	800,000	1,800,000	-	(2,600,000)	-
INGERSOLL-RAND INC 5.176% S/A 15JUN2029	-	400,000	-	(400,000)	-
INGERSOLL-RAND INC 5.314% S/A 15JUN2031	-	400,000	-	(400,000)	-
INGERSOLL-RAND INC 5.45% S/A 15JUN2034	-	400,000	-	(400,000)	-
INTEL CORP 5.6% S/A 21FEB2054	-	750,000	-	(750,000)	-
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC 5.25% S/A 15JUN2031	-	200,000	-	(200,000)	-
INVERSIONES CMPC SA 6.125% S/A 26FEB2034 REGS	-	700,000	-	-	700,000
JINAN SHUNTONG INTERNATIONAL CO LTD 6.7% S/A 18NOV2024	2,600,000	-	-	-	2,600,000
JIUJIANG MUNICIPAL DEVELOPMENT GROUP CO LTD 6.55% S/A 8MAY2027	-	300,000	-	-	300,000
JOHN DEERE CAPITAL CORP 5.1% S/A 11APR2034	-	400,000	-	(400,000)	-
JOY TREASURE ASSETS HLDGS INC 5.5% S/A 1FEB2027	-	500,000	-	(500,000)	-
KELLOGG CO 5.75% S/A 16MAY2054	-	200,000	-	(200,000)	-
KODIT GLOBAL 2024-1 LTD 5.357 S/A 29MAY2027	-	750,000	-	-	750,000
KOREA DEVELOPMENT BANK 3M S+0.7% Q 23OCT2026	600,000	-	-	-	600,000
KOREA EXPRESSWAY CORP 5% S/A 14MAY2027 REGS	-	500,000	-	(500,000)	-
KOREA INVESTMENT & SECURITITES CO LTD 6.875% S/A 06NOV2026	1,900,000	-	-	-	1,900,000

华夏精选固定收益配置基金
(华夏精选基金的子基金)

投资组合持有变动表 (未审计) (续)

自 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

	2024 年 1 月 1 日	持有量的变动 增加	红利/ 股息	处置	2024 年 6 月 30 日
债务证券 (续)					
KOREA LAND & HOUSING CORP 5.75% S/A 06OCT2025	1,000,000	-	-	-	1,000,000
KOREA MINE REHABILITATION & MINERAL RESOURCES CORP 5.125% S/A 08MAY2029	-	300,000	-	(300,000)	-
KOREA NATIONAL OIL CORP 3M S+0.83% Q 03APR2027	-	750,000	-	-	750,000
KOREA NATIONAL OIL CORP 4.875% S/A 03APR2027 REGS	-	750,000	-	(750,000)	-
KOREA NATIONAL OIL CORP 4.875% S/A 03APR2029 REGS	-	500,000	-	(500,000)	-
KRAKATAU POSCO PT 6.375% S/A 11JUN2027	-	250,000	-	-	250,000
KRAKATAU POSCO PT 6.375% S/A 11JUN2029	-	300,000	-	(300,000)	-
KSA SUKUK LTD 5.25% S/A 04JUN2027 REGS	-	1,600,000	-	(1,600,000)	-
KSA SUKUK LTD 5.25% S/A 04JUN2030 REGS	-	2,000,000	-	(2,000,000)	-
KSA SUKUK LTD 5.25% S/A 4JUN2034 REGS	-	2,000,000	-	(2,000,000)	-
LG ELECTRONICS 5.625 S/A 24APR2027	-	700,000	-	(700,000)	-
LG ELECTRONICS INC 5.625% S/A 24APR2029 REGS	-	350,000	-	(350,000)	-
LG ENERGY SOLUTION 5.375% S/A 02JUL2027 REGS	-	500,000	-	-	500,000
LG ENERGY SOLUTION 5.375% S/A 02JUL2029 REGS	-	800,000	-	(800,000)	-
LG ENERGY SOLUTION 5.5% S/A 02JUL2034 REGS	-	500,000	-	(500,000)	-
LLOYDS BANKING GROUP PLC 5.462% A 05JAN2028	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-
LLOYDS BANKING GROUP PLC 5.679% S/A 05JAN2035	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-
LLOYDS BANKING GROUP PLC 7.5% Q PERP (CALLED)	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-
LOCKHEED MARTIN 4.5% S/A 15FEB2029	-	800,000	-	(800,000)	-
LOCKHEED MARTIN 4.8% S/A 15AUG2034	-	200,000	-	(200,000)	-
LOCKHEED MARTIN 5.2% S/A 15FEB2064	-	200,000	-	(200,000)	-
LSEGA FINANCING PLC 5.297% S/A 28MAR2034 REGS	-	250,000	-	(250,000)	-
MACQUARIE GROUP LTD S+1.2% Q 07DEC2026 REGS	500,000	-	-	-	500,000
MARRIOTT INTL 4.875% S/A 15MAY2029	-	500,000	-	(500,000)	-

华夏精选固定收益配置基金
(华夏精选基金的子基金)

投资组合持有变动表 (未审计) (续)

