

华夏睿磐泰利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：中国光大银行股份有限公司

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。

基金托管人中国光大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.....	41
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.....	42
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.....	55
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	57
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.....	57
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.....	58
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.....	58
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.....	58
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	58
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	58
7.12 投资组合报告附注.....	58
§8 基金份额持有人信息.....	59
§9 开放式基金份额变动.....	60
§10 重大事件揭示.....	60
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	63
§12 备查文件目录.....	63

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华夏睿磐泰利混合型证券投资基金	
基金简称	华夏睿磐泰利混合	
基金主代码	005177	
交易代码	005177	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 12 月 27 日	
基金管理人	华夏基金管理有限公司	
基金托管人	中国光大银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,761,483,046.84 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华夏睿磐泰利混合 A	华夏睿磐泰利混合 C
下属分级基金的交易代码	005177	005178
报告期末下属分级基金的份额总额	1,335,838,784.59 份	425,644,262.25 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，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、股票期权投资策略等。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×20%+上证国债指数收益率×80%。
风险收益特征	本基金为混合基金，其长期平均风险和预期收益率低于股票基金，高于债券基金、货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华夏基金管理有限公司	中国光大银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李彬	石立平
	联系电话	400-818-6666	010-63639180
	电子邮箱	service@ChinaAMC.com	shiliping@cebbank.com
客户服务电话		400-818-6666	95595
传真		010-63136700	010-63639132
注册地址		北京市顺义区安庆大街甲3号院	北京市西城区太平桥大街25号、甲25号中国光大中心

办公地址	北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座8层	北京市西城区太平桥大街25号中国光大中心
邮政编码	100033	100033
法定代表人	杨明辉	李晓鹏

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
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）	
	华夏睿磐泰利混合 A	华夏睿磐泰利混合 C
本期已实现收益	-181,842.05	23,400.33
本期利润	3,510,069.05	2,488,594.31
加权平均基金份额本期利润	0.0034	0.0091
本期加权平均净值利润率	0.26%	0.70%
本期基金份额净值增长率	-0.26%	-0.40%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)	
	华夏睿磐泰利混合 A	华夏睿磐泰利混合 C
期末可供分配利润	352,692,251.83	105,996,185.32
期末可供分配基金份额利润	0.2640	0.2490
期末基金资产净值	1,769,847,293.18	557,437,793.16
期末基金份额净值	1.3249	1.3096
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)	
	华夏睿磐泰利混合 A	华夏睿磐泰利混合 C
基金份额累计净值增长率	38.34%	36.96%

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

华夏睿磐泰利混合 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	1.01%	0.13%	1.93%	0.21%	-0.92%	-0.08%
过去三个月	1.04%	0.15%	2.00%	0.30%	-0.96%	-0.15%
过去六个月	-0.26%	0.16%	-0.28%	0.30%	0.02%	-0.14%
过去一年	4.60%	0.19%	1.31%	0.25%	3.29%	-0.06%
过去三年	34.99%	0.23%	15.29%	0.25%	19.70%	-0.02%
自基金转型起至今	38.34%	0.23%	17.11%	0.26%	21.23%	-0.03%

华夏睿磐泰利混合 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	0.98%	0.13%	1.93%	0.21%	-0.95%	-0.08%
过去三个月	0.96%	0.15%	2.00%	0.30%	-1.04%	-0.15%
过去六个月	-0.40%	0.16%	-0.28%	0.30%	-0.12%	-0.14%
过去一年	4.30%	0.19%	1.31%	0.25%	2.99%	-0.06%
过去三年	33.79%	0.23%	15.29%	0.25%	18.50%	-0.02%
自基金转型起至今	36.96%	0.23%	17.11%	0.26%	19.85%	-0.03%

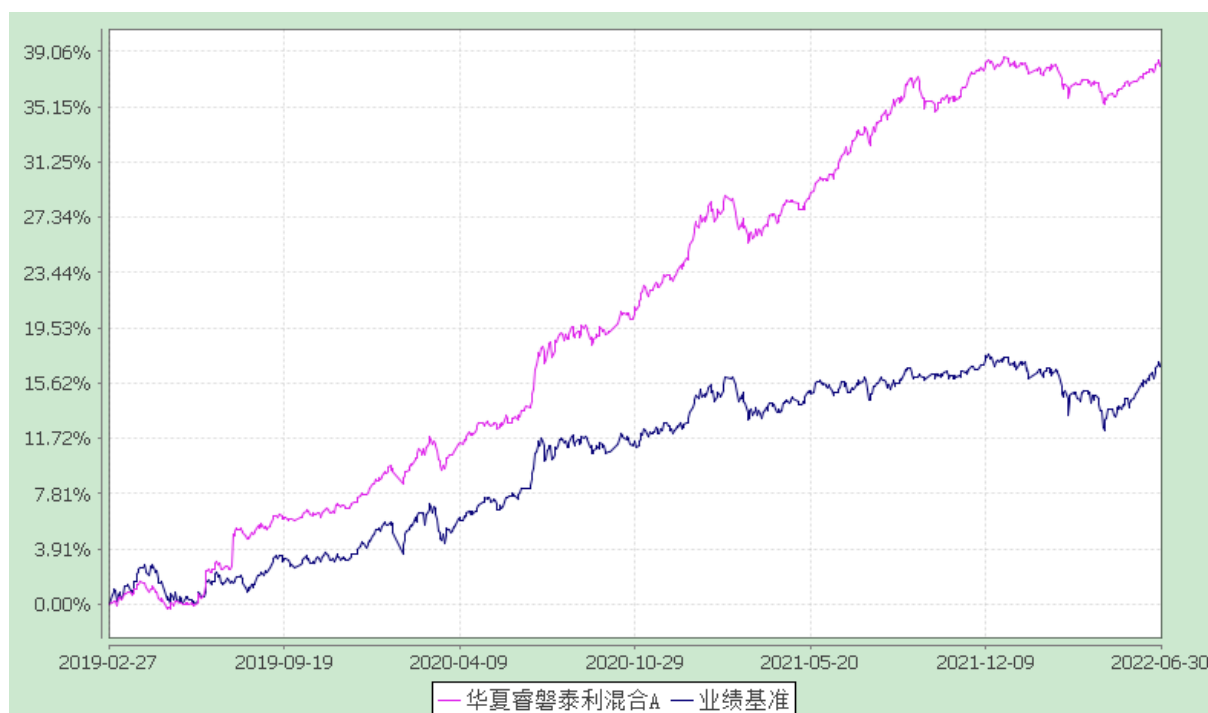
3.2.2 自基金转型以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华夏睿磐泰利混合型证券投资基金

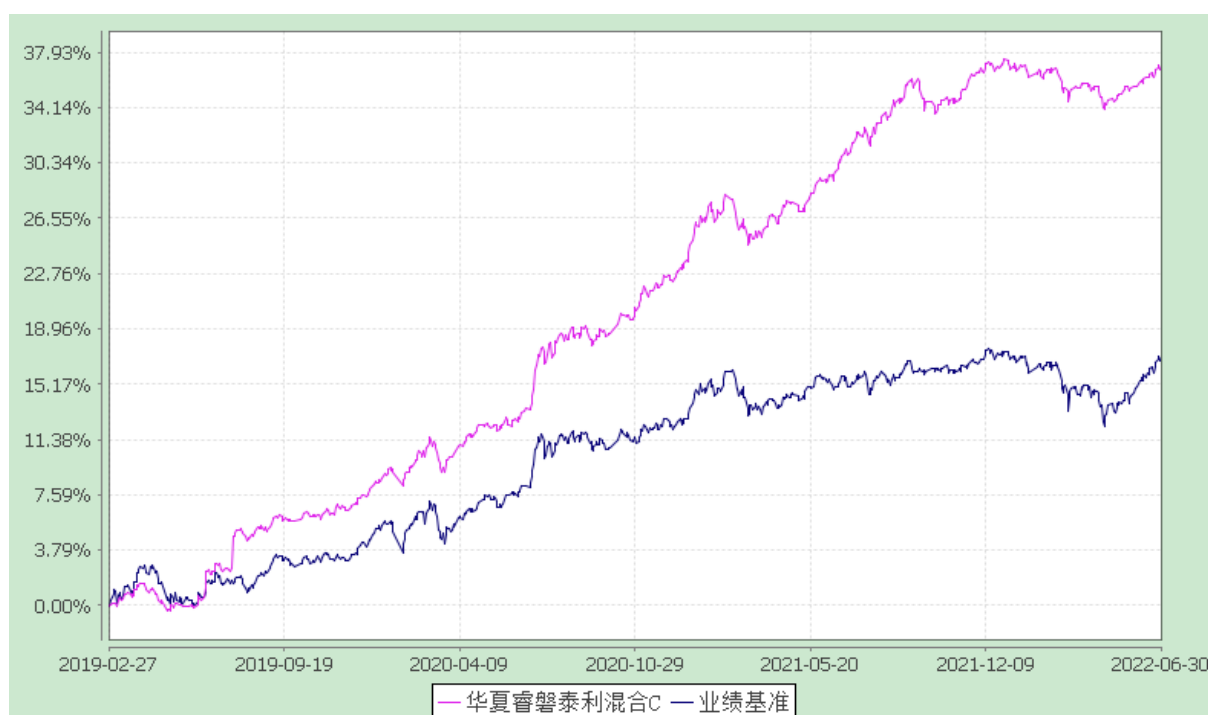
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2019年2月27日至2022年6月30日)

