

# 华夏睿磐泰茂混合型证券投资基金

**2022 年中期报告**

**2022 年 6 月 30 日**

基金管理人：华夏基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二二年八月三十日

## §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。本中期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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 8 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	1
§2 基金简介.....	3
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	4
3.1 主要会计数据和财务指标.....	4
3.2 基金净值表现.....	5
§4 管理人报告.....	6
§5 托管人报告.....	11
§6 中期报告财务会计报告（未经审计）.....	12
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	14
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	16
§7 投资组合报告.....	40
7.1 期末基金资产组合情况.....	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	41
7.3 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.....	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	54
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	55
7.6 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.....	56
7.7 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.....	56
7.8 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.....	56
7.9 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.....	56
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	56
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	56
7.12 投资组合报告附注.....	57
§8 基金份额持有人信息.....	58
§9 开放式基金份额变动.....	59
§10 重大事件揭示.....	59
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	62
§12 备查文件目录.....	62

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华夏睿磐泰茂混合型证券投资基金	
基金简称	华夏睿磐泰茂混合	
基金主代码	004720	
交易代码	004720	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 12 月 6 日	
基金管理人	华夏基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	2,019,679,486.61 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华夏睿磐泰茂混合 A	华夏睿磐泰茂混合 C
下属分级基金的交易代码	004720	004721
报告期末下属分级基金的份额总额	1,310,349,951.54 份	709,329,535.07 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	通过风险均衡方法进行资产配置，积极管理，力求有效控制风险，争取实现基金资产长期持续增值。
投资策略	主要投资策略包括资产配置策略、股票投资策略、固定收益品种投资策略、资产支持证券投资策略、权证投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略、期权投资策略等。在资产配置策略上，本基金以风险均衡作为主要资产配置策略，通过平衡各资产类别对整个组合风险贡献，合理确定本基金在股票、债券等资产上的投资比例。在股票投资策略上，本基金股票投资策略分为主动量化股票投资策略和基于风险均衡的股票投资策略。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率×15%+上证国债指数收益率×85%。
风险收益特征	本基金属于混合基金，风险与收益高于债券基金与货币市场基金，低于股票基金，属于较高风险、较高收益的品种。

### 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	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李彬	秦一楠
	联系电话	400-818-6666	010-66060069
	电子邮箱	service@ChinaAMC.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-818-6666	95599
传真		010-63136700	010-68121816
注册地址		北京市顺义区安庆大街甲3号院	北京市东城区建国门内大街69号

办公地址	北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座8层	北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座F9
邮政编码	100033	100031
法定代表人	杨明辉	谷澍

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.ChinaAMC.com
基金中期报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
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 主要财务指标和基金净值表现

### 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	报告期（2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日）	
	华夏睿磐泰茂混合 A	华夏睿磐泰茂混合 C
本期已实现收益	-24,866,127.35	-16,132,533.20
本期利润	-7,926,424.29	-8,490,394.21
加权平均基金份额本期利润	-0.0063	-0.0122
本期加权平均净值利润率	-0.49%	-0.97%
本期基金份额净值增长率	-0.73%	-0.88%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)	
	华夏睿磐泰茂混合 A	华夏睿磐泰茂混合 C
期末可供分配利润	310,284,319.78	156,616,086.51
期末可供分配基金份额利润	0.2368	0.2208
期末基金资产净值	1,689,871,046.55	903,089,628.62
期末基金份额净值	1.2896	1.2732
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)	
	华夏睿磐泰茂混合 A	华夏睿磐泰茂混合 C
基金份额累计净值增长率	31.72%	29.94%

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

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

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

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

##### 华夏睿磐泰茂混合 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
过去一个月	1.25%	0.16%	1.49%	0.15%	-0.24%	0.01%
过去三个月	1.49%	0.18%	1.78%	0.23%	-0.29%	-0.05%
过去六个月	-0.73%	0.20%	0.30%	0.22%	-1.03%	-0.02%
过去一年	2.72%	0.20%	2.14%	0.19%	0.58%	0.01%
过去三年	29.13%	0.23%	14.71%	0.19%	14.42%	0.04%
自基金合同生效起至今	31.72%	0.27%	21.10%	0.20%	10.62%	0.07%

##### 华夏睿磐泰茂混合 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
过去一个月	1.22%	0.16%	1.49%	0.15%	-0.27%	0.01%
过去三个月	1.42%	0.18%	1.78%	0.23%	-0.36%	-0.05%
过去六个月	-0.88%	0.20%	0.30%	0.22%	-1.18%	-0.02%
过去一年	2.43%	0.20%	2.14%	0.19%	0.29%	0.01%
过去三年	27.98%	0.23%	14.71%	0.19%	13.27%	0.04%
自基金合同生效起至今	29.94%	0.27%	21.10%	0.20%	8.84%	0.07%

#### 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

##### 华夏睿磐泰茂混合型证券投资基金

##### 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

(2017 年 12 月 6 日至 2022 年 6 月 30 日)

##### 华夏睿磐泰茂混合 A



华夏睿磐泰茂混合 C



## §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、广州和青岛设有分公司,在香港、深圳、上海设有子公司。公司是首批全国社保基金管理人、首批企业年金基金管理人、境内首批 QDII 基金管理人、境内首只 ETF 基金管理人、境内首只沪港通 ETF 基金管理人、首批内地与香港基金互认基金管理人、首批基本养老保险基金投资管理人资格、首家加入联合国责任投资原则组织的公募基金公司、首批公募 FOF 基金管理人、首批公募养老目标基金管理人、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,以及特定客户资产管理人、保险资金投资管理人,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 ETF 基金资产管理规模最大的基金管理公司之一,在 ETF 基金管理方面积累了丰富的经验,形成了覆盖大盘蓝筹、宽基指数、中小创指数、主题指数、行业指数、Smart Beta 策略、海外市场指数、信用债指数、商品指数等较为完整的产品线。

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 2022 年 6 月 30 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:在偏股型基金(股票上限 95%)(A 类)中华夏兴和混合排序第 1/188、华夏兴华混合(A 类)排序第 16/188;在养老目标日期 FOF(2040)(A 类)中华夏养老 2040 三年持有混合(FOF)排序第 2/14;在定开偏股型基金(A 类)中华夏磐利一年定开混合(A 类)排序第 2/77、华夏磐锐一年定开混合(A 类)排序第 10/77、华夏磐益一年定开混合排序第 11/77、华夏成长精选 6 个月定开混合(A 类)排序第 24/77;在医药医疗健康行业偏股型基金(股票上下限 60%-95%)(A 类)中华夏逸享健康混合(A 类)排序第 9/52;在消费行业偏股型基金(股票上下限 60%-95%)(A 类)中华夏网购精选混合(A 类)排序第 10/53;在偏股型基金(股票上限 80%)(A 类)中华夏经典混合排序第 22/134;在偏股型基金(股票上下限 60%-95%)(A 类)中华夏行业景气混合排序第 29/905、华夏产业升级混合(A 类)排序第 55/905、华夏盛世混合排序第 67/905;在标准股票型基金(A 类)中华夏智胜价值成长股票(A 类)排序第 59/286;在灵活配置型基金(基准股票比例 60%-100%)(A 类)中华夏圆和混合(A 类)排序第 74/436。

固收与固收+产品:在 QDII 债券型基金(A 类)中华夏大中华信用债券(QDII)(A 类)排序第 1/25;在信用债指数债券型基金(A 类)中华夏亚债中国指数(A 类)排序第 3/13;在利率债指数债券型基金(A 类)中华夏中债 3-5 年政金债指数(A 类)排序第 7/98;在中短期纯债债券型基金(A 类)中华夏中短债债券(A 类)排序第 21/84;在长期纯债债券型基金(A 类)中华夏鼎航债券(A 类)排序第 28/642;在偏债型基金(A 类)中华夏睿磐泰混合(LOF)(A 类)排序第 32/350、华夏睿磐泰盛混合排序第 36/350、华夏永康添福混合(A 类)排序第 46/350、华夏睿磐泰利混合(A 类)排序第 63/350。

指数与量化产品：在 QDII 跨境股票 ETF 基金中华夏纳斯达克 100ETF (QDII) 排序第 4/19；在规模指数股票 ETF 基金中华夏中证 1000ETF 排序第 3/116、华夏中证 500ETF 排序第 18/116；在主题指数股票 ETF 联接基金(A 类)中华夏中证四川国改 ETF 联接(A 类)排序第 3/60、华夏中证央企 ETF 联接(A 类)排序第 15/60；在行业指数股票 ETF 联接基金(A 类)中华夏中证全指房地产 ETF 联接(A 类)排序第 4/24、华夏中证银行 ETF 联接(A 类)排序第 6/24；在行业指数股票 ETF 基金中华夏中证全指房地产 ETF 排序第 7/41、华夏中证银行 ETF 排序第 10/41；在规模指数股票 ETF 联接基金(A 类)中华夏中证 500ETF 联接(A 类)排序第 15/80；在主题指数股票 ETF 基金中华夏中证新能源 ETF 排序第 14/169、华夏中证四川国改 ETF 排序第 17/169、华夏中证新能源汽车 ETF 排序第 24/169。

在证券时报主办的第十七届中国基金业明星基金奖评选活动上，在最具含金量、最能体现基金公司综合实力的“年度十大明星基金公司奖”评选中，华夏基金凭借在多项业务中的优异中长期表现，成功获奖。此外，凭借 QDII 基金的良好业绩表现，以及在境内外市场的持续布局，华夏基金还获得“三年海外投资明星基金公司奖”。

在客户服务方面，2022 年上半年，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）华夏基金直销上线北京银行、广发银行快捷等支付方式，拓展支付渠道的同时交易额度也得到进一步提升，满足客户支付需求；（2）华夏基金管家客户端优化资料上传、定投收益展示等功能，增加客户操作便利性；（3）与兰州银行、九江银行、晋商银行、九州证券等代销机构合作，拓展更加丰富的客户理财渠道；（4）开展“压岁钱手账”、“基金视力表”、“与干饭人灵魂相认”、“童言童语话理财”、“FOF 产品不是小透明”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		
宋洋	本基金的基金经理	2018-04-10	-	12 年	博士。曾任嘉实基金管理有限公司研究员、投资经理。2016 年 3 月加入华夏基金管理有限公司。历任数量投资部研究员、华夏新锦图灵活配置混合型证券投资基金基金经理（2017 年 3 月 24 日至 2018 年 9 月 10 日期间）、华夏睿磐泰利六个月定期开放混合型证券投资基金基金经理（2018 年 4 月 10 日至 2019 年 2 月 26