自 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

	2024 年 1 月 1 日	持有量的变动 增加	红利/ 股息	处置	2024 年 6 月 30 日
债务证券 (续)					
MARRIOTT INTL 5.3% S/A 15MAY2034	-	500,000	-	(500,000)	-
MASTERCARD INC 4.875% S/A 09MAY2034	-	500,000	-	(500,000)	-
MDGH SUKUK LTD 4.959% S/A 04APR2034	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-
MEITUAN DIANPING 3.05% S/A 28OCT2030 REGS	-	700,000	-	-	700,000
MERCEDES-BENZ FINANCE NORTH AMERICA LLC 4.8% S/A 11JAN2027	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-
MERCEDES-BENZ FINANCE NORTH AMERICA LLC 4.85% S/A 11JAN2029	-	500,000	-	(500,000)	-
MERCEDES-BENZ FINANCE NORTH AMERICA LLC 5% S/A 11JAN2034	-	300,000	-	(300,000)	-
METROPOLITAN BANK & TRUST CO 5.375% S/A 6MAR2029	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-
METROPOLITAN BANK & TRUST CO 5.5% S/A 6MAR2034	-	700,000	-	(700,000)	-
MEXICO GOVERNMENT INTL BOND 6% S/A 07MAY2036	-	700,000	-	(700,000)	-
MEXICO GOVERNMENT INTL BOND 6.4% S/A 07MAY2054	-	300,000	-	(300,000)	-
MGM CHINA HLDGS LTD 7.125% S/A 01FEB2027 REGS	-	250,000	-	-	250,000
MICRON TECHNOLOGY INC 6.75% S/A 01NOV2029	-	200,000	-	(200,000)	-
MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD 1.375% S/A 07JUL2024	-	500,000	-	(500,000)	-
MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD 5.875% S/A 26JAN2027	-	200,000	-	-	200,000
MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD 6% S/A 26JAN2029	-	700,000	-	-	700,000
MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD 6.875% S/A 26JUL2026	1,500,000	-	-	-	1,500,000
mitsubishi UFJ FINANCIAL GROUP INC 5.063% S/A 12SEP2025	-	300,000	-	(300,000)	-
mitsubishi UFJ FINANCIAL GROUP INC 8.2% S/A PERP	-	1,000,000	-	-	1,000,000
MIZUHO FINANCIAL GROUP CAYMAN 3 LTD 4.6% S/A 27MAR2024 REGS	2,836,000	-	-	(2,836,000)	-
MIZUHO FINANCIAL GROUP INC 5.579% S/A 26MAY2035	-	800,000	-	(800,000)	-
MORGAN STANLEY 0.79% S/A 30MAY2025 (CALLED)	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-
MORGAN STANLEY 5.972% S/A 07FEB2039	-	300,000	-	(300,000)	-
MORGAN STANLEY BANK NA S+1.165% Q 30OCT2026	1,200,000	-	-	-	1,200,000

华夏精选固定收益配置基金
(华夏精选基金的子基金)

投资组合持有变动表 (未审计) (续)

自 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

	2024 年 1 月 1 日	持有量的变动 增加	红利/ 股息	处置	2024 年 6 月 30 日
债务证券 (续)					
MUTHOOT FINANCE LTD 7.125% S/A 14FEB2028 REGS	-	350,000	-	(350,000)	-
NAN FUNG TREASURY LTD 3.625% S/A 27AUG2030	-	1,000,000	-	-	1,000,000
NANYANG COMMERCIAL BANK LTD 3.8% S/A 20NOV2029	-	1,000,000	-	-	1,000,000
NATIONAL GRID GAS PLC 5.418% S/A 11JAN2034	-	1,200,000	-	(1,200,000)	-
NEVADA POWER CO 5.625% S/A 01FEB2054	-	300,000	-	(300,000)	-
NEXTERA ENERGY CAPITAL HLDGS INC 6.051% S/A 01MAR2025	1,100,000	-	-	(1,100,000)	-
NIPPON LIFE INSURANCE CO 5.1% S/A 16OCT2044 REGS	1,500,000	-	-	-	1,500,000
NISSAN MOTOR ACCEPTANCE CORP 6.95% S/A 15SEP2026 REGS	1,200,000	-	-	-	1,200,000
NISSAN MOTOR ACCEPTANCE CORP 7.05% S/A 15SEP2028 REGS	1,200,000	-	-	-	1,200,000
NTT FINANCE CORP 5.104% S/A 02JUL2027 REGS	-	1,900,000	-	(1,900,000)	-
NTT FINANCE CORP 5.11% S/A 02JUL2029 REGS	-	5,700,000	-	(5,700,000)	-
NTT FINANCE CORP 5.136% S/A 02JUL2031 REGS	-	1,250,000	-	(1,250,000)	-
NUTRIEN LTD 5.4% S/A 21JUN2034	-	240,000	-	(240,000)	-
NUVEEN LLC 5.85% S/A 15APR2034 REGS	-	200,000	-	(200,000)	-
O'REILLY AUTOMOTIVE INC 5.75% S/A 20NOV2026	200,000	-	-	-	200,000
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP LTD 5.52% S/A 21MAY2034	-	200,000	-	-	200,000
PANAMA GOVERNMENT INTL BOND 7.5% S/A 01MAR2031	-	300,000	-	(300,000)	-
PANAMA GOVERNMENT INTL BOND 7.875% S/A 01MAR2057	-	300,000	-	(300,000)	-
PANAMA GOVERNMENT INTL BOND 8% S/A 01MAR2038	-	300,000	-	(300,000)	-
PEAK RE BVI HLDG LTD 5.35% S/A PERP	-	1,000,000	-	-	1,000,000
PERENTI FINANCE PTY LTD 7.5% S/A 26APR2029	-	300,000	-	(300,000)	-
PLAINS ALL AMERICAN PIPELINE LP/PAA FINANCE CORP 5.7% S/A 15SEP2034	-	500,000	-	(500,000)	-
POLY REAL ESTATE FINANCE LTD 3.875% S/A 25MAR2024	1,000,000	-	-	(1,000,000)	-
POSCO 4.875% S/A 23JAN2027 REGS	-	800,000	-	(800,000)	-