华夏睿磐泰利混合 A



华夏睿磐泰利混合 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	2019-02-27	-	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

1 季度，债券走出先下后上季末再度下行的震荡行情。1 月 17 日央行调降 MLF 以及 OMO 利率之后，利率快速下行并突破前低，乐观情绪一直持续到了春节前。春节期间，海外原油价格大涨、美债收益率快速上行，对市场情绪产生了一定影响，节后债券持续回调，随后在 1 月社融超预期、地产放松政策等刺激下，利率进一步加速上行。3 月中旬以后，疫情超预期暴发，叠加 2 月社融数据极差，市场降准降息预期较浓，收益率上行势头暂缓，在基本面“弱现实、强预期”的组合下，利率整体呈区间震荡走势。全季度来看，各期限涨跌不一，其中 1 年国债收益率下行 8.5bp，10 年国债收益率上行 1bp，曲线形态大幅走陡。2 季度，债券收益率在 4-5 月下行，信用债中长端在 5 月的下行幅度创年内最大，将欠配行情演绎到极致。进入 6 月后，收益率在复工复产、美国加息、地产销售回暖的多重利空下进入震荡上行状态。以 6 月为分水岭，市场的交易逻辑发生了明显变化，4 月-6 月，市场以持续宽松的资金面、疫情对经济的负面冲击为主线，6 月后，债券市场的主线转向经济复苏。伴随上海复工复产和多项高频数据的回暖，经济底部确认成为共识，分歧或不确定性主要在于复苏的斜率，市场预期多有波动和反复。在明牌宽货币（如降息）的缺席下，债市在 6 月走出了震荡偏空行情，与权益的“股债跷跷板”特征较为明显。

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；债券端组合一季度持续降低久期，保持较为防御的姿态，新增配置集中在中短端信用债，二季度逐步拉长久期，在银行资本补充债上积极配置，保持中性略偏高的市场久期。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2022 年 6 月 30 日，华夏睿磐泰利混合 A 基金份额净值为 1.3249 元，本报告期份额净值增

长率为-0.26%；华夏睿磐泰利混合 C 基金份额净值为 1.3096 元，本报告期份额净值增长率为-0.40%，同期业绩比较基准增长率为-0.28%。

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，财政政策能保持较高强度，但地产难有明显起色，出口趋于下行，经济内生动能远远不及 2020 年，决定了下半年的经济复苏斜率相对于 2020 年斜率有限。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。在债券市场方面，从市场节奏上来看，预计三季度震荡，四季度有望打开下行空间。具体地，下半年的利率债配置策略为四季度或存在拉长久期的较好时点，三季度资金面宽松+长期对财政政策加码无法证伪下预计震荡，适度积极参与利率债的波段交易，信用债方面受益于供需格局 3 季度保持中性偏高久期，同时，我们会把握波段积极配置资本债。

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

本报告期内，中国光大银行股份有限公司在华夏睿磐泰利混合型证券投资基金（以下称“本基金”）托管过程中，严格遵守了《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》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，依法安全保管了基金的全部资产，对本基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督，对发现的问题及时提出了意见和建议。同时，按规定如实、独立地向监管机构提交了本基金运作情况报告，没有发生任何损害基金份额持有人利益的行为，诚实信用、勤勉尽责地履行了作为基金托管人所应尽的义务。

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

本报告期内，中国光大银行股份有限公司依据《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》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，对基金管理人的投资运作、信息披露等行为进行了复核、监督，未发现基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金在运作中遵守了有关法律法规的要求，各重要方面由投资管理人依据基金合同及实际运作情况进行处理。

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

中国光大银行股份有限公司依法对基金管理人编制的《华夏睿磐泰利混合型证券投资基金 2022 年中期报告》进行了复核，认为报告中相关财务指标、净值表现、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确。

§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：华夏睿磐泰利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
资产：			
银行存款	6.4.7.1	42,865,049.01	13,852,403.36
结算备付金		11,610,907.28	15,844,828.49
存出保证金		115,784.75	20,389.76
交易性金融资产	6.4.7.2	1,993,735,474.55	945,379,586.89

其中：股票投资		270,634,074.27	140,251,979.91
基金投资		-	-
债券投资		1,723,101,400.28	805,127,606.98
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	-	-
应收清算款		261,466,042.01	40,098,137.20
应收股利		-	-
应收申购款		25,319,133.72	320,353.15
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	8,739,891.28
资产总计		2,335,112,391.32	1,024,255,590.13
负债和净资产	附注号	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
负债：			
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		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		5,189,282.46	42,228,281.13
应付管理人报酬		1,095,481.10	488,329.82
应付托管费		182,580.20	81,388.29
应付销售服务费		129,377.15	57,422.37
应付投资顾问费		-	-
应交税费		66,513.24	9,537.85
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	1,164,070.83	650,302.79
负债合计		7,827,304.98	43,515,262.25
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	1,761,483,046.84	740,017,486.69
未分配利润	6.4.7.8	565,802,039.50	240,722,841.19
净资产合计		2,327,285,086.34	980,740,327.88
负债和净资产总计		2,335,112,391.32	1,024,255,590.13

注：①报告截止日 2022 年 6 月 30 日，华夏睿磐泰利混合 A 基金份额净值 1.3249 元，华夏睿磐泰利混合 C 基金份额净值 1.3096 元；华夏睿磐泰利混合基金份额总额 1,761,483,046.84 份（其中 A 类 1,335,838,784.59 份，C 类 425,644,262.25 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：华夏睿磐泰利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
一、营业总收入		12,552,478.51	42,984,440.91
1.利息收入		1,505,194.38	10,366,936.36
其中：存款利息收入	6.4.7.9	632,377.12	140,932.70
债券利息收入		-	10,004,490.67
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		872,817.26	221,512.99
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		4,413,306.34	40,701,934.49
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-26,780,685.70	39,772,675.02
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	28,585,036.60	-889,502.34
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	100,186.15	964,019.41
股利收益	6.4.7.14	2,508,769.29	854,742.40
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	6,157,105.08	-8,097,391.33
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	476,872.71	12,961.39
减：二、营业总支出		6,553,815.15	3,696,834.66
1.管理人报酬		5,057,018.86	2,171,967.99
2.托管费		842,836.49	361,994.68
3.销售服务费		518,516.61	91,918.69
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		1,986.41	113,403.98
其中：卖出回购金融资产支出		1,986.41	113,403.98

6.信用减值损失	6.4.7.17	-	-
7.税金及附加		30,554.22	16,968.79
8.其他费用	6.4.7.18	102,902.56	940,580.53
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		5,998,663.36	39,287,606.25
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		5,998,663.36	39,287,606.25
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		5,998,663.36	39,287,606.25