					日期间)、华夏睿磐泰盛六个月定期开放混合型证券投资基金基金经理(2017年8月29日至2021年1月5日期间)、华夏睿磐泰盛混合型证券投资基金基金经理(2021年1月6日至2021年5月26日期间)、华夏鼎汇债券型证券投资基金基金经理(2017年3月24日至2021年8月3日期间)等。
孙蒙	本基金的基金经理助理	2018-01-30	2022-06-15	8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《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

#### 4.3 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 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54次，其中3次为投资策略需要所致，为不同基金经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易，有关基金经理已根据公司管理要

求提供决策依据；其余均为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年，全球整体仍处于疫后恢复期，增长高点已过但下行较慢，俄乌冲突、供应链重塑为过去积累的货币放松带来的经济通胀隐患火上浇油；发达市场货币政策面临着降通胀和防衰退的走钢丝境地，金融市场交易围绕着“紧缩交易”和“衰退交易”两条主线，整体表现股债均弱，美元走强，商品强势。国内方面，宏观政策转向稳增长保内需，但疫情的再度冲击打乱宏观政策和经济本身的节奏，财政支出力度较强，但面临着缺口不低的隐患；地产政策因城施策放松不止，销售恢复较为缓慢，地产主体危机难言结束，再次拿地扩张动力疲弱，对经济整体拖累仍将持续。货币政策中性偏松，金融市场流动性较为充裕，短端货币市场利率下行明显，但受到 2020 年教训，债市对 3 年以上品种始终保持了相对谨慎态度，收益率曲线较年初陡峭化下行，3 年以上基本维持；债市波动较小，杠杆票息占优。

权益市场上半年整体呈现“V 型”走势：一季度，受到国内疫情再度暴发、乌俄冲突引发的通胀担忧、能源价格上升导致企业盈利受损的预期以及整体经济不景气等多重因素影响，权益市场表现较为低迷；4 月，受到上海疫情暴发，江浙地区停产停工等因素影响，市场延续 1 季度低迷走势，呈现下行态势；5 月以来随着上海疫情控制取得阶段性成效以及复产复工等利好因素，权益市场开启反弹行情。行业层面整体分化较大：煤炭、消费者服务、交通运输、建筑、银行等板块表现较为强劲，而电子、传媒、计算机、国防军工等板块表现相对落后。

本基金报告期内，本基金股票端在对宏观周期的把握和中观的指导下，自下而上采用与反脆弱相结合的系统化主观投资策略进行组合的投资管理，仓位方面，大部分时间组合保持了较为稳定的水平，并结合组合的风险预算较一季度进行了小幅加仓操作，日常运作过程中更多的精力放在胜率和赔率框架下以组合投资为抓手，做好股票细分资产的策略配置以期增厚组合收益，同时做好组合的波动和回撤管理；债券端组合维持了偏中性的组合配置，中性久期、中性偏高杠杆水平，阶段性参与了疫情带来交易性机会。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2022 年 6 月 30 日，华夏睿磐泰茂混合 A 基金份额净值为 1.2896 元，本报告期份额净值增长率为-0.73%；华夏睿磐泰茂混合 C 基金份额净值为 1.2732 元，本报告期份额净值增长率为-0.88%，同期业绩比较基准增长率为 0.30%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，外围通胀降温缓慢，货币收紧持续，经济增长端压力更甚，欧日美可能相继进入

经济增速快速回落期，全球经济面临进一步压力。国内逐步走出奥密克戎影响，整体仍处于修复阶段，经济增速上行确定；但也需要看到出口、地产的持续压力，财政端受制于中期防风险政策定力，也面临一定的预算缺口，整体对经济的拉动有正向作用但复苏的斜率相对有限；经济政策主要的着力点在于稳就业、稳物价。财政政策预计以落实前期政策效果为主，货币政策维持合理充裕略偏多。从股票市场的投资风格上来看，预计在美债利率三季度筑顶缓解成长压力，四季度可能回落的大背景下带动成长优于价值；叠加经济预期环比改善、信用利差收敛带动小盘跑赢大盘，风格上成长占优于价值，小盘占优于大盘，整体上相对看好小盘成长风格。我们将在相对看好的资产结构上，以组合投资为抓手选择兼顾投资安全边际和景气度的股票进行投资。在债券端，预计组合仍会以偏积极心态应对下半年市场，保持一定的杠杆水平，中性偏高久期，并将密切关注长端利率债的交易性机会。

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。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

#### 4.8 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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》

相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—华夏基金管理有限公司 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本托管人认为，华夏基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认为，华夏基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

## §6 中期报告财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：华夏睿磐泰茂混合型证券投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	15,812,052.12	26,365,124.52
结算备付金		19,741,764.48	15,504,742.60
存出保证金		187,719.81	47,150.38
交易性金融资产	6.4.7.2	2,726,574,213.16	1,795,568,668.35
其中：股票投资		332,701,839.97	285,101,776.86
基金投资		-	-
债券投资		2,393,872,373.19	1,510,466,891.49
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-

买入返售金融资产	6.4.7.4	-	220,000,270.00
应收清算款		11,714,273.08	-
应收股利		-	-
应收申购款		11,094,008.01	2,170,732.99
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	14,923,212.68
资产总计		2,785,124,030.66	2,074,579,901.52
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022年6月30日</b>	<b>上年度末 2021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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		155,000,000.00	-
应付清算款		-	4,918,869.54
应付赎回款		31,868,417.48	3,773,654.40
应付管理人报酬		1,738,579.05	1,209,174.80
应付托管费		434,644.75	302,293.67
应付销售服务费		221,065.30	203,061.86
应付投资顾问费		-	-
应交税费		41,852.60	21,200.50
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	2,858,796.31	1,270,182.44
负债合计		192,163,355.49	11,698,437.21
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	2,019,679,486.61	1,595,720,328.53
未分配利润	6.4.7.8	573,281,188.56	467,161,135.78
净资产合计		2,592,960,675.17	2,062,881,464.31
负债和净资产总计		2,785,124,030.66	2,074,579,901.52

注：①报告截止日 2022 年 6 月 30 日，华夏睿磐泰茂混合 A 基金份额净值 1.2896 元，华夏睿磐泰茂混合 C 基金份额净值 1.2732 元；华夏睿磐泰茂混合基金份额总额 2,019,679,486.61 份（其中 A 类 1,310,349,951.54 份，C 类 709,329,535.07 份）。

②以下比较数据已根据本年《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>》中的资产负债表格式的要求进行列示：2021 年年度报告资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目的“本期末”余额合并列示在 2022 年中期报告资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额，2021 年年度报告资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在 2022 年中期报告资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额。

## 6.2 利润表

会计主体：华夏睿磐泰茂混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		-2,239,048.39	54,825,786.28
1.利息收入		641,578.73	9,821,845.97
其中：存款利息收入	6.4.7.9	340,610.03	111,793.04
债券利息收入		-	9,545,128.46
资产支持证券利息收入		-	61,291.29
买入返售金融资产收入		300,968.70	103,633.18
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-28,132,649.30	39,897,616.72
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-66,439,272.01	37,465,932.59
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	35,030,189.74	1,577,463.91
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	154,043.22	74,088.35
股利收益	6.4.7.14	3,122,389.75	780,131.87
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	24,581,842.05	4,973,129.29
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	670,180.13	133,194.30
<b>减：二、营业总支出</b>		14,177,770.11	4,852,230.06
1.管理人报酬		9,826,149.37	2,953,886.33
2.托管费		2,456,537.41	738,471.53
3.销售服务费		1,303,518.62	279,695.80
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		415,193.72	110,009.19
其中：卖出回购金融资产支出		415,193.72	110,009.19
6.信用减值损失	6.4.7.17	-	-
7.税金及附加		28,198.25	16,316.39
8.其他费用	6.4.7.18	148,172.74	753,850.82
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-16,416,818.50	49,973,556.22
减：所得税费用		-	-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-16,416,818.50	49,973,556.22
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-16,416,818.50	49,973,556.22

注：以下比较数据已根据本年《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>》中的利润表格式的要求进行列示：2021 年中期报告利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在 2022 年中期报告利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：华夏睿磐泰茂混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合 收益（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	1,595,720,328.53	-	467,161,135.78	2,062,881,464.31
二、本期期初净资产（基金净值）	1,595,720,328.53	-	467,161,135.78	2,062,881,464.31
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	423,959,158.08	-	106,120,052.78	530,079,210.86
（一）、综合收益总额	-	-	-16,416,818.50	-16,416,818.50
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	423,959,158.08	-	122,536,871.28	546,496,029.36
其中：1.基金申购款	1,226,066,427.48	-	335,841,718.50	1,561,908,145.98
2.基金赎回款	-802,107,269.40	-	-213,304,847.22	-1,015,412,116.62
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	2,019,679,486.61	-	573,281,188.56	2,592,960,675.17

项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合 收益 (若有)	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产 (基金净值)	632,354,005.10	-	108,325,590.14	740,679,595.24
二、本期期初净资产 (基金净值)	632,354,005.10	-	108,325,590.14	740,679,595.24
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-41,793.07	-	51,104,457.05	51,062,663.98
(一)、综合收益总额	-	-	49,973,556.22	49,973,556.22
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)	-41,793.07	-	1,130,900.83	1,089,107.76
其中: 1.基金申购款	111,495,101.23	-	21,810,099.54	133,305,200.77
2.基金赎回款	-111,536,894.30	-	-20,679,198.71	-132,216,093.01
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动 (净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
四、本期期末净资产 (基金净值)	632,312,212.03	-	159,430,047.19	791,742,259.22

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：杨明辉，主管会计工作负责人：朱威，会计机构负责人：朱威

#### 6.4 报表附注

##### 6.4.1 基金基本情况

华夏睿磐泰茂混合型证券投资基金（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[2017]720号《关于准予华夏睿磐泰茂混合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》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《华夏睿磐泰茂混合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 2017 年 11 月 6

日至 2017 年 12 月 1 日共募集 873,549,671.95 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（2017）验字第 60739337\_A33 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华夏睿磐泰茂混合型证券投资基金基金合同》于 2017 年 12 月 6 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 873,970,404.35 份基金份额，其中认购资金利息折合 420,732.40 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，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和本基金基金合同的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板、存托凭证及其他中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、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（包括权证、股指期货、国债期货、期权等）、货币市场工具（含同业存单）、资产支持证券、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（但须符合中国证监会相关规定）。