华夏精选固定收益配置基金
(华夏精选基金的子基金)

投资组合持有变动表 (未审计) (续)

自 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

	2024 年 1 月 1 日	持有量的变动 增加	红利/ 股息	处置	2024 年 6 月 30 日
债务证券 (续)					
PROLOGIS LP 3.5% S/A 06FEB2027	-	3,000,000	-	(3,000,000)	-
PRUDENTIAL FINANCIAL INC 6.5% S/A 15MAR2054	-	400,000	-	(400,000)	-
PUGET SOUND ENERGY INC 5.33% S/A 15JUN2034	-	1,600,000	-	(1,600,000)	-
PUGET SOUND ENERGY INC 5.685% S/A 15JUN2054	-	1,250,000	-	(1,250,000)	-
QBE INSURANCE GROUP LTD 6.75% S/A 02DEC2044	-	1,200,000	-	-	1,200,000
RAIZEN FUELS FINANCE 6.45% S/A 05MAR2034	-	200,000	-	-	200,000
RAIZEN FUELS FINANCE 6.95% S/A 05MAR2054	-	200,000	-	(200,000)	-
REGIONS FINANCIAL CORP 5.722% S/A 06JUN2030	-	200,000	-	(200,000)	-
REP OF CHILE 4.85% S/A 22JAN2029	-	300,000	-	(300,000)	-
REPUBLIC OF POLAND GOVERNMENT INTL BOND 4.625% S/A 18MAR2029	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-
REPUBLIC OF POLAND GOVERNMENT INTL BOND 5.125% S/A 18SEP2034	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-
REPUBLIC OF POLAND GOVERNMENT INTL BOND 5.5% S/A 18MAR2054	-	500,000	-	(500,000)	-
RGA GLOBAL FUNDING 5.448% S/A 24MAY2029	-	200,000	-	(200,000)	-
ROTHESAY LIFE PLC 7.019% S/A 10DEC2034	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-
ROYAL BANK OF CANADA 5.15% S/A 01FEB2034	-	250,000	-	(250,000)	-
ROYAL BANK OF CANADA 7.5% Q 02MAY2084	-	200,000	-	(200,000)	-
ROYALTY PHARMA PLC 5.15% S/A 02SEP2029 REGS	-	362,500	-	(362,500)	-
ROYALTY PHARMA PLC 5.4% S/A 02SEP2034 REGS	-	250,000	-	(250,000)	-
ROYALTY PHARMA PLC 5.9% S/A 02SEP2054 REGS	-	500,000	-	(500,000)	-
SAUDI ELECTRICITY SUKUK PROGRAMME CO 4.942% S/A 13FEB2029	-	2,000,000	-	(2,000,000)	-
SAUDI ELECTRICITY SUKUK PROGRAMME CO 5.194% S/A 13FEB2034	-	2,000,000	-	(2,000,000)	-
SAUDI GOVERNMENT INTL BOND 5% S/A 16JAN2034 REGS	-	4,700,000	-	(4,700,000)	-
SAUDI GOVERNMENT INTL BOND 5.75% S/A 16JAN2054 REGS	-	200,000	-	(200,000)	-
SCIENCE CITY GUANGZHOU INVESTMENT GROUP CO LTD 6.8% S/A 05AUG2025	-	1,000,000	-	-	1,000,000

华夏精选固定收益配置基金
(华夏精选基金的子基金)

投资组合持有变动表 (未审计) (续)

自 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

	2024 年 1 月 1 日	持有量的变动 增加	红利/ 股息	处置	2024 年 6 月 30 日
债务证券 (续)					
SF HLDG INVESTMENT 2021 LTD 3.125% S/A 17NOV2031	-	500,000	-	-	500,000
SHANGHAI COMMERCIAL BANK LTD 5% S/A 17JAN2029	2,300,000	-	-	(2,300,000)	-
SHINHAN BANK CO LTD 5.75% S/A 15APR2034 REGS	-	500,000	-	(500,000)	-
SHINHAN CARD CO LTD 2.5% S/A 27JAN2027	-	500,000	-	(500,000)	-
SHINHAN FINANCIAL GROUP CO LTD 2.875% S/A PERP REGS	-	1,500,000	-	-	1,500,000
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE CO LTD 6.625% S/A 22APR2027 REGS	-	700,000	-	(700,000)	-
SINGAPORE AIRLINES LTD 5.25% S/A 21MAR2034	-	800,000	-	-	800,000
SK BATTERY AMERICA INC 4.875% S/A 23JAN2027	-	400,000	-	(400,000)	-
SMFG PREFERRED 6.6% S/A PERP	-	500,000	-	(500,000)	-
SOCIETE GENERALE SA 5% S/A 17JAN2024 REGS	2,000,000	-	-	(2,000,000)	-
SOCIETE GENERALE SA 5.519% S/A 19JAN2028 REGS	-	3,000,000	-	(3,000,000)	-
SOCIETE GENERALE SA 7.132% S/A 19JAN2055 REGS	-	1,250,000	-	(1,250,000)	-
SOCIETE GENERALE SA 8% S/A PERP	-	1,000,000	-	-	1,000,000
SOCIETE GENERALE SA 8.5% S/A PERP	-	1,300,000	-	(1,300,000)	-
ST MARYS CEMENT INC CANADA 5.75% S/A 02APR2034 REGS	-	200,000	-	(200,000)	-
STANDARD CHARTERED PLC 5.905% S/A 14MAR2035 REGS	-	700,000	-	(700,000)	-
STANDARD CHARTERED PLC 6% S/A PERP	-	300,000	-	-	300,000
STANDARD CHARTERED PLC 7.75% S/A PERP REGS	-	350,000	-	-	350,000
STANDARD CHARTERED PLC S+1.93% Q 06JUL2027 REGS	1,000,000	-	-	-	1,000,000
STATE BANK OF INDIA/LONDON 5% S/A 18JAN2024 REGS	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-
STRYKER CORP 4.85% S/A 08DEC2028	250,000	-	-	(250,000)	-
SUMITOMO LIFE INSURANCE CO 5.875% S/A PERP REGS	-	1,800,000	-	(1,800,000)	-
SUMITOMO MITSUI FINANCE & LEASING CO LTD 5.109% S/A 23JAN2029	-	700,000	-	(700,000)	-