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：华夏睿磐泰利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）	740,017,486.69	-	240,722,841.19	980,740,327.88
二、本期期初净资产（基金净值）	740,017,486.69	-	240,722,841.19	980,740,327.88
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	1,021,465,560.15	-	325,079,198.31	1,346,544,758.46
（一）、综合收益总额	-	-	5,998,663.36	5,998,663.36
（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）	1,021,465,560.15	-	319,080,534.95	1,340,546,095.10
其中：1.基金申购款	1,387,458,265.92	-	430,395,320.39	1,817,853,586.31
2.基金赎回款	-365,992,705.77	-	-111,314,785.44	-477,307,491.21
（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）	1,761,483,046.84	-	565,802,039.50	2,327,285,086.34
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）	562,054,810.38	-	143,937,722.69	705,992,533.07
二、本期期初净资产（基金净值）	562,054,810.38	-	143,937,722.69	705,992,533.07
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	88,142,484.96	-	66,595,862.54	154,738,347.50
（一）、综合收益总额	-	-	39,287,606.25	39,287,606.25
（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）	88,142,484.96	-	27,308,256.29	115,450,741.25
其中：1.基金申购款	318,445,572.02	-	89,384,478.93	407,830,050.95
2.基金赎回款	-230,303,087.06	-	-62,076,222.64	-292,379,309.70
（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）	650,197,295.34	-	210,533,585.23	860,730,880.57

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

原华夏睿磐泰利六个月定期开放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]1560号《关于准予华夏睿磐泰利六个月定期开放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》、《华夏睿磐泰利六个月定期开放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、定期开放式，存续期限为不定期。本基金自 2017 年 11 月 27 日至 2017 年 12 月 22 日共募集 236,001,759.07 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_A36 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华夏睿磐泰利六个月定期开放混合型证券投资基金基金合同》于 2017 年 12 月 27 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 236,086,689.29 份基金份额，其中认购资金利息折合 84,930.22 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，基金托管人为中国光大银行股份有限公司。华夏睿磐泰利六个月定期开放混合型证券投资基金截至第二个开放期末日即 2019 年 2 月 26 日日终，基金资产净值低于 5000 万元，触发基金合同约定的转型条款，经与基金托管人中国光大银行股份有限公司协商一致，根据基金管理人 2019 年 2 月 27 日刊登的《华夏基金管理有限公司关于华夏睿磐泰利六个月定期开放混合型证券投资基金触发转型条款并实施转型的公告》，自 2019 年 2 月 27 日起，“华夏睿磐泰利六个月定期开放混合型证券投资基金”正式转型为“华夏睿磐泰利混合型证券投资基金”，转型后的华夏睿磐泰利混合型证券投资基金为每日开放申购、赎回、转换、定期定额申购业务的普通开放式基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华夏睿磐泰利混合型证券投资基金基金合同》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、中小企业私募债券、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）、资产支持证券、衍生品（包括权证、股指期货、股票期权、国债期货等）、货币市场工具（含同业存单）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。

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、应收证券清算款和应收申购款，金额分别为 13,852,403.36 元、15,844,828.49 元、20,389.76 元、0.00 元、8,739,891.28 元、40,098,137.20 元和 320,353.15 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、应收清算款和应收申购款，金额分别为 13,861,697.09 元、15,854,035.78 元、20,399.88 元、-18,032.87 元、0.00 元、40,098,137.20 元和 320,353.15 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 945,379,586.89 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 954,118,999.90 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付赎回款、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 42,228,281.13 元、488,329.82 元、81,388.29 元、57,422.37 元、480,213.30 元和 170,089.49 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付赎回款、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 42,228,281.13 元、488,329.82 元、81,388.29 元、57,422.37 元、480,213.30 元和 170,089.49 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	42,865,049.01
等于：本金	42,850,119.21
加：应计利息	14,929.80
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	42,865,049.01

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	253,977,359.12	-	270,634,074.27	16,656,715.15
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	7,758,648.51	438,119,128.91	-373,439.59
	银行间市场	1,258,778,885.70	22,767,771.37	3,435,614.30
	合计	1,689,512,805.69	30,526,419.88	1,723,101,400.28
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,943,490,164.81	30,526,419.88	1,993,735,474.55	19,718,889.86

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	1,318.94
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	1,028,449.33
其中：交易所市场	1,022,749.33
银行间市场	5,700.00
应付利息	-
预提费用	134,302.56
合计	1,164,070.83

6.4.7.7 实收基金

华夏睿磐泰利混合 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	572,221,970.00	572,221,970.00
本期申购	975,718,855.90	975,718,855.90
本期赎回（以“-”号填列）	-212,102,041.31	-212,102,041.31
本期末	1,335,838,784.59	1,335,838,784.59

华夏睿磐泰利混合 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	167,795,516.69	167,795,516.69
本期申购	411,739,410.02	411,739,410.02
本期赎回（以“-”号填列）	-153,890,664.46	-153,890,664.46
本期末	425,644,262.25	425,644,262.25

6.4.7.8 未分配利润

华夏睿磐泰利混合 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	150,105,845.73	37,778,365.08	187,884,210.81
本期利润	-181,842.05	3,691,911.10	3,510,069.05
本期基金份额交易产生的变动数	202,768,248.15	39,845,980.58	242,614,228.73
其中：基金申购款	258,558,641.45	49,579,648.72	308,138,290.17
基金赎回款	-55,790,393.30	-9,733,668.14	-65,524,061.44
本期已分配利润	-	-	-
本期末	352,692,251.83	81,316,256.76	434,008,508.59

华夏睿磐泰利混合 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	41,819,644.99	11,018,985.39	52,838,630.38
本期利润	23,400.33	2,465,193.98	2,488,594.31
本期基金份额交易产生的变动数	64,153,140.00	12,313,166.22	76,466,306.22
其中：基金申购款	102,068,296.60	20,188,733.62	122,257,030.22
基金赎回款	-37,915,156.60	-7,875,567.40	-45,790,724.00
本期已分配利润	-	-	-
本期末	105,996,185.32	25,797,345.59	131,793,530.91

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	547,085.17
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	84,730.92
其他	561.03
合计	632,377.12

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	633,853,217.64
减：卖出股票成本总额	658,809,781.94
减：交易费用	1,824,121.40

买卖股票差价收入	-26,780,685.70
----------	----------------

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	20,982,315.06
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	7,602,721.54
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	28,585,036.60

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	761,057,973.75
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	744,215,692.13
减：应计利息总额	9,223,946.34
减：交易费用	15,613.74
买卖债券差价收入	7,602,721.54

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	100,186.15

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	2,508,769.29
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,508,769.29

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	6,157,105.08
——股票投资	14,798,832.00
——债券投资	-8,641,726.92
——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	6,157,105.08

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	476,872.71
基金申购费收入	-
合计	476,872.71

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	24,795.19
信息披露费	59,507.37

证券出借违约金	-
银行间账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	102,902.56

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
中国光大银行股份有限公司（“中国光大银行”）	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
中信证券华南股份有限公司（“中信证券（华南）”）	基金管理人股东控股的公司
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	5,057,018.86	2,171,967.99
其中：支付销售机构的客户维护费	674,621.21	182,896.88

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 0.60%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×0.60%/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 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托管费	842,836.49	361,994.68

注：①支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值 0.10%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×0.10%/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		
	华夏睿磐泰利混合 A	华夏睿磐泰利混合 C	合计
华夏基金管理 有限公司	-	146,981.51	146,981.51
华夏财富	-	18,245.87	18,245.87
中国光大银 行	-	3,871.49	3,871.49
中信证券	-	34.32	34.32

(山东)			
中信证券	-	22.05	22.05
中信证券 (华南)	-	0.54	0.54
合计	-	169,155.78	169,155.78
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		
	华夏睿磐泰利混合 A	华夏睿磐泰利混合 C	合计
华夏基金管 理有限公司	-	33,093.55	33,093.55
华夏财富	-	25,125.02	25,125.02
中国光大银 行	-	4,190.46	4,190.46
中信证券 (山东)	-	28.49	28.49
中信证券	-	5.29	5.29
合计	-	62,442.81	62,442.81

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
中国光大银行活期存款	42,865,049.01	547,085.17	6,349,633.06	87,882.09

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国光大银行保管，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	688326	经纬恒润	新股发行	6,756	817,476.00
中信证券	688223	晶科能源	新股发行	131,421	657,105.00
中信证券	301200	大族数控	新股发行	7,538	577,109.28
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	11,849	495,169.71
中信证券	688660	电气风电	网下申购	41,435	225,406.40
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
中国光大银行	688669	聚石化学	网下申购	2,681	98,258.65
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
中国光大银行	688601	力芯微	网下申购	1,174	42,827.52
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
中国光大银行	605117	德业股份	网下申购	627	20,527.98
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
中国光大银行	605287	德才股份	网下申购	349	11,014.44
中国光大银行	003042	中农联合	网下申购	420	9,055.20
中信证券	605488	福莱新材	网下申购	416	8,498.88
中国光大银行	605378	野马电池	网下申购	473	8,334.26
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	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