#### 6.4.2 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》、各项具体会计准则及其他相关规定（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 6.4.4 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。

#### 6.4.3 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。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

除下述变更后的会计政策外，本基金报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

根据《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》、《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（统称“新金融工具准则”）、《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》的规定和相关法律法规的

要求,本基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。根据衔接规定,对可比期间信息不予调整,首日执行新金融工具准则的累积影响数调整本报告期期初未分配利润。

新金融工具准则改变了金融资产的分类和计量方式,将金融工具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。本基金考虑自身业务模式,以及金融资产的合同现金流特征进行上述分类。于 2021 年 12 月 31 日及 2022 年 1 月 1 日,本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

新金融工具准则要求对于以摊余成本计量的金融资产,以预期信用损失为基础确认损失准备。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。

于 2021 年 12 月 31 日,银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、交易性金融资产、卖出回购金融资产款等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”或“应付利息”科目中。于 2022 年 1 月 1 日,根据新金融工具准则下的计量类别,将上述应计利息分别转入银行存款、结算备付金、存出保证金、交易性金融资产、买入返售金融资产、卖出回购金融资产款等科目项下列示,同时以摊余成本法计量的金融资产按照预期信用损失为基准,计提损失准备 0.00 元,对本基金期初未分配利润无影响。

于 2022 年 1 月 1 日,本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下:

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、应收利息和应收申购款,金额分别为 26,365,124.52 元、15,504,742.60 元、47,150.38 元、220,000,270.00 元、14,923,212.68 元和 2,170,732.99 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、其他资产-应收利息和应收申购款,金额分别为 26,386,349.32 元、15,513,562.54 元、47,173.81 元、220,050,456.25 元、0.00 元和 2,170,732.99 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产,金额为 1,795,568,668.35 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产,金额为 1,810,411,626.61 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付证券清算款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、应付交易费用和其他负债-其他应付款,金额分别为 4,918,869.54

元、3,773,654.40 元、1,209,174.80 元、302,293.67 元、203,061.86 元、1,068,694.25 元和 201,488.19 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付清算款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、其他负债-应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 4,918,869.54 元、3,773,654.40 元、1,209,174.80 元、302,293.67 元、203,061.86 元、1,068,694.25 元和 201,488.19 元。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

#### 6.4.5.3 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。

#### 6.4.6 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》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。

(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。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
活期存款	15,812,052.12
等于：本金	15,803,517.87
加：应计利息	8,534.25
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-

存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
合计	15,812,052.12

## 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	305,674,108.48	-	332,701,839.97	27,027,731.49
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	9,017,624.67	600,979,324.69	3,980,925.89
	银行间市场	1,750,714,507.01	30,225,648.50	11,952,892.99
	合计	2,338,695,281.14	39,243,273.17	2,393,872,373.19
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	2,644,369,389.62	39,243,273.17	2,726,574,213.16	42,961,550.37

## 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

## 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

## 6.4.7.4 买入返售金融资产

## 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

## 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

## 6.4.7.5 其他资产

无。

## 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-

应付赎回费	2,914.22
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	2,676,703.14
其中：交易所市场	2,665,995.70
银行间市场	10,707.44
应付利息	-
预提费用	179,178.95
合计	2,858,796.31

#### 6.4.7.7 实收基金

华夏睿磐泰茂混合 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	901,979,570.73	901,979,570.73
本期申购	651,979,522.92	651,979,522.92
本期赎回（以“-”号填列）	-243,609,142.11	-243,609,142.11
本期末	1,310,349,951.54	1,310,349,951.54

华夏睿磐泰茂混合 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	693,740,757.80	693,740,757.80
本期申购	574,086,904.56	574,086,904.56
本期赎回（以“-”号填列）	-558,498,127.29	-558,498,127.29
本期末	709,329,535.07	709,329,535.07

#### 6.4.7.8 未分配利润

华夏睿磐泰茂混合 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
本期期初	232,883,708.28	36,933,183.72	269,816,892.00
本期利润	-24,866,127.35	16,939,703.06	-7,926,424.29
本期基金份额交易产生的变动数	102,266,738.85	15,363,888.45	117,630,627.30
其中：基金申购款	160,757,342.94	24,153,280.12	184,910,623.06
基金赎回款	-58,490,604.09	-8,789,391.67	-67,279,995.76
本期已分配利润	-	-	-
本期末	310,284,319.78	69,236,775.23	379,521,095.01

华夏睿磐泰茂混合 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
本期期初	169,149,600.55	28,194,643.23	197,344,243.78
本期利润	-16,132,533.20	7,642,138.99	-8,490,394.21
本期基金份额交易产生的变动数	3,599,019.16	1,307,224.82	4,906,243.98
其中：基金申购款	131,259,756.90	19,671,338.54	150,931,095.44
基金赎回款	-127,660,737.74	-18,364,113.72	-146,024,851.46
本期已分配利润	-	-	-
本期末	156,616,086.51	37,144,007.04	193,760,093.55

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	176,282.36
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	163,227.40
其他	1,100.27
合计	340,610.03

6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	1,191,002,844.12
减：卖出股票成本总额	1,254,017,429.34
减：交易费用	3,424,686.79
买卖股票差价收入	-66,439,272.01

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
债券投资收益——利息收入	35,635,893.97
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-605,704.23
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	35,030,189.74

#### 6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,422,305,921.91
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,409,087,234.89
减：应计利息总额	13,799,558.59
减：交易费用	24,832.66
买卖债券差价收入	-605,704.23

#### 6.4.7.12 资产支持证券投资收益

无。

#### 6.4.7.13 衍生工具收益

##### 6.4.7.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

##### 6.4.7.13.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
股指期货投资收益	351,691.98
国债期货投资收益	-197,648.76

#### 6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资产生的股利收益	3,122,389.75
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	3,122,389.75

#### 6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
------	----------------------------

1.交易性金融资产	24,581,842.05
——股票投资	25,212,562.32
——债券投资	-630,720.27
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
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	24,581,842.05

## 6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
基金赎回费收入	670,180.13
基金申购费收入	-
合计	670,180.13

## 6.4.7.17 信用减值损失

无。

## 6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
审计费用	39,671.58
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	30,393.79
银行间账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	148,172.74

## 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

## 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无或有事项。

## 6.4.8.2 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。

## 6.4.9 关联方关系

### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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
中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”）	基金托管人
中信证券股份有限公司（“中信证券”）	基金管理人的股东
上海华夏财富投资管理有限公司（“华夏财富”）	基金管理人的子公司
中信证券（山东）有限责任公司（“中信证券（山东）”）	基金管理人股东控股的公司

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。

## 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.10.1.1 股票交易

无。

#### 6.4.10.1.2 权证交易

无。

#### 6.4.10.1.3 债券交易

无。

#### 6.4.10.1.4 债券回购交易

无。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

### 6.4.10.2 关联方报酬

#### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月 30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30 日
当期发生的基金应支付的管理费	9,826,149.37	2,953,886.33
其中：支付销售机构的客户维护费	1,590,214.94	209,724.63

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 0.80%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×0.80%/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。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022年1月1日至2022年6月30日	2021年1月1日至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	2,456,537.41	738,471.53

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。

#### 6.4.10.2.3 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 2022年1月1日至2022年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
关联方名称	华夏睿磐泰茂混合 A	华夏睿磐泰茂混合 C	合计
华夏基金管理有限公司	-	192,228.35	192,228.35
华夏财富	-	2,381.96	2,381.96
中信证券（山东）	-	74.17	74.17
中信证券	-	11.03	11.03
合计	-	194,695.51	194,695.51
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
关联方名称	华夏睿磐泰茂混合 A	华夏睿磐泰茂混合 C	合计
华夏基金管理有限公司	-	142,765.15	142,765.15
华夏财富	-	143.50	143.50
合计	-	142,908.65	142,908.65

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 0.30%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 × 0.30% / 当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 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

6.4.10.4.1 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。

6.4.10.4.2 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。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.5.2 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。

6.4.10.6 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 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行活期存款	15,812,052.12	176,282.36	8,564,460.28	66,931.88

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国农业银行保管，按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.10.7 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 2022年1月1日至2022年6月30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	600938	中国海油	新股发行	120,005	1,296,054.00
中信证券	688223	晶科能源	新股发行	213,000	1,065,000.00
中信证券	688326	经纬恒润	新股发行	6,832	826,672.00
中信证券	301200	大族数控	新股发行	8,566	655,812.96

中信证券	301109	军信股份	新股发行	12,250	426,422.50
中信证券	301302	华如科技	新股发行	4,651	241,991.53
中信证券	688150	莱特光电	新股发行	5,626	124,053.30
中信证券	688290	景业智能	新股发行	3,040	103,025.60
中信证券	603132	金徽股份	新股发行	1,342	14,493.60
中信证券	603191	望变电气	新股发行	1,149	13,627.14
中信证券	603209	兴通股份	新股发行	595	12,804.40
中信证券	001266	宏英智能	新股发行	247	9,536.67
中信证券	603215	比依股份	新股发行	575	7,187.50
中信证券	603051	鹿山新材	新股发行	272	7,014.88
上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 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	600905	三峡能源	网下申购	1,296,803	3,436,527.95
中信证券	688819	天能股份	网下申购	12,488	521,873.52
中信证券	688660	电气风电	网下申购	46,114	250,860.16
中信证券	688276	百克生物	网下申购	3,486	126,716.10
中信证券	688617	惠泰医疗	网下申购	1,673	124,571.58
中信证券	688575	亚辉龙	网下申购	3,435	50,838.00
中信证券	300982	苏文电能	网下申购	3,170	50,181.10
中信证券	300993	玉马遮阳	网下申购	4,097	49,573.70
中信证券	688315	诺禾致源	网下申购	3,711	47,352.36
中信证券	300997	欢乐家	网下申购	9,279	45,838.26
中信证券	688607	康众医疗	网下申购	1,890	43,866.90
中信证券	300930	屹通新材	网下申购	3,220	42,214.20
中信证券	603529	爱玛科技	网下申购	1,019	28,389.34
中信证券	688690	纳微科技	网下申购	3,477	28,059.39
中信证券	300966	共同药业	网下申购	2,858	23,549.92
中信证券	688565	力源科技	网下申购	2,464	23,136.96
中信证券	688226	威腾电气	网下申购	2,693	17,289.06
中信证券	600916	中国黄金	网下申购	3,371	16,821.29
中信证券	605060	联德股份	网下申购	883	13,765.97
中信证券	605488	福莱新材	网下申购	416	8,498.88
中信证券	001208	华菱线缆	网下申购	1,754	6,437.18
中信证券	003040	楚天龙	网下申购	1,101	5,086.62
中信证券	601279	英利汽车	网下申购	2,004	4,148.28