华夏精选固定收益配置基金
(华夏精选基金的子基金)

投资组合持有变动表 (未审计) (续)

自 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

	2024 年 1 月 1 日	持有量的变动 增加	红利/ 股息	处置	2024 年 6 月 30 日
债务证券 (续)					
SUMITOMO MITSUI FINANCIAL GROUP INC 4.436% S/A 02APR2024 REGS	200,000	-	-	(200,000)	-
SUMITOMO MITSUI TRUST BANK LTD 5.35% S/A 7MAR2034	-	500,000	-	(500,000)	-
SUNTORY HLDGS LTD 5.124% S/A 11JUN2029	-	750,000	-	(750,000)	-
SVENSKA HANDELSBANKEN AB S+1.25% Q 15JUN2026 REGS	1,000,000	-	-	-	1,000,000
SWEDBANK AB 5.625% S/A PERP	-	1,000,000	-	-	1,000,000
SWISS RE FINANCE LUXEMBOURG SA 4.25% A PERP	-	1,400,000	-	-	1,400,000
TAKEDA PHARMACEUTICAL CO LTD 5.3% S/A 5JUL2034	-	1,500,000	-	-	1,500,000
TAKEDA PHARMACEUTICAL CO LTD 5.65% S/A 05JUL2044	-	2,000,000	-	-	2,000,000
TAKEDA PHARMACEUTICAL CO LTD 5.65% S/A 5JUL2054	-	3,000,000	-	-	3,000,000
TAKEDA PHARMACEUTICAL CO LTD 5.8% S/A 5JUL2064	-	1,000,000	-	-	1,000,000
TD SYNnex CORP 6.1% S/A 12APR2034	-	200,000	-	(200,000)	-
TEXAS INSTRUMENTS INC 4.6% S/A 08FEB2027	-	1,100,000	-	(1,100,000)	-
TEXAS INSTRUMENTS INC 4.6% S/A 08FEB2029	-	1,100,000	-	(1,100,000)	-
TEXAS INSTRUMENTS INC 5.05% S/A 18MAY2063	-	400,000	-	(400,000)	-
TEXAS INSTRUMENTS INC 5.15% S/A 08FEB2054	-	400,000	-	(400,000)	-
T-MOBILE USA INC 4.85% S/A 15JAN2029	-	200,000	-	(200,000)	-
T-MOBILE USA INC 5.15% S/A 15APR2034	-	250,000	-	(250,000)	-
T-MOBILE USA INC 5.5% S/A 15JAN2055	-	250,000	-	(250,000)	-
TOWNGAS FINANCE LTD 4.75% S/A PERP	1,500,000	-	-	(1,500,000)	-
TPG OPERATING GROUP II LP 5.875% S/A 05MAR2034	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-
TRUIST FINANCIAL CORP 5.435% S/A 24JAN2030	-	500,000	-	(500,000)	-
TRUIST FINANCIAL CORP 5.711% S/A 24JAN2035	-	600,000	-	(600,000)	-
TRUST FIBRA UNO 7.375% S/A 13FEB2034 REGS	-	1,700,000	-	(1,700,000)	-
TYSON FOODS INC 5.4% S/A 15MAR2029	-	200,000	-	(200,000)	-

华夏精选固定收益配置基金
(华夏精选基金的子基金)

投资组合持有变动表 (未审计) (续)