				受限类型						
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	-
688326	经纬恒润	2022-04-11	6 个月	新发流通受限	121.00	134.07	6,756	817,476.00	905,776.92	-
688048	长光华芯	2022-03-25	6 个月	新发流通受限	80.80	111.97	6,790	548,632.00	760,276.30	-
688045	必易微	2022-05-19	6 个月	新发流通受限	55.15	61.98	3,939	217,235.85	244,139.22	-
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	-
301236	软通动力	2022-03-08	6 个月	新发流通	72.88	31.38	1,578	76,669.76	49,517.64	含 证 券 送

				受限						配
301200	大族数控	2022-02-18	6 个月	新发流通受限	76.56	51.92	754	57,726.24	39,147.68	-
301219	腾远钴业	2022-03-10	6 个月	新发流通受限	173.98	87.82	382	36,883.76	33,547.24	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
301206	三元生物	2022-01-26	6 个月	新发流通受限	109.30	45.69	683	49,731.50	31,206.27	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	铭利达	2022-03-29	6 个月	新发流通受限	28.50	34.87	641	18,268.50	22,351.67	-

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	新发流通受限	16.91	19.79	784	13,257.44	15,515.36	-
301248	杰创	2022-04-13	6 个月	新发	39.07	29.87	472	18,441.04	14,098.64	-

	智能			流通受限						
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	56.69	41.86	261	14,796.09	10,925.46	-

				受限						
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	实朴检测	2022-01-21	6 个月	新发流通受限	20.08	20.34	373	7,489.84	7,586.82	-

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	20	2,000.00	2,000.15	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

无。

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之内。

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	42,865,049.01	-	-	42,865,049.01
结算备付金	11,610,907.28	-	-	11,610,907.28
结算保证金	115,784.75	-	-	115,784.75
债券投资	225,175,040.69	1,466,876,677.40	31,049,682.19	1,723,101,400.28
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	-	-	-	-
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	13,852,403.36	-	-	13,852,403.36
结算备付金	15,844,828.49	-	-	15,844,828.49
结算保证金	20,389.76	-	-	20,389.76
债券投资	98,013,199.98	583,591,700.00	123,522,707.00	805,127,606.98
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	-	-	-	-

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	9,347,782.72	8,012,172.86
	利率上升 25 个基点	-9,267,602.90	-7,880,268.33

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	270,634,074.27	11.63	140,251,979.91	14.30
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	147,584.20	0.01	31,929,199.98	3.26
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	270,781,658.47	11.64	172,181,179.89	17.56

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%	-13,734,347.49	-6,937,445.96
	+5%	13,734,347.49	6,937,445.96

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	261,516,927.64
第二层次	1,723,171,153.54
第三层次	9,047,393.37
合计	1,993,735,474.55

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	270,634,074.27	11.59
	其中：股票	270,634,074.27	11.59
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,723,101,400.28	73.79
	其中：债券	1,723,101,400.28	73.79
	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	54,475,956.29	2.33
8	其他各项资产	286,900,960.48	12.29
9	合计	2,335,112,391.32	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	822,700.20	0.04
B	采矿业	11,611,556.44	0.50
C	制造业	197,041,240.43	8.47
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,500,946.88	0.32
E	建筑业	887,377.60	0.04
F	批发和零售业	3,314,238.00	0.14
G	交通运输、仓储和邮政业	6,722,802.53	0.29
H	住宿和餐饮业	4,576.44	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	16,417,485.50	0.71
J	金融业	13,884,882.55	0.60
K	房地产业	4,575,622.00	0.20
L	租赁和商务服务业	792,627.78	0.03
M	科学研究和技术服务业	4,210,546.99	0.18
N	水利、环境和公共设施管理业	1,415,437.79	0.06
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,101,242.14	0.05
R	文化、体育和娱乐业	290,336.00	0.01
S	综合	40,455.00	0.00
	合计	270,634,074.27	11.63

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	91,000	7,953,400.00	0.34
2	600941	中国移动	91,063	5,488,344.38	0.24
3	300750	宁德时代	9,600	5,126,400.00	0.22
4	300124	汇川技术	77,100	5,078,577.00	0.22
5	600519	贵州茅台	2,000	4,090,000.00	0.18
6	000858	五粮液	15,300	3,089,529.00	0.13
7	300529	健帆生物	55,900	2,844,751.00	0.12
8	300122	智飞生物	24,000	2,664,240.00	0.11
9	688123	聚辰股份	22,700	2,418,004.00	0.10
10	300316	晶盛机电	35,200	2,379,168.00	0.10
11	300432	富临精工	107,200	2,358,400.00	0.10
12	300130	新国都	187,800	2,302,428.00	0.10
13	000333	美的集团	36,955	2,231,712.45	0.10
14	600096	云天化	69,800	2,197,304.00	0.09

15	000625	长安汽车	125,060	2,166,039.20	0.09
16	002466	天齐锂业	17,300	2,159,040.00	0.09
17	000729	燕京啤酒	205,900	1,988,994.00	0.09
18	000893	亚钾国际	57,100	1,964,811.00	0.08
19	002996	顺博合金	127,400	1,936,480.00	0.08
20	600348	华阳股份	124,500	1,924,770.00	0.08
21	002709	天赐材料	31,000	1,923,860.00	0.08
22	688396	华润微	31,900	1,884,333.00	0.08
23	601156	东航物流	94,700	1,875,060.00	0.08
24	002129	TCL 中环	31,600	1,860,924.00	0.08
25	605368	蓝天燃气	146,800	1,849,680.00	0.08
26	600273	嘉化能源	169,500	1,840,770.00	0.08
27	000708	中信特钢	91,200	1,837,680.00	0.08
28	300196	长海股份	97,200	1,836,108.00	0.08
29	600160	巨化股份	133,900	1,760,785.00	0.08
30	002304	洋河股份	9,600	1,758,240.00	0.08
31	000651	格力电器	51,500	1,736,580.00	0.07
32	601677	明泰铝业	72,900	1,735,020.00	0.07
33	300604	长川科技	38,400	1,733,760.00	0.07
34	600863	内蒙华电	470,900	1,718,785.00	0.07
35	000553	安道麦 A	141,600	1,714,776.00	0.07
36	300855	图南股份	40,550	1,694,584.50	0.07
37	002182	云海金属	65,900	1,652,772.00	0.07
38	300037	新宙邦	31,340	1,647,230.40	0.07
39	300373	扬杰科技	23,000	1,638,750.00	0.07
40	601899	紫金矿业	174,400	1,627,152.00	0.07
41	000552	靖远煤电	372,400	1,605,044.00	0.07
42	601166	兴业银行	78,800	1,568,120.00	0.07
43	688668	鼎通科技	21,101	1,484,244.34	0.06
44	002801	微光股份	49,600	1,480,560.00	0.06
45	603259	药明康德	14,000	1,455,860.00	0.06
46	688033	天宜上佳	68,501	1,454,961.24	0.06
47	000629	攀钢钒钛	379,500	1,442,100.00	0.06
48	300926	博俊科技	60,600	1,415,010.00	0.06
49	002049	紫光国微	7,400	1,403,928.00	0.06
50	002459	晶澳科技	17,780	1,402,842.00	0.06
51	000001	平安银行	93,300	1,397,634.00	0.06
52	600888	新疆众和	150,750	1,386,900.00	0.06
53	300832	新产业	30,500	1,375,855.00	0.06
54	003038	鑫铂股份	27,200	1,370,880.00	0.06
55	600809	山西汾酒	4,200	1,364,160.00	0.06
56	601318	中国平安	28,900	1,349,341.00	0.06
57	605198	德利股份	73,966	1,349,139.84	0.06