注：本期“网上申购”和“网下申购”两种发行方式合并披露为“新股发行”。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

##### 6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

## 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配事项。

## 6.4.12 期末（2022 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

## 6.4.12.1 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

6.4.12.1.1 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(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600941	中国移动	2021-12-24	6 个月	新发流通受限	57.58	60.26	87,363	5,030,361.54	5,264,494.38	-
600938	中国海油	2022-04-14	6 个月	新发流通受限	10.80	15.86	84,004	907,243.20	1,332,303.44	-
301139	元道通信	2022-06-30	1 个月内(含)	新发流通受限	38.46	38.46	5,085	195,569.10	195,569.10	-
688290	景业智能	2022-04-21	6 个月	新发流通受限	33.89	46.87	3,040	103,025.60	142,484.80	-
688115	思林杰	2022-03-07	6 个月	新发流通受限	65.65	38.46	2,153	141,344.45	82,804.38	-

301236	软通动力	2022-03-08	6 个月	新发流通受限	72.88	31.38	2,076	100,865.92	65,144.88	含证券送配
301219	腾远钴业	2022-03-10	6 个月	新发流通受限	173.98	87.82	578	55,847.58	50,759.96	含证券送配
301200	大族数控	2022-02-18	6 个月	新发流通受限	76.56	51.92	857	65,611.92	44,495.44	-
301206	三元生物	2022-01-26	6 个月	新发流通受限	109.30	45.69	945	68,859.00	43,177.05	含证券送配
301150	中一科技	2022-04-14	6 个月	新发流通受限	163.56	82.76	404	43,997.64	33,435.04	含证券送配
301109	军信股份	2022-04-06	6 个月	新发流通受限	34.81	16.14	1,838	42,642.25	29,665.32	含证券送配
301302	华如科技	2022-06-16	6 个月	新发流通受限	52.03	56.42	466	24,245.98	26,291.72	-
301268	铭利	2022-03-29	6 个月	新发	28.50	34.87	641	18,268.50	22,351.67	-

	达			流通受限						
301139	元道通信	2022-06-30	6 个月	新发流通受限	38.46	38.46	566	21,768.36	21,768.36	-
301122	采纳股份	2022-01-19	6 个月	新发流通受限	50.31	70.37	301	15,143.31	21,181.37	-
301102	兆讯传媒	2022-03-15	6 个月	新发流通受限	39.88	31.09	642	25,602.96	19,959.78	-
301162	国能日新	2022-04-19	6 个月	新发流通受限	45.13	54.11	334	15,073.42	18,072.74	-
301123	奕东电子	2022-01-14	6 个月	新发流通受限	37.23	25.39	656	24,422.88	16,655.84	-
301103	何氏眼科	2022-03-14	6 个月	新发流通受限	42.50	32.02	507	16,575.00	16,234.14	含 证 券 送 配
301286	侨源股份	2022-06-06	6 个月	新发流通	16.91	19.79	784	13,257.44	15,515.36	-

				受限						
301248	杰创智能	2022-04-13	6 个月	新发流通受限	39.07	29.87	472	18,441.04	14,098.64	-
301212	联盛化学	2022-04-07	6 个月	新发流通受限	29.67	33.28	416	12,342.72	13,844.48	-
301298	东利机械	2022-05-27	6 个月	新发流通受限	12.68	20.83	634	8,039.12	13,206.22	-
301148	嘉戎技术	2022-04-14	6 个月	新发流通受限	38.39	23.90	516	19,809.24	12,332.40	-
301259	艾布鲁	2022-04-18	6 个月	新发流通受限	18.39	24.94	483	8,882.37	12,046.02	-
301097	天益医疗	2022-03-25	6 个月	新发流通受限	52.37	47.83	249	13,040.13	11,909.67	-
301220	亚香股份	2022-06-15	6 个月	新发流通受限	35.98	39.15	285	10,254.30	11,157.75	-

301237	和顺科技	2022-03-16	6 个月	新发流通受限	56.69	41.86	261	14,796.09	10,925.46	-
301196	唯科科技	2022-01-04	6 个月	新发流通受限	64.08	37.52	271	17,365.68	10,167.92	-
301125	腾亚精工	2022-05-27	6 个月	新发流通受限	22.49	27.42	327	7,354.23	8,966.34	-
301163	宏德股份	2022-04-11	6 个月	新发流通受限	26.27	32.33	277	7,276.79	8,955.41	-
301130	西点药业	2022-02-16	6 个月	新发流通受限	22.55	37.70	237	5,344.35	8,934.90	-
301135	瑞德智能	2022-04-01	6 个月	新发流通受限	31.98	26.26	338	10,809.24	8,875.88	-
301181	标榜股份	2022-02-11	6 个月	新发流通受限	40.25	30.59	257	10,344.25	7,861.63	-
301228	实朴	2022-01-21	6 个月	新发	20.08	20.34	373	7,489.84	7,586.82	-

	检测			流通受限						
301279	金道科技	2022-04-06	6 个月	新发流通受限	31.20	22.81	296	9,235.20	6,751.76	-
6.4.12.1.2 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(张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113060	浙 22 转债	2022-06-14	1 个月内(含)	新发流通受限	100.00	100.01	30	3,000.00	3,000.22	期末估值单价为含息价格
118009	华锐转债	2022-06-24	1 个月内(含)	新发流通受限	100.00	100.00	20	2,000.00	2,000.09	期末估值单价为含息价格

注：①本基金通过大宗交易方式受让的原上市公司大股东减持或者特定股东减持的股份，在受让后 6 个月内，不得转让所受让的股份。本基金所认购非公开发行股份，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股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。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根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于 6 个月的限售期。

⑤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。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2022 年 6 月 30 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 155,000,000.00 元，于 2022 年 7 月 1 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

#### 6.4.13.2 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。

#### 6.4.13.3 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“6.4.12 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。

##### 6.4.13.3.1 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。

#### 6.4.13.4 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。

#### 6.4.13.4.1 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。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	合计
银行存款	15,812,052.12	-	-	15,812,052.12
结算备付金	19,741,764.48	-	-	19,741,764.48
结算保证金	187,719.81	-	-	187,719.81
债券投资	267,532,985.51	1,877,710,006.60	248,629,381.08	2,393,872,373.19
资产支持证券	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-
应收直销申购款	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	155,000,000.00	-	-	155,000,000.00
上年度末 2021 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	合计
银行存款	26,365,124.52	-	-	26,365,124.52
结算备付金	15,504,742.60	-	-	15,504,742.60
结算保证金	47,150.38	-	-	47,150.38
债券投资	189,695,300.09	1,056,564,800.00	264,206,791.40	1,510,466,891.49
资产支持证券	-	-	-	-
买入返售金融资产	220,000,270.00	-	-	220,000,270.00
应收直销申购款	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-

注：本表所示为本基金生息资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

##### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率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 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日

	利率下降 25 个基点	19,253,538.66	15,475,639.52
	利率上升 25 个基点	-19,016,417.85	-15,191,230.25

#### 6.4.13.4.2 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。

#### 6.4.13.4.3 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。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日		上年度末 2021 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	332,701,839.97	12.83	285,101,776.86	13.82
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	29,972,457.88	1.16	61,816,700.09	3.00
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	362,674,297.85	13.99	346,918,476.95	16.82

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。

##### 6.4.13.4.3.2 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 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
	-5%	-16,824,506.50	-14,403,240.42
	+5%	16,824,506.50	14,403,240.42

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 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。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 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 2022 年 6 月 30 日
第一层次	355,044,311.78
第二层次	2,364,117,252.77
第三层次	7,412,648.61
合计	2,726,574,213.16

###### 6.4.14.2.2 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。本基金政策以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。

###### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

截至 2022 年 6 月 30 日止，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

###### 6.4.14.4 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。

##### 6.4.15 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。

## §7 投资组合报告

## 7.1 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	332,701,839.97	11.95
	其中：股票	332,701,839.97	11.95
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,393,872,373.19	85.95
	其中：债券	2,393,872,373.19	85.95
	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	35,553,816.60	1.28
8	其他各项资产	22,996,000.90	0.83
9	合计	2,785,124,030.66	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	1,271,888.00	0.05
B	采矿业	12,481,113.40	0.48
C	制造业	255,893,166.34	9.87
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,735,124.11	0.22
E	建筑业	510,003.20	0.02
F	批发和零售业	2,491,509.12	0.10
G	交通运输、仓储和邮政业	6,300,093.00	0.24
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	19,201,266.62	0.74
J	金融业	13,627,171.85	0.53
K	房地产业	5,106,147.40	0.20
L	租赁和商务服务业	1,109,230.78	0.04
M	科学研究和技术服务业	3,733,344.62	0.14
N	水利、环境和公共设施管理业	2,815,097.39	0.11
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	2,007,444.14	0.08
R	文化、体育和娱乐业	347,320.00	0.01
S	综合	71,920.00	0.00