自 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

	2024 年 1 月 1 日	持有量的变动 增加	红利/ 股息	处置	2024 年 6 月 30 日
债务证券 (续)					
TYSON FOODS INC 5.7% S/A 15MAR2034	-	200,000	-	(200,000)	-
UBS GROUP AG 4.49% S/A 05AUG2025 REGS	1,000,000	-	-	-	1,000,000
UBS GROUP AG 5.699% S/A 08FEB2035 REGS	-	500,000	-	(500,000)	-
UBS GROUP AG 9.25% S/A PERP UBS GROUP FUNDING SWITZERLAND AG 6.875% S/A PERP	-	400,000	-	-	400,000
UBS GROUP FUNDING SWITZERLAND AG 7% S/A PERP (CALLED)	800,000	-	-	(800,000)	-
UNITEDHEALTH GROUP INC 5% S/A 15APR2034	-	600,000	-	(600,000)	-
VERIZON COMMUNICATIONS INC 5.5% S/A 23FEB2054	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-
VERTEX CAPITAL INVESTMENT LTD 2.85% S/A 28JUL2026	-	250,000	-	(250,000)	-
VODAFONE GROUP PLC 5.75% S/A 28JUN2054	-	2,800,000	-	(2,000,000)	800,000
VODAFONE GROUP PLC 5.875% S/A 28JUN2064	-	2,100,000	-	(1,200,000)	900,000
VOLKSWAGEN GROUP OF AMERICA FINANCE LLC 6% S/A 16NOV2026 REGS	750,000	-	-	-	750,000
WEIBO CORP 3.5% S/A 05JUL2024	2,500,000	-	-	(2,500,000)	-
WENS FOODSTUFFS GROUP CO LTD 2.349% S/A 29OCT2025	-	500,000	-	-	500,000
WHIRLPOOL CORP 5.75% S/A 01MAR2034	-	400,000	-	(400,000)	-
WILLIAMS COS INC 4.9% S/A 15MAR2029	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-
WISCONSIN POWER AND LIGHT CO 5.95% S/A 30MAR2029	300,000	-	-	-	300,000
WOORI BANK 1.03161% S/A 21MAY2024	500,000	-	-	(500,000)	-
ZHEJIANG BOXIN BVI LTD 5.9% S/A 11JUN2024	2,600,000	-	-	(2,600,000)	-
ZHONGAN ONLINE P&C INSURANCE CO LTD 3.125% S/A 16JUL2025	-	1,200,000	-	-	1,200,000
ZHONGAN ONLINE P&C INSURANCE CO LTD 3.5% S/A 08MAR2026	-	500,000	-	-	500,000
ZHONGSHENG GROUP HLDGS LTD 3% S/A 13JAN2026	-	500,000	-	-	500,000

华夏精选固定收益配置基金
(华夏精选基金的子基金)

投资组合持有变动表 (未审计) (续)

自 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

	2024 年 1 月 1 日	持有量的变动 增加	红利/ 股息	处置	2024 年 6 月 30 日
集体投资计划					
CHINAAMC ASIA ESG BOND FUND- CLASS I	-	385,108	-	-	385,108
CHINAAMC GLOBAL INVESTMENT GRADE BOND FUND-I DIS USD A	1,371,407	127,790	-	(85,295)	1,413,902
CHINAAMC GLOBAL SELECTED INCOME FUND-I A USD	790,189	-	-	-	790,189
CHINAAMC SELECT MONEY MARKET FUND-I HKD	1,041,451	-	-	(1,041,451)	-
CHINAAMC SELECT RMB INVESTMENT GRADE INCOME FUND-I RMB ACC	1,947,059	-	-	(1,947,059)	-
CHINAAMC SELECT RMB INVESTMENT GRADE INCOME FUND-I USD HEDGED ACC	199,740	-	-	(16,959)	182,781
CNCB CAPITAL ASIAN INVESTMENT GRADE BOND FUND CLASS I USD ACC	-	50,000	-	-	50,000
远期外汇合约					
Buy USD960,501 Sell USD7,500,000 T/D 27/12/2023 S/D 31/01/2024	1	-	-	(1)	-
Buy CNY310,822,016 Sell USD43,991,510 T/D 18/12/2023 S/D 28/03/2024	1	-	-	(1)	-
Buy USD25,596 and Sell HKD200,000 T/D 12/01/2024 S/D 31/01/2024	-	1	-	(1)	-
Buy CNY137,791 and Sell HKD150,000 T/D 15/01/2024 S/D 31/01/2024	-	1	-	(1)	-
Buy USD12,788 and Sell HKD100,000 T/D 16/01/2024 S/D 31/01/2024	-	1	-	(1)	-
Buy USD32,021 and Sell HKD250,000 T/D 30/01/2024 S/D 01/03/2024	-	1	-	(1)	-
Buy USD1,024,654 and Sell HKD8,000,000 T/D 30/01/2024 S/D 01/03/2024	-	1	-	(1)	-
Buy USD4,232,758 and Sell CNY30,158,400 T/D 05/01/2024 S/D 28/03/2024	-	1	-	(1)	-
Buy CNY54,999,000 and Sell USD7,707,799 T/D 10/01/2024 S/D 28/03/2024	-	1	-	(1)	-
Buy CNY337,632,665 and Sell USD47,185,715 T/D 19/03/2024 S/D 28/06/2024	-	1	-	(1)	-
Buy USD46,571,942 and Sell CNY335,662,616 T/D 20/03/2024 S/D 28/03/2024	-	1	-	(1)	-
Buy USD46,425,304 and Sell CNY337,632,665 T/D 19/06/2024 S/D 28/06/2024	-	1	-	(1)	-
Buy CNY340,392,898 and Sell USD47,160,854 T/D 19/06/2024 S/D 30/09/2024	-	1	-	-	1
	83,781,849	259,234,409	-	(247,764,277)	95,251,981

华夏精选固定收益配置基金
(华夏精选基金的子基金)

金融衍生工具的详情 (未审计)

于2024年6月30日, 本子基金持有的金融衍生工具详情如下:

远期外汇合约

合约交付金额	汇兑金额	结算日	交易对手	公允价值 美元
<u>金融负债:</u>				
美元 47,160,854	人民币340,392,898	30/09/2024	中国银行(香港)有限公司	<u>(128,586)</u>

华夏精选固定收益配置基金
(华夏精选基金的子基金)

投资组合列表 (未审计)