58	300160	秀强股份	164,600	1,338,198.00	0.06
59	600938	中国海油	84,004	1,332,303.44	0.06
60	300231	银信科技	174,800	1,323,236.00	0.06
61	000559	万向钱潮	222,000	1,318,680.00	0.06
62	300327	中颖电子	26,446	1,317,275.26	0.06
63	300363	博腾股份	16,800	1,310,232.00	0.06
64	600438	通威股份	21,800	1,304,948.00	0.06
65	002916	深南电路	13,900	1,302,569.00	0.06
66	002821	凯莱英	4,500	1,300,500.00	0.06
67	600867	通化东宝	125,100	1,293,534.00	0.06
68	300938	信测标准	46,243	1,280,468.67	0.06
69	603128	华贸物流	127,200	1,275,816.00	0.05
70	605169	洪通燃气	112,788	1,269,992.88	0.05
71	002908	德生科技	109,340	1,261,783.60	0.05
72	000661	长春高新	5,100	1,190,442.00	0.05
73	300482	万孚生物	29,100	1,184,661.00	0.05
74	600018	上港集团	203,200	1,184,656.00	0.05
75	002001	新和成	50,400	1,149,624.00	0.05
76	002410	广联达	21,000	1,143,240.00	0.05
77	300033	同花顺	11,700	1,124,955.00	0.05
78	600036	招商银行	26,000	1,097,200.00	0.05
79	000876	新希望	70,800	1,083,240.00	0.05
80	300628	亿联网络	14,100	1,073,715.00	0.05
81	002555	三七互娱	50,500	1,072,115.00	0.05
82	001979	招商蛇口	76,800	1,031,424.00	0.04
83	600887	伊利股份	25,000	973,750.00	0.04
84	000877	天山股份	76,300	938,490.00	0.04
85	002938	鹏鼎控股	30,000	906,300.00	0.04
86	688326	经纬恒润	6,756	905,776.92	0.04
87	688303	大全能源	13,100	894,992.00	0.04
88	002648	卫星化学	34,240	885,104.00	0.04
89	601088	中国神华	25,800	859,140.00	0.04
90	601728	中国电信	229,900	857,527.00	0.04
91	300171	东富龙	24,600	834,186.00	0.04
92	300059	东方财富	31,228	793,191.20	0.03
93	002736	国信证券	81,100	776,127.00	0.03
94	002286	保龄宝	66,800	764,860.00	0.03
95	300661	圣邦股份	4,200	764,484.00	0.03
96	688048	长光华芯	6,790	760,276.30	0.03
97	688707	振华新材	9,701	734,074.67	0.03
98	002371	北方华创	2,600	720,512.00	0.03
99	002180	纳思达	14,100	713,742.00	0.03
100	002714	牧原股份	12,860	710,772.20	0.03

101	002460	赣锋锂业	4,700	698,890.00	0.03
102	300861	美畅股份	7,500	695,175.00	0.03
103	003019	宸展光电	26,665	673,024.60	0.03
104	601398	工商银行	140,200	668,754.00	0.03
105	688556	高测股份	8,121	655,364.70	0.03
106	688075	安旭生物	3,700	647,537.00	0.03
107	688499	利元亨	2,900	641,770.00	0.03
108	300347	泰格医药	5,600	640,920.00	0.03
109	688360	德马科技	23,800	633,556.00	0.03
110	688378	奥来德	16,220	632,742.20	0.03
111	002405	四维图新	41,800	629,926.00	0.03
112	601225	陕西煤业	29,700	629,046.00	0.03
113	002597	金禾实业	14,300	619,619.00	0.03
114	688800	瑞可达	4,900	618,919.00	0.03
115	002986	宇新股份	26,320	617,993.60	0.03
116	000733	振华科技	4,500	611,865.00	0.03
117	688606	奥泰生物	4,896	595,451.52	0.03
118	002756	永兴材料	3,800	578,398.00	0.02
119	000519	中兵红箭	19,800	577,170.00	0.02
120	000895	双汇发展	19,500	571,350.00	0.02
121	601012	隆基绿能	8,568	570,885.84	0.02
122	300218	安利股份	39,900	569,373.00	0.02
123	002594	比亚迪	1,700	566,933.00	0.02
124	600639	浦东金桥	41,700	566,703.00	0.02
125	688191	智洋创新	31,800	540,600.00	0.02
126	600873	梅花生物	47,900	540,312.00	0.02
127	603948	建业股份	18,600	523,590.00	0.02
128	601688	华泰证券	36,200	514,040.00	0.02
129	600905	三峡能源	81,100	510,119.00	0.02
130	002120	韵达股份	29,900	510,094.00	0.02
131	688356	键凯科技	2,100	507,801.00	0.02
132	600233	圆通速递	24,827	506,222.53	0.02
133	002993	奥海科技	12,100	502,876.00	0.02
134	603185	上机数控	3,220	502,287.80	0.02
135	688385	复旦微电	7,702	502,093.38	0.02
136	300803	指南针	8,500	499,630.00	0.02
137	600256	广汇能源	47,400	499,596.00	0.02
138	601717	郑煤机	34,600	498,586.00	0.02
139	601211	国泰君安	32,700	497,040.00	0.02
140	300751	迈为股份	1,000	490,900.00	0.02
141	688330	宏力达	5,700	490,143.00	0.02
142	300911	亿田智能	6,300	484,155.00	0.02
143	300896	爱美客	800	480,008.00	0.02

144	605123	派克新材	3,400	478,448.00	0.02
145	601668	中国建筑	89,620	476,778.40	0.02
146	002920	德赛西威	3,200	473,600.00	0.02
147	688559	海目星	6,500	472,550.00	0.02
148	301035	润丰股份	5,700	469,965.00	0.02
149	688690	纳微科技	5,800	468,698.00	0.02
150	002738	中矿资源	5,060	468,606.60	0.02
151	600486	扬农化工	3,500	466,480.00	0.02
152	603392	万泰生物	3,000	465,900.00	0.02
153	300770	新媒股份	12,300	465,309.00	0.02
154	605008	长鸿高科	33,000	462,660.00	0.02
155	002432	九安医疗	7,700	462,462.00	0.02
156	603155	新亚强	12,300	458,298.00	0.02
157	301004	嘉益股份	19,100	451,906.00	0.02
158	301018	申菱环境	17,500	451,675.00	0.02
159	600916	中国黄金	38,600	451,620.00	0.02
160	605208	永茂泰	28,525	451,550.75	0.02
161	605369	拱东医疗	3,600	447,120.00	0.02
162	603931	格林达	22,000	442,200.00	0.02
163	600325	华发股份	58,200	440,574.00	0.02
164	000792	盐湖股份	14,700	440,412.00	0.02
165	688981	中芯国际	9,701	438,194.17	0.02
166	688601	力芯微	2,900	435,000.00	0.02
167	301060	兰卫医学	12,400	434,248.00	0.02
168	300837	浙矿股份	10,700	433,885.00	0.02
169	605599	菜百股份	39,400	428,672.00	0.02
170	688575	亚辉龙	20,440	427,604.80	0.02
171	300639	凯普生物	19,500	416,910.00	0.02
172	688569	铁科轨道	22,700	416,545.00	0.02
173	601336	新华保险	12,900	415,251.00	0.02
174	601568	北元集团	65,400	414,636.00	0.02
175	688767	博拓生物	6,700	413,122.00	0.02
176	600901	江苏租赁	80,400	412,452.00	0.02
177	001203	大中矿业	36,400	411,320.00	0.02
178	601138	工业富联	41,800	411,312.00	0.02
179	605033	美邦股份	17,500	405,825.00	0.02
180	002191	劲嘉股份	37,800	405,216.00	0.02
181	600064	南京高科	36,600	402,600.00	0.02
182	002645	华宏科技	18,300	399,306.00	0.02
183	603565	中谷物流	25,100	398,337.00	0.02
184	000301	东方盛虹	23,500	397,385.00	0.02
185	600050	中国联通	112,900	390,634.00	0.02
186	002841	视源股份	5,100	384,132.00	0.02