	合计	332,701,839.97	12.83
--	----	----------------	-------

## 7.3 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	300390	天华超净	168,000	14,683,200.00	0.57
2	300124	汇川技术	206,044	13,572,118.28	0.52
3	300750	宁德时代	20,100	10,733,400.00	0.41
4	300529	健帆生物	149,200	7,592,788.00	0.29
5	300316	晶盛机电	82,500	5,576,175.00	0.22
6	600941	中国移动	87,363	5,264,494.38	0.20
7	300122	智飞生物	45,200	5,017,652.00	0.19
8	000858	五粮液	24,000	4,846,320.00	0.19
9	300832	新产业	81,222	3,663,924.42	0.14
10	000333	美的集团	60,000	3,623,400.00	0.14
11	000625	长安汽车	206,180	3,571,037.60	0.14
12	300231	银信科技	465,200	3,521,564.00	0.14
13	300130	新国都	257,600	3,158,176.00	0.12
14	002129	TCL 中环	50,900	2,997,501.00	0.12
15	000651	格力电器	87,400	2,947,128.00	0.11
16	300033	同花顺	29,900	2,874,885.00	0.11
17	002304	洋河股份	15,600	2,857,140.00	0.11
18	688123	聚辰股份	26,200	2,790,824.00	0.11
19	002709	天赐材料	44,200	2,743,052.00	0.11
20	300363	博腾股份	33,900	2,643,861.00	0.10
21	300482	万孚生物	61,800	2,515,878.00	0.10
22	300628	亿联网络	31,400	2,391,110.00	0.09
23	600096	云天化	75,100	2,364,148.00	0.09
24	300432	富临精工	105,850	2,328,700.00	0.09
25	600348	华阳股份	148,600	2,297,356.00	0.09
26	002049	紫光国微	12,000	2,276,640.00	0.09
27	300171	东富龙	66,300	2,248,233.00	0.09
28	002459	晶澳科技	28,420	2,242,338.00	0.09
29	000001	平安银行	149,500	2,239,510.00	0.09
30	002597	金禾实业	51,600	2,235,828.00	0.09
31	000661	长春高新	9,000	2,100,780.00	0.08
32	000893	亚钾国际	60,700	2,088,687.00	0.08
33	002821	凯莱英	7,200	2,080,800.00	0.08
34	002466	天齐锂业	16,600	2,071,680.00	0.08
35	300373	扬杰科技	27,700	1,973,625.00	0.08
36	002001	新和成	81,100	1,849,891.00	0.07
37	000729	燕京啤酒	190,800	1,843,128.00	0.07

38	002410	广联达	33,800	1,840,072.00	0.07
39	300037	新宙邦	33,540	1,762,862.40	0.07
40	688396	华润微	29,600	1,748,472.00	0.07
41	000876	新希望	113,800	1,741,140.00	0.07
42	000708	中信特钢	83,900	1,690,585.00	0.07
43	601677	明泰铝业	69,860	1,662,668.00	0.06
44	002801	微光股份	55,500	1,656,675.00	0.06
45	002555	三七互娱	76,600	1,626,218.00	0.06
46	600160	巨化股份	122,400	1,609,560.00	0.06
47	300196	长海股份	84,600	1,598,094.00	0.06
48	300604	长川科技	35,200	1,589,280.00	0.06
49	300803	指南针	27,000	1,587,060.00	0.06
50	000553	安道麦 A	130,000	1,574,300.00	0.06
51	300855	图南股份	37,350	1,560,856.50	0.06
52	600273	嘉化能源	141,700	1,538,862.00	0.06
53	000069	华侨城 A	236,600	1,535,534.00	0.06
54	300244	迪安诊断	48,100	1,495,910.00	0.06
55	002286	保龄宝	129,100	1,478,195.00	0.06
56	600863	内蒙华电	400,300	1,461,095.00	0.06
57	002938	鹏鼎控股	48,000	1,450,080.00	0.06
58	000552	靖远煤电	334,900	1,443,419.00	0.06
59	002180	纳思达	28,100	1,422,422.00	0.05
60	300268	佳沃食品	47,600	1,416,100.00	0.05
61	000877	天山股份	114,600	1,409,580.00	0.05
62	603392	万泰生物	8,820	1,369,746.00	0.05
63	002648	卫星化学	51,604	1,333,963.40	0.05
64	600938	中国海油	84,004	1,332,303.44	0.05
65	601156	东航物流	65,100	1,288,980.00	0.05
66	300059	东方财富	50,076	1,271,930.40	0.05
67	002182	云海金属	49,900	1,251,492.00	0.05
68	002736	国信证券	130,000	1,244,100.00	0.05
69	300770	新媒股份	32,800	1,240,824.00	0.05
70	300661	圣邦股份	6,750	1,228,635.00	0.05
71	002371	北方华创	4,200	1,163,904.00	0.04
72	300347	泰格医药	10,100	1,155,945.00	0.04
73	002714	牧原股份	20,600	1,138,562.00	0.04
74	002996	顺博合金	74,398	1,130,849.60	0.04
75	002460	赣锋锂业	7,600	1,130,120.00	0.04
76	600809	山西汾酒	3,376	1,096,524.80	0.04
77	688033	天宜上佳	51,101	1,085,385.24	0.04
78	688668	鼎通科技	15,401	1,083,306.34	0.04
79	300327	中颖电子	21,330	1,062,447.30	0.04
80	003038	鑫铂股份	20,900	1,053,360.00	0.04

81	000629	攀钢钒钛	276,400	1,050,320.00	0.04
82	300926	博俊科技	44,843	1,047,084.05	0.04
83	000792	盐湖股份	34,500	1,033,620.00	0.04
84	002756	永兴材料	6,700	1,019,807.00	0.04
85	600888	新疆众和	110,000	1,012,000.00	0.04
86	000733	振华科技	7,400	1,006,178.00	0.04
87	000519	中兵红箭	34,500	1,005,675.00	0.04
88	605368	蓝天燃气	79,500	1,001,700.00	0.04
89	300699	光威复材	16,985	999,906.95	0.04
90	000559	万向钱潮	166,600	989,604.00	0.04
91	300160	秀强股份	120,000	975,600.00	0.04
92	688707	振华新材	12,801	968,651.67	0.04
93	605198	德利股份	53,000	966,720.00	0.04
94	300218	安利股份	67,700	966,079.00	0.04
95	601225	陕西煤业	45,300	959,454.00	0.04
96	601615	明阳智能	28,300	956,540.00	0.04
97	000895	双汇发展	32,400	949,320.00	0.04
98	002916	深南电路	10,100	946,471.00	0.04
99	002594	比亚迪	2,800	933,772.00	0.04
100	600867	通化东宝	90,000	930,600.00	0.04
101	300938	信测标准	33,540	928,722.60	0.04
102	601088	中国神华	27,600	919,080.00	0.04
103	603128	华贸物流	91,100	913,733.00	0.04
104	605169	洪通燃气	81,031	912,409.06	0.04
105	002908	德生科技	78,620	907,274.80	0.03
106	600389	江山股份	14,900	904,877.00	0.03
107	603185	上机数控	5,660	882,903.40	0.03
108	601717	郑煤机	60,600	873,246.00	0.03
109	601899	紫金矿业	93,517	872,513.61	0.03
110	300751	迈为股份	1,727	847,784.30	0.03
111	002120	韵达股份	49,200	839,352.00	0.03
112	600018	上港集团	143,000	833,690.00	0.03
113	002738	中矿资源	8,960	829,785.60	0.03
114	002920	德赛西威	5,600	828,800.00	0.03
115	600486	扬农化工	6,200	826,336.00	0.03
116	600519	贵州茅台	400	818,000.00	0.03
117	600233	圆通速递	40,000	815,600.00	0.03
118	600256	广汇能源	76,700	808,418.00	0.03
119	600438	通威股份	13,300	796,138.00	0.03
120	600737	中粮糖业	105,600	794,112.00	0.03
121	603688	石英股份	5,800	769,138.00	0.03
122	600639	浦东金桥	55,900	759,681.00	0.03
123	603259	药明康德	7,100	738,329.00	0.03

124	002539	云图控股	45,900	733,941.00	0.03
125	002405	四维图新	48,000	723,360.00	0.03
126	000301	东方盛虹	41,600	703,456.00	0.03
127	002645	华宏科技	31,700	691,694.00	0.03
128	688303	大全能源	10,000	683,200.00	0.03
129	600481	双良节能	40,100	675,685.00	0.03
130	300398	飞凯材料	29,200	667,512.00	0.03
131	300481	濮阳惠成	28,400	667,400.00	0.03
132	600884	杉杉股份	22,300	662,756.00	0.03
133	600111	北方稀土	18,600	653,976.00	0.03
134	002932	明德生物	9,536	653,788.16	0.03
135	300741	华宝股份	23,500	653,770.00	0.03
136	002895	川恒股份	18,999	642,356.19	0.02
137	688200	华峰测控	1,800	641,520.00	0.02
138	600188	兖矿能源	16,100	635,628.00	0.02
139	688385	复旦微电	9,501	619,370.19	0.02
140	603529	爱玛科技	11,760	615,988.80	0.02
141	600873	梅花生物	53,600	604,608.00	0.02
142	603948	建业股份	21,100	593,965.00	0.02
143	002549	凯美特气	32,300	584,630.00	0.02
144	002841	视源股份	7,600	572,432.00	0.02
145	601666	平煤股份	42,100	572,139.00	0.02
146	002191	劲嘉股份	52,400	561,728.00	0.02
147	688516	奥特维	2,101	560,861.95	0.02
148	603713	密尔克卫	3,900	533,130.00	0.02
149	300618	寒锐钴业	9,200	532,864.00	0.02
150	600566	济川药业	19,400	526,904.00	0.02
151	000063	中兴通讯	20,565	525,024.45	0.02
152	300068	南都电源	33,600	515,424.00	0.02
153	300861	美畅股份	5,400	500,526.00	0.02
154	600063	皖维高新	65,700	498,006.00	0.02
155	603882	金域医学	6,000	495,300.00	0.02
156	002216	三全食品	25,200	493,668.00	0.02
157	601898	中煤能源	46,700	484,746.00	0.02
158	603867	新化股份	14,200	482,374.00	0.02
159	300634	彩讯股份	37,300	473,710.00	0.02
160	002332	仙琚制药	48,000	471,360.00	0.02
161	002432	九安医疗	7,800	468,468.00	0.02
162	600163	中闽能源	55,400	468,130.00	0.02
163	603277	银都股份	22,000	464,420.00	0.02
164	000968	蓝焰控股	44,000	459,800.00	0.02
165	000933	神火股份	35,100	459,108.00	0.02
166	002240	盛新锂能	7,400	446,664.00	0.02