2024年6月30日

	票面价值 美元	公允价值 美元	在资产净值 中的占比
上市/挂牌投资			
债务证券			
奥地利			
QBE INSURANCE GROUP LTD 6.75% S/A 02DEC2044	1,200,000	1,200,852	0.96%
加拿大			
BANK OF MONTREAL 4.8% S/A PERP	1,000,000	988,190	0.79%
开曼群岛			
CHINA HONGQIAO GROUP LTD 7.75% S/A 27MAR2025	700,000	704,697	0.56%
FWD GROUP LTD 5.75% S/A 09JUL2024	1,000,000	999,060	0.80%
FWD GROUP LTD 7.635% S/A 02JUL2031	1,200,000	1,218,444	0.97%
GEELY AUTOMOBILE HLDGS LTD 4% S/A PERP	1,000,000	987,530	0.79%
MEITUAN DIANPING 3.05% S/A 28OCT2030 REGS	700,000	602,462	0.48%
MGM CHINA HLDGS LTD 7.125% S/A 01FEB2027 REGS	250,000	251,763	0.20%
ZHONGSHENG GROUP HLDGS LTD 3% S/A 13JAN2026	500,000	476,645	0.38%
		<hr/> 5,240,601	<hr/> 4.18%
智利			
INVERSIONES CMPC SA 6.125% S/A 26FEB2034 REGS	700,000	713,412	0.57%
中国内地			
JIUJIANG MUNICIPAL DEVELOPMENT GROUP CO LTD 6.55% S/A 8MAY2027	300,000	301,038	0.24%
SCIENCE CITY GUANGZHOU INVESTMENT GROUP CO LTD 6.8% S/A 05AUG2025	1,000,000	1,007,710	0.80%
WENS FOODSTUFFS GROUP CO LTD 2.349% S/A 29OCT2025	500,000	469,955	0.37%
ZHONGAN ONLINE P&C INSURANCE CO LTD 3.125% S/A 16JUL2025	1,200,000	1,160,592	0.93%
ZHONGAN ONLINE P&C INSURANCE CO LTD 3.5% S/A 08MAR2026	500,000	477,025	0.38%
		<hr/> 3,416,320	<hr/> 2.72%
法国			
SOCIETE GENERALE SA 8% S/A PERP	1,000,000	998,720	0.80%

华夏精选固定收益配置基金
(华夏精选基金的子基金)

投资组合列表 (未审计) (续)

2024年6月30日

	票面价值 美元	公允价值 美元	在资产净值 中的占比
上市/挂牌投资 (续)			
<u>债务证券 (续)</u>			
德国			
DEUTSCHE BANK AG/NEW YORK 5.414% S/A 10MAY2029	500,000	499,905	0.40%
DEUTSCHE BANK AG/NEW YORK 6.819% S/A 20NOV2029	1,000,000	1,041,070	0.83%
		1,540,975	1.23%
香港特别行政区			
AIA GROUP LTD 2.7% S/A PERP	1,000,000	939,710	0.75%
BANK OF EAST ASIA LTD 4.875% S/A 22APR2032	520,000	494,499	0.39%
BANK OF EAST ASIA LTD 5.825% S/A PERP	1,000,000	980,220	0.78%
BANK OF EAST ASIA LTD 5.875% S/A PERP	2,500,000	2,489,750	1.99%
BANK OF EAST ASIA LTD 6.625% S/A 13MAR2027	500,000	502,680	0.40%
BANK OF EAST ASIA LTD 6.75% S/A 27JUN2034	200,000	198,822	0.16%
CHINA CITIC BANK INTL LTD 6% S/A 05DEC2023	880,000	905,098	0.72%
CHINA LIFE INSURANCE OVERSEAS CO LTD/HONG KONG 5.35% S/A 15AUG2033	500,000	504,045	0.40%
CHINA PING AN INSURANCE OVERSEAS HLDGS LTD 6.125% S/A 16MAY2034	300,000	306,258	0.24%
CHINA TAIPING INSURANCE HLDGS CO LTD 6.4% S/A PERP	1,000,000	1,039,540	0.83%
CHIYU BANKING CORP LTD 5.75% S/A 07APR2032	250,000	237,498	0.19%
CHONG HING BANK LTD 5.7% S/A PERP (CALLED)	1,350,000	1,347,759	1.07%
JINAN SHUNTONG INTERNATIONAL CO LTD 6.7% S/A 18NOV2024	2,600,000	2,606,343	2.08%
NANYANG COMMERCIAL BANK LTD 3.8% S/A 20NOV2029	1,000,000	991,670	0.79%
		13,543,892	10.79%
印度尼西亚			
KRAKATAU POSCO PT 6.375% S/A 11JUN2027	250,000	251,405	0.20%
日本			
ASAHI MUTUAL LIFE INSURANCE CO 6.9% S/A PERP	800,000	823,784	0.66%
DAI-ICHI LIFE INSURANCE CO LTD 5.1% S/A PERP REGS	350,000	348,719	0.28%
DAI-ICHI LIFE INSURANCE CO LTD 5.1% S/A PERP REGS	1,000,000	1,074,620	0.86%
NIPPON LIFE INSURANCE CO 5.1% S/A 16OCT2044 REGS	1,500,000	1,494,645	1.19%
		3,741,768	2.99%

华夏精选固定收益配置基金
(华夏精选基金的子基金)

投资组合列表 (未审计) (续)