187	000517	荣安地产	118,700	377,466.00	0.02
188	600566	济川药业	13,803	374,889.48	0.02
189	000935	四川双马	15,400	372,988.00	0.02
190	600188	兖矿能源	9,400	371,112.00	0.02
191	300699	光威复材	6,300	370,881.00	0.02
192	300244	迪安诊断	11,900	370,090.00	0.02
193	600111	北方稀土	10,500	369,180.00	0.02
194	600884	杉杉股份	12,400	368,528.00	0.02
195	002895	川恒股份	10,800	365,148.00	0.02
196	600389	江山股份	6,000	364,380.00	0.02
197	600547	山东黄金	19,300	358,208.00	0.02
198	688200	华峰测控	1,000	356,400.00	0.02
199	603986	兆易创新	2,500	355,525.00	0.02
200	300068	南都电源	23,100	354,354.00	0.02
201	300268	佳沃食品	11,600	345,100.00	0.01
202	600048	保利发展	19,700	343,962.00	0.01
203	002332	仙琚制药	34,700	340,754.00	0.01
204	601666	平煤股份	24,900	338,391.00	0.01
205	600546	山煤国际	16,900	328,874.00	0.01
206	000063	中兴通讯	12,800	326,784.00	0.01
207	600900	长江电力	14,100	325,992.00	0.01
208	601857	中国石油	59,500	315,350.00	0.01
209	002240	盛新锂能	5,200	313,872.00	0.01
210	600737	中粮糖业	39,300	295,536.00	0.01
211	600584	长电科技	10,700	288,900.00	0.01
212	603619	中曼石油	13,700	281,809.00	0.01
213	603882	金域医学	3,400	280,670.00	0.01
214	603198	迎驾贡酒	4,300	280,102.00	0.01
215	600057	厦门象屿	31,700	278,643.00	0.01
216	002415	海康威视	7,300	264,260.00	0.01
217	600163	中闽能源	31,100	262,795.00	0.01
218	603277	银都股份	12,400	261,764.00	0.01
219	603260	合盛硅业	2,200	259,512.00	0.01
220	000933	神火股份	19,700	257,676.00	0.01
221	300652	雷迪克	10,300	252,041.00	0.01
222	600028	中国石化	61,000	248,880.00	0.01
223	002142	宁波银行	6,900	247,089.00	0.01
224	688045	必易微	3,939	244,139.22	0.01
225	300741	华宝股份	8,700	242,034.00	0.01
226	601001	晋控煤业	13,500	239,625.00	0.01
227	601636	旗滨集团	18,500	235,875.00	0.01
228	600195	中牧股份	19,100	234,166.00	0.01
229	002043	兔宝宝	20,100	233,160.00	0.01

230	600309	万华化学	2,400	232,776.00	0.01
231	002759	天际股份	8,500	231,030.00	0.01
232	601231	环旭电子	16,000	229,760.00	0.01
233	600596	新安股份	10,600	229,490.00	0.01
234	300360	炬华科技	17,200	229,448.00	0.01
235	600173	卧龙地产	39,500	229,100.00	0.01
236	300801	泰和科技	8,800	228,976.00	0.01
237	601216	君正集团	46,900	228,872.00	0.01
238	300818	耐普矿机	5,600	227,136.00	0.01
239	300677	英科医疗	8,880	225,196.80	0.01
240	603359	东珠生态	18,600	224,688.00	0.01
241	601601	中国太保	9,500	223,535.00	0.01
242	002768	国恩股份	8,700	223,416.00	0.01
243	000568	泸州老窖	900	221,886.00	0.01
244	600668	尖峰集团	15,000	221,700.00	0.01
245	603165	荣晟环保	15,100	220,460.00	0.01
246	603368	柳药集团	12,800	220,416.00	0.01
247	002788	鹭燕医药	25,600	219,904.00	0.01
248	002833	弘亚数控	13,160	219,508.80	0.01
249	000650	仁和药业	34,100	217,558.00	0.01
250	301139	元道通信	5,651	217,337.46	0.01
251	300787	海能实业	7,500	217,050.00	0.01
252	001965	招商公路	28,400	216,692.00	0.01
253	600176	中国巨石	12,400	215,884.00	0.01
254	601838	成都银行	13,000	215,540.00	0.01
255	002913	奥士康	6,800	215,220.00	0.01
256	002061	浙江交科	30,900	215,064.00	0.01
257	000848	承德露露	22,200	214,896.00	0.01
258	603018	华设集团	22,500	214,875.00	0.01
259	300571	平治信息	5,200	214,760.00	0.01
260	002932	明德生物	3,129	214,524.24	0.01
261	300418	昆仑万维	13,400	214,400.00	0.01
262	603387	基蛋生物	14,980	213,614.80	0.01
263	002727	一心堂	9,300	213,249.00	0.01
264	002867	周大生	13,700	212,761.00	0.01
265	002601	龙佰集团	10,600	212,530.00	0.01
266	603968	醋化股份	10,300	212,180.00	0.01
267	002818	富森美	16,800	211,512.00	0.01
268	601128	常熟银行	27,600	210,864.00	0.01
269	000062	深圳华强	16,600	210,820.00	0.01
270	002126	银轮股份	18,400	210,680.00	0.01
271	002947	恒铭达	11,400	209,760.00	0.01
272	002860	星帅尔	14,140	209,413.40	0.01

273	000401	冀东水泥	19,900	209,348.00	0.01
274	300371	汇中股份	17,200	208,808.00	0.01
275	002064	华峰化学	24,600	207,624.00	0.01
276	600802	福建水泥	31,400	207,554.00	0.01
277	600073	上海梅林	26,000	207,220.00	0.01
278	000680	山推股份	39,800	206,960.00	0.01
279	002884	凌霄泵业	10,100	206,949.00	0.01
280	002078	太阳纸业	16,800	206,808.00	0.01
281	601229	上海银行	31,497	206,305.35	0.01
282	300620	光库科技	6,200	205,778.00	0.01
283	002911	佛燃能源	22,600	205,208.00	0.01
284	601939	建设银行	33,800	204,828.00	0.01
285	301069	凯盛新材	4,439	204,682.29	0.01
286	600426	华鲁恒升	7,000	204,400.00	0.01
287	000011	深物业 A	15,100	204,001.00	0.01
288	603556	海兴电力	13,400	203,948.00	0.01
289	300732	设研院	18,480	203,834.40	0.01
290	601577	长沙银行	25,700	203,801.00	0.01
291	002133	广宇集团	56,100	203,643.00	0.01
292	603699	纽威股份	24,200	203,522.00	0.01
293	603889	新澳股份	32,200	203,504.00	0.01
294	002034	旺能环境	9,900	203,247.00	0.01
295	603357	设计总院	17,700	203,196.00	0.01
296	603393	新天然气	9,500	202,920.00	0.01
297	600908	无锡银行	36,000	202,680.00	0.01
298	002233	塔牌集团	22,800	201,780.00	0.01
299	002658	雪迪龙	28,600	201,058.00	0.01
300	603599	广信股份	7,140	200,991.00	0.01
301	002472	双环传动	6,300	200,592.00	0.01
302	002979	雷赛智能	9,800	200,116.00	0.01
303	300170	汉得信息	22,200	200,022.00	0.01
304	300533	冰川网络	7,600	199,880.00	0.01
305	600461	洪城环境	24,700	199,823.00	0.01
306	600479	千金药业	20,700	199,548.00	0.01
307	002655	共达电声	13,500	199,530.00	0.01
308	600007	中国国贸	13,500	199,125.00	0.01
309	600282	南钢股份	63,200	199,080.00	0.01
310	603706	东方环宇	12,700	198,628.00	0.01
311	600727	鲁北化工	24,400	198,128.00	0.01
312	600559	老白干酒	6,900	197,961.00	0.01
313	000960	锡业股份	11,800	197,886.00	0.01
314	300532	今天国际	15,400	197,736.00	0.01
315	600585	海螺水泥	5,600	197,568.00	0.01