167	000568	泸州老窖	1,800	443,772.00	0.02
168	000983	山西焦煤	32,965	441,401.35	0.02
169	300662	科锐国际	8,500	441,065.00	0.02
170	000935	四川双马	17,800	431,116.00	0.02
171	600584	长电科技	15,900	429,300.00	0.02
172	002415	海康威视	11,700	423,540.00	0.02
173	600195	中牧股份	33,800	414,388.00	0.02
174	600546	山煤国际	21,100	410,606.00	0.02
175	600057	厦门象屿	46,100	405,219.00	0.02
176	600325	华发股份	50,900	385,313.00	0.01
177	600176	中国巨石	22,000	383,020.00	0.01
178	600901	江苏租赁	71,200	365,256.00	0.01
179	603198	迎驾贡酒	5,598	364,653.72	0.01
180	300639	凯普生物	17,000	363,460.00	0.01
181	600064	南京高科	32,100	353,100.00	0.01
182	000517	荣安地产	107,800	342,804.00	0.01
183	002312	川发龙蟒	19,300	333,118.00	0.01
184	603619	中曼石油	16,100	331,177.00	0.01
185	600499	科达制造	16,000	330,240.00	0.01
186	300888	稳健医疗	4,800	319,200.00	0.01
187	002902	铭普光磁	22,100	306,748.00	0.01
188	603656	泰禾智能	20,400	301,512.00	0.01
189	603260	合盛硅业	2,500	294,900.00	0.01
190	002142	宁波银行	8,100	290,061.00	0.01
191	300360	炬华科技	20,400	272,136.00	0.01
192	600309	万华化学	2,800	271,572.00	0.01
193	601001	晋控煤业	15,200	269,800.00	0.01
194	601636	旗滨集团	21,100	269,025.00	0.01
195	002043	兔宝宝	22,900	265,640.00	0.01
196	000617	中油资本	55,100	265,031.00	0.01
197	836077	吉林碳谷	4,205	261,971.50	0.01
198	600173	卧龙地产	45,100	261,580.00	0.01
199	601216	君正集团	53,300	260,104.00	0.01
200	601231	环旭电子	18,100	259,916.00	0.01
201	300450	先导智能	4,100	259,038.00	0.01
202	300677	英科医疗	10,200	258,672.00	0.01
203	002624	完美世界	17,800	255,786.00	0.01
204	603359	东珠生态	21,100	254,888.00	0.01
205	002331	皖通科技	35,000	254,450.00	0.01
206	002768	国恩股份	9,900	254,232.00	0.01
207	601668	中国建筑	47,720	253,870.40	0.01
208	002833	弘亚数控	15,120	252,201.60	0.01
209	003033	征和工业	9,400	251,920.00	0.01

210	601601	中国太保	10,700	251,771.00	0.01
211	603368	柳药集团	14,600	251,412.00	0.01
212	600668	尖峰集团	17,000	251,260.00	0.01
213	603165	荣晟环保	17,200	251,120.00	0.01
214	603790	雅运股份	23,600	250,868.00	0.01
215	002126	银轮股份	21,900	250,755.00	0.01
216	300836	佰奥智能	10,270	250,588.00	0.01
217	688090	瑞松科技	8,100	250,533.00	0.01
218	300606	金太阳	20,600	250,290.00	0.01
219	002788	鹭燕医药	29,100	249,969.00	0.01
220	002860	星帅尔	16,800	248,808.00	0.01
221	000650	仁和药业	38,900	248,182.00	0.01
222	300963	中洲特材	12,800	248,064.00	0.01
223	300445	康斯特	21,500	246,390.00	0.01
224	603018	华设集团	25,700	245,435.00	0.01
225	601838	成都银行	14,800	245,384.00	0.01
226	600380	健康元	19,800	244,530.00	0.01
227	002787	华源控股	41,900	244,277.00	0.01
228	300583	赛托生物	10,800	244,080.00	0.01
229	300195	长荣股份	43,500	244,035.00	0.01
230	300371	汇中股份	20,100	244,014.00	0.01
231	300571	平治信息	5,900	243,670.00	0.01
232	603615	茶花股份	31,800	243,588.00	0.01
233	002818	富森美	19,300	242,987.00	0.01
234	000848	承德露露	25,100	242,968.00	0.01
235	002601	龙佰集团	12,100	242,605.00	0.01
236	300689	澄天伟业	14,000	242,340.00	0.01
237	300620	光库科技	7,300	242,287.00	0.01
238	002867	周大生	15,600	242,268.00	0.01
239	603586	金麒麟	18,700	241,604.00	0.01
240	603387	基蛋生物	16,940	241,564.40	0.01
241	300594	朗进科技	14,200	241,400.00	0.01
242	600036	招商银行	5,700	240,540.00	0.01
243	300418	昆仑万维	15,000	240,000.00	0.01
244	003036	泰坦股份	22,400	239,904.00	0.01
244	603499	翔港科技	30,600	239,904.00	0.01
246	003004	声迅股份	11,500	239,890.00	0.01
247	688350	富淼科技	13,300	239,267.00	0.01
248	000401	冀东水泥	22,700	238,804.00	0.01
249	002472	双环传动	7,500	238,800.00	0.01
250	601318	中国平安	5,100	238,119.00	0.01
251	002295	精艺股份	35,800	238,070.00	0.01
252	688191	智洋创新	14,000	238,000.00	0.01

253	002494	华斯股份	56,300	237,586.00	0.01
254	000062	深圳华强	18,700	237,490.00	0.01
255	301069	凯盛新材	5,139	236,959.29	0.01
256	300462	华铭智能	24,600	236,898.00	0.01
257	002979	雷赛智能	11,600	236,872.00	0.01
258	601128	常熟银行	31,000	236,840.00	0.01
259	300321	同大股份	14,600	236,812.00	0.01
260	002574	明牌珠宝	48,600	236,682.00	0.01
261	002655	共达电声	16,000	236,480.00	0.01
262	002064	华峰化学	28,000	236,320.00	0.01
263	601398	工商银行	49,500	236,115.00	0.01
264	688679	通源环境	21,700	235,662.00	0.01
265	002884	凌霄泵业	11,500	235,635.00	0.01
266	002899	英派斯	19,200	235,392.00	0.01
267	600802	福建水泥	35,600	235,316.00	0.01
268	000593	德龙汇能	42,000	235,200.00	0.01
269	601229	上海银行	35,900	235,145.00	0.01
270	000011	深物业 A	17,400	235,074.00	0.01
271	688379	华光新材	14,500	235,045.00	0.01
272	600302	标准股份	47,000	235,000.00	0.01
273	300615	欣天科技	21,300	234,726.00	0.01
274	605088	冠盛股份	17,400	234,552.00	0.01
275	688215	瑞晟智能	7,700	234,311.00	0.01
276	601939	建设银行	38,600	233,916.00	0.01
277	002078	太阳纸业	19,000	233,890.00	0.01
278	000778	新兴铸管	48,500	233,770.00	0.01
279	605298	必得科技	17,160	233,376.00	0.01
280	002911	佛燃能源	25,700	233,356.00	0.01
281	300732	设研院	21,140	233,174.20	0.01
282	603321	梅轮电梯	35,800	233,058.00	0.01
283	605001	威奥股份	36,300	233,046.00	0.01
284	601166	兴业银行	11,700	232,830.00	0.01
285	603699	纽威股份	27,600	232,116.00	0.01
286	002034	旺能环境	11,300	231,989.00	0.01
287	600908	无锡银行	41,197	231,939.11	0.01
288	603399	吉翔股份	9,300	231,663.00	0.01
289	002193	如意集团	38,900	231,455.00	0.01
290	603709	中源家居	14,500	231,130.00	0.01
291	603357	设计总院	20,100	230,748.00	0.01
292	603393	新天然气	10,800	230,688.00	0.01
293	600426	华鲁恒升	7,900	230,680.00	0.01
294	300555	路通视信	29,900	230,230.00	0.01
295	002233	塔牌集团	26,000	230,100.00	0.01

296	000932	华菱钢铁	45,200	230,068.00	0.01
297	300070	碧水源	44,100	229,761.00	0.01
298	002869	金溢科技	15,200	229,216.00	0.01
299	603180	金牌厨柜	7,400	229,104.00	0.01
300	603878	武进不锈	35,900	229,042.00	0.01
301	300899	上海凯鑫	10,300	228,660.00	0.01
302	300839	博汇股份	16,939	228,507.11	0.01
303	600479	千金药业	23,700	228,468.00	0.01
304	600461	洪城环境	28,200	228,138.00	0.01
305	688178	万德斯	12,400	227,912.00	0.01
306	601577	长沙银行	28,700	227,591.00	0.01
307	600282	南钢股份	72,200	227,430.00	0.01
308	600007	中国国贸	15,400	227,150.00	0.01
309	688571	杭华股份	31,100	226,408.00	0.01
310	300625	三雄极光	18,800	225,976.00	0.01
311	300828	锐新科技	13,400	225,120.00	0.01
312	600727	鲁北化工	27,700	224,924.00	0.01
313	601598	中国外运	57,900	224,652.00	0.01
314	600559	老白干酒	7,800	223,782.00	0.01
315	600618	氯碱化工	17,900	223,750.00	0.01
316	600681	百川能源	50,435	223,427.05	0.01
317	688466	金科环境	14,200	222,940.00	0.01
318	002170	芭田股份	34,700	222,427.00	0.01
319	002687	乔治白	49,735	222,315.45	0.01
320	600511	国药股份	8,300	222,274.00	0.01
321	300499	高澜股份	18,400	222,088.00	0.01
322	605081	太和水	12,955	221,789.60	0.01
323	600557	康缘药业	15,000	220,350.00	0.01
324	002757	南兴股份	18,900	219,807.00	0.01
325	601009	南京银行	21,027	219,101.34	0.01
326	002128	电投能源	15,300	219,096.00	0.01
327	002567	唐人神	25,700	218,707.00	0.01
328	000717	韶钢松山	62,429	218,501.50	0.01
329	603085	天成自控	25,800	217,752.00	0.01
330	601298	青岛港	39,800	217,706.00	0.01
331	601233	桐昆股份	13,700	217,556.00	0.01
332	301139	元道通信	5,651	217,337.46	0.01
333	300167	迪威迅	41,600	217,152.00	0.01
334	601997	贵阳银行	37,300	216,713.00	0.01
335	002229	鸿博股份	32,400	215,784.00	0.01
336	600985	淮北矿业	14,800	215,488.00	0.01
337	002145	中核钛白	30,100	214,613.00	0.01
338	605366	宏柏新材	7,200	214,488.00	0.01