2024年6月30日

	票面价值 美元	公允价值 美元	在资产净值 中的占比
上市/挂牌投资 (续)			
<u>债务证券 (续)</u>			
韩国			
HANA BANK 5.75% S/A 24OCT2028 REGS	500,000	516,075	0.41%
KODIT GLOBAL 2024-1 LTD 5.357 S/A 29MAY2027	750,000	752,715	0.60%
KOREA DEVELOPMENT BANK 3M S+0.7% Q 23OCT2026	600,000	602,112	0.48%
KOREA INVESTMENT & SECURITIES CO LTD 6.875% S/A 06NOV2026	1,900,000	1,939,824	1.55%
KOREA LAND & HOUSING CORP 5.75% S/A 06OCT2025	1,000,000	1,003,860	0.80%
KOREA NATIONAL OIL CORP 3M S+0.83% Q 03APR2027	750,000	754,013	0.60%
LG ENERGY SOLUTION 5.375% S/A 02JUL2027 REGS	500,000	497,650	0.40%
MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD 5.875% S/A 26JAN2027	200,000	199,608	0.16%
MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD 6% S/A 26JAN2029	700,000	708,561	0.57%
MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD 6.875% S/A 26JUL2026	1,500,000	1,527,390	1.22%
SHINHAN FINANCIAL GROUP CO LTD 2.875% S/A PERP REGS	1,500,000	1,409,820	1.12%
		9,911,628	7.91%
卢森堡			
SWISS RE FINANCE LUXEMBOURG SA 4.25% A PERP	1,400,000	1,389,346	1.11%
新加坡			
CATHAYLIFE SINGAPORE PTE LTD 5.95% S/A 05JUL2034	900,000	900,918	0.72%
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP LTD 5.52% S/A 21MAY2034	200,000	201,116	0.16%
SINGAPORE AIRLINES LTD 5.25% S/A 21MAR2034	800,000	822,784	0.66%
		1,924,818	1.54%
瑞典			
SWEDBANK AB 5.625% S/A PERP	1,000,000	996,180	0.79%

华夏精选固定收益配置基金
(华夏精选基金的子基金)

投资组合列表 (未审计) (续)

2024年6月30日

	票面价值 美元	公允价值 美元	在资产净值 中的占比
上市/挂牌投资 (续)			
<u>债务证券 (续)</u>			
瑞士			
UBS GROUP AG 4.49% S/A 05AUG2025 REGS	1,000,000	998,480	0.80%
UBS GROUP AG 9.25% S/A PERP	400,000	429,948	0.34%
UBS GROUP FUNDING SWITZERLAND AG 6.875% S/A PERP	400,000	447,972	0.36%
		1,876,400	1.50%
英国			
HSBC HLDGS PLC 6.375% S/A PERP	200,000	199,808	0.16%
STANDARD CHARTERED PLC 7.75% S/A PERP REGS	350,000	353,416	0.28%
STANDARD CHARTERED PLC S+1.93% Q 06JUL2027 REGS	1,000,000	1,018,280	0.81%
		1,571,504	1.25%
美国			
MORGAN STANLEY BANK NA S+1.165% Q 30OCT2026	1,200,000	1,216,104	0.97%

华夏精选固定收益配置基金
(华夏精选基金的子基金)

投资组合列表 (未审计) (续)

2024年6月30日

	票面价值 美元	公允价值 美元	在资产净值 中的占比
上市/挂牌投资 (续)			
<u>债务证券 (续)</u>			
英属维尔京群岛			
CHINA CINDA 2020 I MANAGEMENT LTD 5.75% S/A 28MAY2029	1,000,000	999,950	0.80%
CHINA GREAT WALL INTL HLDGS IV LTD 3.95% S/A PERP	2,000,000	1,995,080	1.59%
CHINA GREAT WALL INTL HLDGS VI LTD 7.15% S/A PERP	600,000	602,370	0.48%
CLP POWER HK FINANCE LTD 3.55% S/A PERP	500,000	492,585	0.39%
COASTAL EMERALD LTD 6.5% S/A PERP	2,000,000	2,034,240	1.62%
ELECT GLOBAL INVESTMENTS LTD 4.1% S/A PERP	1,880,000	1,776,713	1.42%
FORTUNE STAR BVI LTD 5.05% S/A 27JAN2027	250,000	226,135	0.18%
HUAFA 2021 I CO LTD 4.25% S/A PERP	1,000,000	996,620	0.79%
HUARONG FINANCE 2019 CO LTD 3.25% S/A 13NOV2024	1,500,000	1,481,610	1.18%
HUARONG FINANCE 2019 CO LTD 3.375% S/A 24FEB2030	200,000	169,552	0.14%
HUARONG FINANCE 2019 CO LTD 4.25% S/A PERP	600,000	579,636	0.46%
HUARONG FINANCE II CO LTD 5.5% S/A 16JAN2025	1,000,000	993,810	0.79%
NAN FUNG TREASURY LTD 3.625% S/A 27AUG2030	1,000,000	879,290	0.70%
PEAK RE BVI HLDG LTD 5.35% S/A PERP	1,000,000	970,320	0.77%
SF HLDG INVESTMENT 2021 LTD 3.125% S/A 17NOV2031	500,000	437,085	0.35%
STANDARD CHARTERED PLC 6% S/A PERP	300,000	296,277	0.24%
		<u>14,931,273</u>	<u>11.90%</u>

华夏精选固定收益配置基金
(华夏精选基金的子基金)

投资组合列表 (未审计) (续)