316	600618	氯碱化工	15,800	197,500.00	0.01
317	300618	寒锐钴业	3,400	196,928.00	0.01
318	600681	百川能源	44,400	196,692.00	0.01
319	600648	外高桥	14,400	195,840.00	0.01
320	600425	青松建化	48,100	195,767.00	0.01
321	002989	中天精装	13,560	195,535.20	0.01
322	002687	乔治白	43,645	195,093.15	0.01
323	002091	江苏国泰	18,100	194,575.00	0.01
324	002869	金溢科技	12,900	194,532.00	0.01
325	603399	吉翔股份	7,800	194,298.00	0.01
326	688399	硕世生物	1,700	193,834.00	0.01
327	000731	四川美丰	21,300	193,830.00	0.01
328	002315	焦点科技	13,800	193,476.00	0.01
329	002128	电投能源	13,500	193,320.00	0.01
330	002757	南兴股份	16,600	193,058.00	0.01
331	600649	城投控股	44,900	192,172.00	0.01
332	000717	韶钢松山	54,900	192,150.00	0.01
333	601298	青岛港	35,100	191,997.00	0.01
334	603180	金牌厨柜	6,200	191,952.00	0.01
335	601009	南京银行	18,400	191,728.00	0.01
336	000932	华菱钢铁	37,600	191,384.00	0.01
337	601997	贵阳银行	32,900	191,149.00	0.01
338	600985	淮北矿业	13,100	190,736.00	0.01
339	601233	桐昆股份	12,000	190,560.00	0.01
340	600511	国药股份	7,100	190,138.00	0.01
341	300828	锐新科技	11,300	189,840.00	0.01
342	002145	中核钛白	26,400	188,232.00	0.01
343	002170	芭田股份	29,200	187,172.00	0.01
344	300499	高澜股份	15,500	187,085.00	0.01
345	603585	苏利股份	9,600	186,528.00	0.01
346	002312	川发龙蟒	10,800	186,408.00	0.01
347	600449	宁夏建材	15,300	186,201.00	0.01
348	000937	冀中能源	24,900	185,754.00	0.01
349	600787	中储股份	32,600	185,494.00	0.01
350	600557	康缘药业	12,600	185,094.00	0.01
351	600295	鄂尔多斯	10,240	184,832.00	0.01
352	002567	唐人神	21,700	184,667.00	0.01
353	603085	天成自控	21,800	183,992.00	0.01
354	002267	陕天然气	26,300	183,837.00	0.01
355	605366	宏柏新材	6,100	181,719.00	0.01
356	300167	迪威迅	34,800	181,656.00	0.01
357	600499	科达制造	8,800	181,632.00	0.01
358	600398	海澜之家	38,200	181,450.00	0.01

359	002420	毅昌科技	24,700	180,310.00	0.01
360	301057	汇隆新材	7,400	180,190.00	0.01
361	603773	沃格光电	11,240	179,840.00	0.01
362	300739	明阳电路	11,200	179,424.00	0.01
363	300824	北鼎股份	15,100	179,086.00	0.01
364	600177	雅戈尔	27,000	179,010.00	0.01
365	002809	红墙股份	17,800	178,000.00	0.01
366	300634	彩讯股份	14,000	177,800.00	0.01
367	603583	捷昌驱动	5,300	176,967.00	0.01
368	300119	瑞普生物	10,100	176,649.00	0.01
369	002955	鸿合科技	8,100	176,337.00	0.01
370	600429	三元股份	33,600	176,064.00	0.01
371	002968	新大正	7,100	175,086.00	0.01
372	002110	三钢闽光	28,700	174,783.00	0.01
373	601956	东贝集团	27,200	173,808.00	0.01
374	603236	移远通信	1,300	173,758.00	0.01
375	300214	日科化学	22,300	172,602.00	0.01
376	601615	明阳智能	5,100	172,380.00	0.01
377	600507	方大特钢	24,600	171,954.00	0.01
378	002261	拓维信息	26,800	171,788.00	0.01
379	002724	海洋王	13,800	171,534.00	0.01
380	002984	森麒麟	5,500	171,105.00	0.01
381	600713	南京医药	35,100	170,937.00	0.01
382	600337	美克家居	55,800	170,748.00	0.01
383	300491	通合科技	11,600	170,172.00	0.01
384	603279	景津装备	5,460	169,314.60	0.01
385	300275	梅安森	12,700	168,529.00	0.01
386	600326	西藏天路	28,800	168,480.00	0.01
387	003003	天元股份	18,400	168,360.00	0.01
388	300909	汇创达	6,537	168,066.27	0.01
389	000918	嘉凯城	72,900	167,670.00	0.01
390	603818	曲美家居	17,600	167,200.00	0.01
391	300662	科锐国际	3,200	166,048.00	0.01
392	600250	南纺股份	30,100	165,851.00	0.01
393	002795	永和智控	20,100	165,222.00	0.01
394	002029	七匹狼	30,700	165,166.00	0.01
395	002734	利民股份	16,400	164,984.00	0.01
396	000617	中油资本	34,300	164,983.00	0.01
397	301077	星华反光	6,900	164,979.00	0.01
398	300797	钢研纳克	12,100	164,802.00	0.01
399	605228	神通科技	21,300	164,649.00	0.01
400	300450	先导智能	2,600	164,268.00	0.01
401	002573	清新环境	28,100	163,261.00	0.01

402	002229	鸿博股份	24,500	163,170.00	0.01
403	002930	宏川智慧	8,200	162,114.00	0.01
404	003010	若羽臣	9,900	160,875.00	0.01
405	300425	中建环能	33,600	160,608.00	0.01
406	300813	泰林生物	3,940	160,318.60	0.01
407	601208	东材科技	12,400	160,208.00	0.01
408	300654	世纪天鸿	19,400	158,886.00	0.01
409	605151	西上海	8,600	152,736.00	0.01
410	603078	江化微	5,100	145,707.00	0.01
411	300568	星源材质	5,000	145,200.00	0.01
412	300346	南大光电	4,000	143,920.00	0.01
413	002624	完美世界	10,000	143,700.00	0.01
414	603656	泰禾智能	9,700	143,366.00	0.01
415	300836	佰奥智能	5,780	141,032.00	0.01
416	002539	云图控股	8,800	140,712.00	0.01
417	300573	兴齐眼药	900	137,988.00	0.01
418	600929	雪天盐业	14,800	137,344.00	0.01
419	600380	健康元	11,100	137,085.00	0.01
420	300354	东华测试	4,200	135,030.00	0.01
421	000778	新兴铸管	27,300	131,586.00	0.01
422	300182	捷成股份	23,900	131,450.00	0.01
423	603379	三美股份	5,900	131,275.00	0.01
424	688037	芯源微	900	130,473.00	0.01
425	300398	飞凯材料	5,700	130,302.00	0.01
426	300481	濮阳惠成	5,500	129,250.00	0.01
427	688550	瑞联新材	1,880	128,949.20	0.01
428	688019	安集科技	600	127,752.00	0.01
429	601598	中国外运	32,500	126,100.00	0.01
430	000567	海德股份	8,500	125,800.00	0.01
431	601995	中金公司	2,800	124,572.00	0.01
432	000630	铜陵有色	38,000	123,880.00	0.01
433	002948	青岛银行	34,200	123,804.00	0.01
434	603790	雅运股份	11,500	122,245.00	0.01
435	002517	恺英网络	21,700	121,086.00	0.01
436	002545	东方铁塔	10,600	120,628.00	0.01
437	300888	稳健医疗	1,800	119,700.00	0.01
438	601933	永辉超市	27,900	119,412.00	0.01
439	300606	金太阳	9,800	119,070.00	0.01
440	000598	兴蓉环境	23,300	119,063.00	0.01
441	002331	皖通科技	16,300	118,501.00	0.01
442	002832	比音勒芬	4,700	118,440.00	0.01
443	002574	明牌珠宝	24,200	117,854.00	0.01
444	688090	瑞松科技	3,800	117,534.00	0.01