339	301057	汇隆新材	8,800	214,280.00	0.01
340	603773	沃格光电	13,380	214,080.00	0.01
341	300824	北鼎股份	18,000	213,480.00	0.01
342	002420	毅昌科技	29,200	213,160.00	0.01
343	300739	明阳电路	13,300	213,066.00	0.01
344	002809	红墙股份	21,300	213,000.00	0.01
345	600449	宁夏建材	17,400	211,758.00	0.01
346	002955	鸿合科技	9,700	211,169.00	0.01
347	002986	宇新股份	8,960	210,380.80	0.01
348	603583	捷昌驱动	6,300	210,357.00	0.01
349	300119	瑞普生物	11,900	208,131.00	0.01
350	600429	三元股份	39,700	208,028.00	0.01
351	001979	招商蛇口	15,400	206,822.00	0.01
352	600398	海澜之家	43,500	206,625.00	0.01
353	601956	东贝集团	32,300	206,397.00	0.01
354	300214	日科化学	26,600	205,884.00	0.01
355	002968	新大正	8,340	205,664.40	0.01
356	002261	拓维信息	31,800	203,838.00	0.01
357	600713	南京医药	41,700	203,079.00	0.01
358	600337	美克家居	66,302	202,884.12	0.01
359	002724	海洋王	16,300	202,609.00	0.01
360	002984	森麒麟	6,500	202,215.00	0.01
361	002241	歌尔股份	6,000	201,600.00	0.01
362	300491	通合科技	13,700	200,979.00	0.01
363	300275	梅安森	15,100	200,377.00	0.01
364	600326	西藏天路	34,200	200,070.00	0.01
365	603818	曲美家居	21,000	199,500.00	0.01
366	003003	天元股份	21,800	199,470.00	0.01
367	002110	三钢闽光	32,700	199,143.00	0.01
368	000918	嘉凯城	86,500	198,950.00	0.01
369	002795	永和智控	24,000	197,280.00	0.01
370	600250	南纺股份	35,800	197,258.00	0.01
371	300909	汇创达	7,650	196,681.50	0.01
372	002029	七匹狼	36,500	196,370.00	0.01
373	605228	神通科技	25,400	196,342.00	0.01
374	002734	利民股份	19,500	196,170.00	0.01
375	600507	方大特钢	28,000	195,720.00	0.01
376	002930	宏川智慧	9,800	193,746.00	0.01
377	301077	星华反光	8,100	193,671.00	0.01
378	002573	清新环境	33,300	193,473.00	0.01
379	300797	钢研纳克	14,200	193,404.00	0.01
380	688556	高测股份	2,381	192,146.70	0.01
381	603236	移远通信	1,430	191,133.80	0.01

382	003010	若羽臣	11,700	190,125.00	0.01
383	601208	东材科技	14,700	189,924.00	0.01
384	300425	中建环能	39,500	188,810.00	0.01
385	300813	泰林生物	4,640	188,801.60	0.01
386	300654	世纪天鸿	23,000	188,370.00	0.01
387	605151	西上海	10,200	181,152.00	0.01
388	688499	利元亨	800	177,040.00	0.01
389	603078	江化微	6,100	174,277.00	0.01
390	300773	拉卡拉	9,100	173,446.00	0.01
391	300346	南大光电	4,800	172,704.00	0.01
392	300573	兴齐眼药	1,100	168,652.00	0.01
393	001965	招商公路	21,900	167,097.00	0.01
394	688800	瑞可达	1,300	164,203.00	0.01
395	600929	雪天盐业	17,600	163,328.00	0.01
396	300354	东华测试	5,000	160,750.00	0.01
397	600269	赣粤高速	46,200	160,314.00	0.01
398	300652	雷迪克	6,500	159,055.00	0.01
399	300182	捷成股份	28,900	158,950.00	0.01
400	601728	中国电信	41,800	155,914.00	0.01
401	603379	三美股份	7,000	155,750.00	0.01
402	603139	康惠制药	7,600	153,520.00	0.01
403	003816	中国广核	54,800	153,440.00	0.01
404	688550	瑞联新材	2,200	150,898.00	0.01
405	002759	天际股份	5,500	149,490.00	0.01
406	000567	海德股份	10,100	149,480.00	0.01
407	688019	安集科技	700	149,044.00	0.01
408	002475	立讯精密	4,400	148,676.00	0.01
409	002948	青岛银行	40,700	147,334.00	0.01
410	000630	铜陵有色	45,100	147,026.00	0.01
411	600596	新安股份	6,780	146,787.00	0.01
412	601077	渝农商行	39,600	146,520.00	0.01
413	300818	耐普矿机	3,600	146,016.00	0.01
414	688037	芯源微	1,000	144,970.00	0.01
415	002517	恺英网络	25,800	143,964.00	0.01
416	002545	东方铁塔	12,600	143,388.00	0.01
417	300801	泰和科技	5,500	143,110.00	0.01
418	688290	景业智能	3,040	142,484.80	0.01
419	601933	永辉超市	33,100	141,668.00	0.01
420	002832	比音勒芬	5,600	141,120.00	0.01
421	000915	华特达因	3,400	140,590.00	0.01
422	000598	兴蓉环境	27,500	140,525.00	0.01
423	688075	安旭生物	800	140,008.00	0.01
424	002913	奥士康	4,400	139,260.00	0.01

425	300787	海能实业	4,800	138,912.00	0.01
426	002947	恒铭达	7,400	136,160.00	0.01
427	003019	宸展光电	5,290	133,519.60	0.01
428	688378	奥来德	3,420	133,414.20	0.01
429	300087	荃银高科	8,100	133,326.00	0.01
430	002061	浙江交科	18,900	131,544.00	0.01
431	603968	醋化股份	6,300	129,780.00	0.01
432	300533	冰川网络	4,900	128,870.00	0.00
433	600073	上海梅林	16,100	128,317.00	0.00
434	002658	雪迪龙	18,200	127,946.00	0.00
435	603556	海兴电力	8,400	127,848.00	0.00
436	688360	德马科技	4,800	127,776.00	0.00
437	002133	广宇集团	35,100	127,413.00	0.00
438	600905	三峡能源	20,100	126,429.00	0.00
439	000680	山推股份	24,300	126,360.00	0.00
440	603599	广信股份	4,480	126,112.00	0.00
441	603706	东方环宇	8,000	125,120.00	0.00
442	000960	锡业股份	7,433	124,651.41	0.00
443	002989	中天精装	8,640	124,588.80	0.00
444	300532	今天国际	9,700	124,548.00	0.00
445	300170	汉得信息	13,800	124,338.00	0.00
446	603889	新澳股份	19,600	123,872.00	0.00
447	002091	江苏国泰	11,500	123,625.00	0.00
448	002315	焦点科技	8,700	121,974.00	0.00
449	688606	奥泰生物	1,000	121,620.00	0.00
450	600425	青松建化	29,800	121,286.00	0.00
451	688330	宏力达	1,400	120,386.00	0.00
452	000731	四川美丰	13,200	120,120.00	0.00
453	600295	鄂尔多斯	6,540	118,047.00	0.00
454	603369	今世缘	2,300	117,300.00	0.00
455	600649	城投控股	27,400	117,272.00	0.00
456	600648	外高桥	8,600	116,960.00	0.00
457	603585	苏利股份	6,000	116,580.00	0.00
458	000937	冀中能源	15,400	114,884.00	0.00
459	688399	硕世生物	1,000	114,020.00	0.00
460	002267	陕天然气	16,300	113,937.00	0.00
461	301061	匠心家居	3,360	113,904.00	0.00
462	600787	中储股份	19,700	112,093.00	0.00
463	603177	德创环保	7,300	110,595.00	0.00
464	600328	中盐化工	4,500	105,975.00	0.00
465	600177	雅戈尔	15,900	105,417.00	0.00
466	603279	景津装备	3,380	104,813.80	0.00
467	601857	中国石油	19,700	104,410.00	0.00

468	002727	一心堂	4,400	100,892.00	0.00
469	600048	保利发展	5,500	96,030.00	0.00
470	002088	鲁阳节能	4,287	90,241.35	0.00
471	688115	思林杰	2,153	82,804.38	0.00
472	600690	海尔智家	2,900	79,634.00	0.00
473	001289	龙源电力	3,400	73,984.00	0.00
474	600673	东阳光	8,000	71,920.00	0.00
475	301236	软通动力	2,076	65,144.88	0.00
476	300760	迈瑞医疗	200	62,640.00	0.00
477	600383	金地集团	4,000	53,760.00	0.00
478	300979	华利集团	700	51,156.00	0.00
479	301219	腾远钴业	578	50,759.96	0.00
480	301200	大族数控	857	44,495.44	0.00
481	301206	三元生物	945	43,177.05	0.00
482	688356	键凯科技	157	37,964.17	0.00
483	300568	星源材质	1,292	37,519.68	0.00
484	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.00
485	301150	中一科技	404	33,435.04	0.00
486	301099	雅创电子	400	33,392.00	0.00
487	688575	亚辉龙	1,580	33,053.60	0.00
488	002318	久立特材	2,000	31,980.00	0.00
489	688598	金博股份	101	29,764.70	0.00
490	301109	军信股份	1,838	29,665.32	0.00
491	301302	华如科技	466	26,291.72	0.00
492	301268	铭利达	641	22,351.67	0.00
493	301122	采纳股份	301	21,181.37	0.00
494	688696	极米科技	65	20,011.55	0.00
495	301102	兆讯传媒	642	19,959.78	0.00
496	301127	天源环保	1,685	18,754.05	0.00
497	688766	普冉股份	112	18,270.56	0.00
498	301162	国能日新	334	18,072.74	0.00
499	301123	奕东电子	656	16,655.84	0.00
500	301103	何氏眼科	507	16,234.14	0.00
501	301286	侨源股份	784	15,515.36	0.00
502	301248	杰创智能	472	14,098.64	0.00
503	301212	联盛化学	416	13,844.48	0.00
504	301298	东利机械	634	13,206.22	0.00
505	301148	嘉戎技术	516	12,332.40	0.00
506	301259	艾布鲁	483	12,046.02	0.00
507	688308	欧科亿	179	11,914.24	0.00
508	301097	天益医疗	249	11,909.67	0.00
509	001268	联合精密	409	11,337.48	0.00
510	688357	建龙微纳	100	11,244.00	0.00