2024年6月30日

	票面价值 美元	公允价值 美元	在资产净值 中的占比
非上市/挂牌投资			
奥地利			
AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GROUP LTD 2.95% S/A 22JUL2030 REGS	1,500,000	1,452,900	1.16%
MACQUARIE GROUP LTD S+1.2% Q 07DEC2026 REGS	500,000	505,335	0.40%
		1,958,235	1.56%
加拿大			
BANK OF NOVA SCOTIA 4.65% S/A PERP	900,000	880,479	0.70%
智利			
CORP NACIONAL DEL COBRE DE CHILE 6.44% S/A 26JAN2036 REGS	750,000	771,863	0.62%
日本			
NISSAN MOTOR ACCEPTANCE CORP 6.95% S/A 15SEP2026 REGS	1,200,000	1,227,888	0.98%
NISSAN MOTOR ACCEPTANCE CORP 7.05% S/A 15SEP2028 REGS	1,200,000	1,247,772	1.00%
TAKEDA PHARMACEUTICAL CO LTD 5.3% S/A 5JUL2034	1,500,000	1,489,740	1.19%
TAKEDA PHARMACEUTICAL CO LTD 5.65% S/A 05JUL2044	2,000,000	1,967,380	1.57%
TAKEDA PHARMACEUTICAL CO LTD 5.65% S/A 5JUL2054	3,000,000	2,937,030	2.34%
TAKEDA PHARMACEUTICAL CO LTD 5.8% S/A 5JUL2064	1,000,000	978,260	0.78%
		9,848,070	7.86%
卢森堡			
RAIZEN FUELS FINANCE 6.45% S/A 05MAR2034	200,000	203,442	0.16%
新西兰			
BANK OF NEW ZEALAND 2.87% S/A 27JAN2032 REGS	500,000	424,765	0.34%
西班牙			
BANCO SANTANDER SA S+1.38% Q 14MAR2028	1,000,000	1,008,330	0.80%
瑞典			
SVENSKA HANDELSBANKEN AB S+1.25% Q 15JUN2026 REGS	1,000,000	1,013,710	0.81%

华夏精选固定收益配置基金
(华夏精选基金的子基金)

投资组合列表 (未审计) (续)

2024年6月30日

	票面价值 美元	公允价值 美元	在资产净值 中的占比
非上市/挂牌投资 (续)			
英国			
BP CAPITAL MARKETS PLC 6.45% S/A PERP	750,000	770,700	0.61%
HSBC HLDGS PLC 6.375% S/A PERP	1,000,000	996,940	0.80%
VODAFONE GROUP PLC 5.75% S/A 28JUN2054	800,000	778,696	0.62%
VODAFONE GROUP PLC 5.875% S/A 28JUN2064	900,000	871,272	0.69%
		3,417,608	2.72%
美国			
ARES CAPITAL CORP 7% S/A 15JAN2027	800,000	813,504	0.65%
BAT CAPITAL CORP 5.834% S/A 20FEB2031	300,000	303,615	0.24%
CATERPILLAR FINANCIAL SERVICES CORP 5% S/A 14MAY2027	500,000	500,345	0.40%
CITIBANK NA 5.57% S/A 30APR2034	1,000,000	1,012,670	0.81%
DAIMLER FINANCE NORTH AMERICA LLC S+0.96% Q 25SEP2027	550,000	550,473	0.44%
ENTERGY CORP 7.125% S/A 1DEC2054	350,000	347,620	0.28%
FORD MOTOR CREDIT CO LLC 6.125% S/A 08MAR2034	750,000	741,263	0.59%
HOME DEPOT INC S+0.33% Q 24DEC2025	400,000	400,592	0.32%
HYUNDAI CAPITAL AMERICA S+1.04% Q 19MAR2027	1,000,000	1,003,090	0.80%
O'REILLY AUTOMOTIVE INC 5.75% S/A 20NOV2026	200,000	201,830	0.16%
VOLKSWAGEN GROUP OF AMERICA FINANCE LLC 6% S/A 16NOV2026 REGS	750,000	759,218	0.61%
WISCONSIN POWER AND LIGHT CO 5.95% S/A 30MAR2029	300,000	307,251	0.25%
		6,941,471	5.55%

华夏精选固定收益配置基金
(华夏精选基金的子基金)

投资组合列表 (未审计) (续)

2024年6月30日

	票面价值 美元	公允价值 美元	在资产净值 中的占比
集体投资计划			
香港特别行政区			
CHINAAMC ASIA ESG BOND FUND-CLASS I	385,108	4,069,588	3.24%
CHINAAMC GLOBAL INVESTMENT GRADE BOND FUND-I DIS USD A	1,413,902	16,689,696	13.30%
CHINAAMC SELECT RMB INVESTMENT GRADE INCOME FUND-I USD HEDGED ACC	182,781	1,987,433	1.59%
CNCB CAPITAL ASIAN INVESTMENT GRADE BOND FUND CLASS I USD ACC	50,000	4,999,000	3.99%
		<u>27,745,717</u>	<u>22.13%</u>
卢森堡			
CHINAAMC GLOBAL SELCTED INCOME FUND-I A USD	790,189	8,719,740	6.95%
远期外汇合约			
Buy CNY 340,392,898 and Sell USD 47,160,854 (Counterparty: Bank of China (Hong Kong) Limited)		<u>(128,586)</u>	<u>-0.10%</u>
投资组合合计		<u>128,258,232</u>	<u>102.29%</u>
其他负债		<u>(2,870,869)</u>	<u>-2.29%</u>
净资产总额		<u>125,387,363</u>	<u>100.00%</u>
投资成本总额		<u>126,773,009</u>	

华夏精选固定收益配置基金
(华夏精选基金的子基金)

股息披露 (未审计)

自 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

基金管理人可以凭其绝对酌情权，决定在每个财政期间的确定时间将收益分配给基金份额持有人，或在任意财政期间不做任何分配。分配给基金份额持有人的款项（如有）可以用本子基金的资本支付或实际上用本子基金的资本间接支付。

在截至 2024 年 6 月 30 日和截至 2023 年 6 月 30 日的期间，本子基金未派发任何股息。