511	301220	亚香股份	285	11,157.75	0.00
512	301237	和顺科技	261	10,925.46	0.00
513	301196	唯科科技	271	10,167.92	0.00
514	301125	腾亚精工	327	8,966.34	0.00
515	301163	宏德股份	277	8,955.41	0.00
516	301130	西点药业	237	8,934.90	0.00
517	301135	瑞德智能	338	8,875.88	0.00
518	688181	八亿时空	182	7,880.60	0.00
519	301181	标榜股份	257	7,861.63	0.00
520	301228	实朴检测	373	7,586.82	0.00
521	601985	中国核电	1,100	7,546.00	0.00
522	301279	金道科技	296	6,751.76	0.00
523	688168	安博通	180	6,462.00	0.00
524	688135	利扬芯片	173	5,446.04	0.00
525	688577	浙海德曼	105	4,311.30	0.00
526	688558	国盛智科	78	2,682.42	0.00
527	688139	海尔生物	25	1,820.75	0.00
528	688389	普门科技	100	1,749.00	0.00
529	688314	康拓医疗	25	1,213.75	0.00
530	688029	南微医学	4	348.80	0.00

#### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	300124	汇川技术	25,472,689.84	1.23
2	600519	贵州茅台	18,929,234.00	0.92
3	300390	天华超净	14,906,126.00	0.72
4	300750	宁德时代	13,903,568.17	0.67
5	000858	五粮液	10,085,242.00	0.49
6	300347	泰格医药	9,131,023.00	0.44
7	300832	新产业	9,020,769.87	0.44
8	300529	健帆生物	8,965,913.00	0.43
9	000333	美的集团	8,938,111.00	0.43
10	300316	晶盛机电	8,136,058.00	0.39
11	300122	智飞生物	7,443,172.00	0.36
12	601166	兴业银行	7,302,201.00	0.35
13	002049	紫光国微	6,537,926.01	0.32
14	300059	东方财富	6,461,176.00	0.31
15	000651	格力电器	6,078,813.00	0.29
16	300661	圣邦股份	6,051,051.00	0.29
17	300476	胜宏科技	6,016,911.48	0.29

18	002709	天赐材料	5,913,091.00	0.29
19	002129	TCL 中环	5,898,043.00	0.29
20	603259	药明康德	5,874,533.00	0.28

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。

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	24,963,470.00	1.21
2	300124	汇川技术	15,226,175.62	0.74
3	300750	宁德时代	12,047,638.00	0.58
4	601166	兴业银行	11,340,602.30	0.55
5	601318	中国平安	10,846,788.00	0.53
6	600036	招商银行	9,061,090.42	0.44
7	600887	伊利股份	8,242,340.00	0.40
8	300059	东方财富	8,195,855.00	0.40
9	600438	通威股份	7,536,324.00	0.37
10	300347	泰格医药	7,521,621.50	0.36
11	002129	TCL 中环	7,454,837.00	0.36
12	000858	五粮液	6,828,143.90	0.33
13	300122	智飞生物	6,642,190.00	0.32
14	000333	美的集团	6,109,854.00	0.30
15	300832	新产业	5,971,025.66	0.29
16	300760	迈瑞医疗	5,878,087.00	0.28
17	002539	云图控股	5,779,509.00	0.28
18	300390	天华超净	5,305,833.00	0.26
19	300661	圣邦股份	5,265,382.00	0.26
20	603259	药明康德	5,245,304.00	0.25

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。

#### 7.4.3 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	1,276,404,930.13
卖出股票收入（成交）总额	1,191,002,844.12

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。

#### 7.5 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	187,731,698.26	7.24
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,698,296,484.25	65.50
	其中：政策性金融债	272,090,417.41	10.49
4	企业债券	351,935,189.23	13.57
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	125,936,543.57	4.86
7	可转债（可交换债）	29,972,457.88	1.16
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,393,872,373.19	92.32

7.6 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	2020016	20 江苏银行 永续债	1,300,000	133,338,293.15	5.14
2	2020002	20 杭州银行 永续债	1,150,000	119,844,650.68	4.62
3	2028006	20 邮储银行 永续债	1,100,000	112,859,126.03	4.35
4	2028023	20 招商银行 永续债 01	950,000	100,691,202.74	3.88
5	2028041	20 工商银行 二级 01	800,000	85,222,027.40	3.29

7.7 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。

7.8 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。

7.9 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。

7.10 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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金投资国债期货，根据风险管理的原则，充分考虑国债期货的流动性和风险收益特征，在风险可控的前提下，适度参与国债期货投资。

#### 7.11.2 本期国债期货投资评价

基金参与国债期货投资目的在于利用利率衍生品对冲债券持仓的利率风险，降低组合整体的净值波动率。本期国债期货投资符合基金合同约定的关于衍生品的投资政策，投资过程及策略符合风险控制的要求。

#### 7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国邮政储蓄银行股份有限公司、招商银行股份有限公司、中国工商银行股份有限公司、中国银行股份有限公司、交通银行股份有限公司、国家开发银行出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责、处罚的情况。本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

7.12.2 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。

#### 7.12.3 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	187,719.81
2	应收清算款	11,714,273.08
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	11,094,008.01
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	22,996,000.90

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	127018	本钢转债	18,445,460.65	0.71
2	110053	苏银转债	5,215,550.45	0.20
3	113033	利群转债	4,540,227.97	0.18
4	123025	精测转债	761,754.25	0.03
5	127045	牧原转债	393,320.50	0.02
6	113044	大秦转债	336,989.47	0.01
7	113637	华翔转债	105,514.71	0.00

8	113633	科沃转债	4,748.80	0.00
9	113635	升 21 转债	3,839.20	0.00
10	113634	珀莱转债	2,795.90	0.00

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	600941	中国移动	5,264,494.38	0.20	新发流通受限

7.12.6 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。

## §8 基金份额持有人信息

8.1 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
华夏睿磐泰茂混合 A	34,704	37,757.89	1,148,179,710.87	87.62%	162,170,240.67	12.38%
华夏睿磐泰茂混合 C	35,133	20,189.84	561,041,717.46	79.09%	148,287,817.61	20.91%
合计	69,837	28,919.91	1,709,221,428.33	84.63%	310,458,058.28	15.37%

8.2 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	华夏睿磐泰茂混合 A	313,327.93	0.02%
	华夏睿磐泰茂混合 C	91,015.08	0.01%
	合计	404,343.01	0.02%

8.3 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、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	华夏睿磐泰茂混合 A	0
	华夏睿磐泰茂混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	华夏睿磐泰茂混合 A	0~10
	华夏睿磐泰茂混合 C	0~10

	合计	0~10
--	----	------

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华夏睿磐泰茂混合 A	华夏睿磐泰茂混合 C
基金合同生效日（2017 年 12 月 6 日）基金份额总额	869,223,480.85	4,746,923.50
本报告期期初基金份额总额	901,979,570.73	693,740,757.80
本报告期基金总申购份额	651,979,522.92	574,086,904.56
减：本报告期基金总赎回份额	243,609,142.11	558,498,127.29
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,310,349,951.54	709,329,535.07

## §10 重大事件揭示

### 10.1 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。

### 10.2 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，桂勇先生担任华夏基金管理有限公司首席信息官，李一梅女士不再兼任。华夏基金管理有限公司已根据法律法规的规定完成财务负责人孙立强先生的有关备案工作。

2022 年 3 月，中国农业银行总行决定王霄勇任托管业务部总裁。

2022 年 3 月，中国农业银行总行决定王洪滨任托管业务部高级专家。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 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。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金所聘用的会计师事务所未发生改变。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人、基金托管人涉及托管业务的部门及其高级管理人员在本报告期内无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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	
广发证券	1	454,854,052.73	18.60%	332,635.69	17.00%	-
申万宏源证券	2	356,467,218.96	14.58%	331,979.34	16.97%	-
粤开证券	1	272,576,955.04	11.15%	199,333.55	10.19%	-
光大证券	1	240,881,435.69	9.85%	224,331.77	11.47%	-
华泰证券	1	239,614,980.64	9.80%	223,161.61	11.41%	-
国盛证券	1	230,006,102.34	9.41%	168,202.19	8.60%	-
中泰证券	1	215,341,556.30	8.81%	157,480.23	8.05%	-
华创证券	1	187,117,656.35	7.65%	136,841.59	6.99%	-
渤海证券	1	125,159,918.21	5.12%	91,530.05	4.68%	-
海通证券	2	102,343,314.80	4.19%	74,843.95	3.83%	-
长江证券	2	20,508,129.79	0.84%	16,002.16	0.82%	-
华西证券	1	156,738.49	0.01%	-	-	-

注：①为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择券商的标准，即：

i 经营行为规范。

ii 公司财务状况良好。

iii 有良好的内控制度，在业内有良好的声誉。

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

v 建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯和服务。

②券商专用交易单元选择程序：

i 本基金管理人根据上述标准进行评估并确定选用的券商。

ii 本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议/证券经纪服务协议。

③除本表列示外，本基金还选择了安信证券、财信证券、东北证券、东方财富证券、东海证券、东吴证券、方正证券、高华证券、国金证券、国泰君安证券、国信证券、西部证券、新时代证券、银河证券、中国银河证券、中信建投证券、中银国际证券的交易单元作为本基金交易单元，本报告期无股票交易及应付佣金。

④本报告期内，本基金租用的券商交易单元未发生变更。

10.7.2 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
广发证券	17,654,537.20	3.90%	100,000,000.00	1.59%	-	-	-	-
申万宏源证券	162,740,495.80	35.91%	983,600,000.00	15.62%	-	-	-	-
粤开证券	96,027,774.11	21.19%	1,157,000,000.00	18.37%	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	7,300,061.50	1.61%	2,376,592,000.00	37.74%	-	-	-	-
国盛证券	97,906,282.60	21.60%	1,540,000,000.00	24.46%	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华创证券	53,514,347.93	11.81%	140,000,000.00	2.22%	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	18,029,298.33	3.98%	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-01-21
2	华夏基金管理有限公司关于华夏睿磐泰茂混合型证券投资基金取消申购、定期定额申购业务上限的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-01-26
3	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关	中国证监会指定报刊及	2022-02-12

	联方承销证券的公告	网站	
4	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-02-17
5	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-02-19
6	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-02-23
7	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-03-12
8	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-03-19
9	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-04-08
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	2022-04-13
11	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-04-16
12	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-06-18
13	华夏基金管理有限公司公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-06-24
14	华夏基金管理有限公司公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-06-25

## §11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 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。

## §12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予基金注册的文件；
- 2、《华夏睿磐泰茂混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《华夏睿磐泰茂混合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。

## 12.2 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。

## 12.3 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

二〇二二年八月三十日