445	600302	标准股份	23,500	117,500.00	0.01
446	002193	如意集团	19,700	117,215.00	0.01
447	003004	声迅股份	5,600	116,816.00	0.01
448	601888	中国中免	500	116,465.00	0.01
449	300689	澄天伟业	6,700	115,977.00	0.00
450	000915	华特达因	2,800	115,780.00	0.00
451	300615	欣天科技	10,500	115,710.00	0.00
452	300555	路通视信	15,000	115,500.00	0.00
453	300899	上海凯鑫	5,200	115,440.00	0.00
454	002787	华源控股	19,800	115,434.00	0.00
455	300625	三雄极光	9,600	115,392.00	0.00
456	300583	赛托生物	5,100	115,260.00	0.00
457	002899	英派斯	9,400	115,244.00	0.00
458	003033	征和工业	4,300	115,240.00	0.00
459	603321	梅轮电梯	17,700	115,227.00	0.00
460	605298	必得科技	8,450	114,920.00	0.00
461	603615	茶花股份	15,000	114,900.00	0.00
462	002494	华斯股份	27,200	114,784.00	0.00
463	688466	金科环境	7,300	114,610.00	0.00
464	003036	泰坦股份	10,700	114,597.00	0.00
465	300963	中洲特材	5,900	114,342.00	0.00
466	002241	歌尔股份	3,400	114,240.00	0.00
467	688679	通源环境	10,500	114,030.00	0.00
468	688178	万德斯	6,200	113,956.00	0.00
469	002295	精艺股份	17,100	113,715.00	0.00
470	603499	翔港科技	14,500	113,680.00	0.00
470	000593	德龙汇能	20,300	113,680.00	0.00
472	605001	威奥股份	17,700	113,634.00	0.00
473	688571	杭华股份	15,600	113,568.00	0.00
474	300321	同大股份	7,000	113,540.00	0.00
475	688350	富淼科技	6,300	113,337.00	0.00
476	300839	博汇股份	8,400	113,316.00	0.00
477	603709	中源家居	7,100	113,174.00	0.00
478	603139	康惠制药	5,600	113,120.00	0.00
479	605081	太和水	6,600	112,992.00	0.00
480	300462	华铭智能	11,700	112,671.00	0.00
481	688215	瑞晟智能	3,700	112,591.00	0.00
482	300195	长荣股份	20,000	112,200.00	0.00
483	300087	荃银高科	6,800	111,928.00	0.00
484	688379	华光新材	6,900	111,849.00	0.00
485	300445	康斯特	9,700	111,162.00	0.00
486	300594	朗进科技	6,500	110,500.00	0.00
487	603586	金麒麟	8,500	109,820.00	0.00

488	605088	冠盛股份	8,000	107,840.00	0.00
489	603878	武进不锈	16,700	106,546.00	0.00
490	603177	德创环保	6,200	93,930.00	0.00
491	002475	立讯精密	2,700	91,233.00	0.00
492	600269	赣粤高速	26,000	90,220.00	0.00
493	001289	龙源电力	4,100	89,216.00	0.00
494	300070	碧水源	16,600	86,486.00	0.00
495	002030	达安基因	4,900	84,231.00	0.00
496	601077	渝农商行	22,100	81,770.00	0.00
497	002088	鲁阳节能	3,765	79,253.25	0.00
498	603369	今世缘	1,300	66,300.00	0.00
499	301061	匠心家居	1,920	65,088.00	0.00
500	300773	拉卡拉	3,400	64,804.00	0.00
501	600328	中盐化工	2,500	58,875.00	0.00
502	601288	农业银行	17,300	52,246.00	0.00
503	003816	中国广核	18,000	50,400.00	0.00
504	301236	软通动力	1,578	49,517.64	0.00
505	600690	海尔智家	1,600	43,936.00	0.00
506	600673	东阳光	4,500	40,455.00	0.00
507	301200	大族数控	754	39,147.68	0.00
508	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.00
509	301219	腾远钴业	382	33,547.24	0.00
510	301150	中一科技	404	33,435.04	0.00
511	300760	迈瑞医疗	100	31,320.00	0.00
512	301206	三元生物	683	31,206.27	0.00
513	600383	金地集团	2,300	30,912.00	0.00
514	301109	军信股份	1,838	29,665.32	0.00
515	300979	华利集团	400	29,232.00	0.00
516	301302	华如科技	466	26,291.72	0.00
517	301099	雅创电子	300	25,044.00	0.00
518	301268	铭利达	641	22,351.67	0.00
519	301096	百诚医药	272	21,488.00	0.00
520	301122	采纳股份	301	21,181.37	0.00
521	300474	景嘉微	300	20,517.00	0.00
522	301102	兆讯传媒	642	19,959.78	0.00
523	301127	天源环保	1,685	18,754.05	0.00
524	301162	国能日新	334	18,072.74	0.00
525	300679	电连技术	400	17,676.00	0.00
526	002318	久立特材	1,100	17,589.00	0.00
527	301123	奕东电子	656	16,655.84	0.00
528	301103	何氏眼科	507	16,234.14	0.00
529	002153	石基信息	980	15,552.60	0.00
530	301286	侨源股份	784	15,515.36	0.00

531	301168	通灵股份	329	14,831.32	0.00
532	301248	杰创智能	472	14,098.64	0.00
533	688508	芯朋微	187	13,931.50	0.00
534	301212	联盛化学	416	13,844.48	0.00
535	301298	东利机械	634	13,206.22	0.00
536	301148	嘉戎技术	516	12,332.40	0.00
537	301259	艾布鲁	483	12,046.02	0.00
538	301097	天益医疗	249	11,909.67	0.00
539	001268	联合精密	409	11,337.48	0.00
540	000909	数源科技	1,200	11,184.00	0.00
541	301220	亚香股份	285	11,157.75	0.00
542	301108	洁雅股份	280	11,079.60	0.00
543	301237	和顺科技	261	10,925.46	0.00
544	688029	南微医学	120	10,464.00	0.00
545	301111	粤万年青	379	10,392.18	0.00
546	300776	帝尔激光	60	10,368.00	0.00
547	301196	唯科科技	271	10,167.92	0.00
548	002568	百润股份	320	9,612.80	0.00
549	301047	义翘神州	70	9,081.10	0.00
550	301125	腾亚精工	327	8,966.34	0.00
551	301163	宏德股份	277	8,955.41	0.00
552	301130	西点药业	237	8,934.90	0.00
553	301135	瑞德智能	338	8,875.88	0.00
554	603060	国检集团	700	8,435.00	0.00
555	603233	大参林	260	8,138.00	0.00
556	301181	标榜股份	257	7,861.63	0.00
557	301198	喜悦智行	341	7,689.55	0.00
558	301228	实朴检测	373	7,586.82	0.00
559	301279	金道科技	296	6,751.76	0.00
560	688308	欧科亿	100	6,656.00	0.00
561	301073	君亭酒店	66	4,576.44	0.00
562	601985	中国核电	600	4,116.00	0.00
563	002433	太安堂	500	2,325.00	0.00
564	301008	宏昌科技	40	1,081.20	0.00
565	002807	江阴银行	100	453.00	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	600519	贵州茅台	12,129,394.00	1.24
2	300124	汇川技术	10,711,750.44	1.09

3	300750	宁德时代	10,229,440.90	1.04
4	300390	天华超净	8,076,762.32	0.82
5	000858	五粮液	6,323,715.00	0.64
6	300347	泰格医药	5,913,189.91	0.60
7	601166	兴业银行	5,590,280.00	0.57
8	000333	美的集团	5,462,341.00	0.56
9	601318	中国平安	4,973,089.00	0.51
10	002709	天赐材料	4,403,884.00	0.45
11	300661	圣邦股份	4,395,521.00	0.45
12	000651	格力电器	4,339,842.44	0.44
13	000552	靖远煤电	4,278,076.00	0.44
14	600036	招商银行	4,125,359.00	0.42
15	300316	晶盛机电	3,958,159.00	0.40
16	603259	药明康德	3,916,859.00	0.40
17	300122	智飞生物	3,805,298.00	0.39
18	002049	紫光国微	3,803,543.00	0.39
19	000625	长安汽车	3,772,346.00	0.38
20	002129	TCL 中环	3,759,684.00	0.38

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	13,387,813.00	1.37
2	300750	宁德时代	8,993,165.00	0.92
3	300124	汇川技术	8,362,115.00	0.85
4	601318	中国平安	7,007,295.00	0.71
5	601166	兴业银行	6,741,858.00	0.69
6	600036	招商银行	4,987,646.44	0.51
7	300347	泰格医药	4,970,746.00	0.51
8	600887	伊利股份	4,555,790.28	0.46
9	002539	云图控股	4,352,211.00	0.44
10	000858	五粮液	4,026,853.00	0.41
11	002129	TCL 中环	3,914,508.00	0.40
12	300760	迈瑞医疗	3,865,053.30	0.39
13	300661	圣邦股份	3,807,524.00	0.39
14	600438	通威股份	3,660,641.00	0.37
15	000333	美的集团	3,557,453.39	0.36
16	601615	明阳智能	3,423,408.91	0.35
17	002460	赣锋锂业	3,371,980.59	0.34
18	300122	智飞生物	3,237,865.70	0.33
19	002709	天赐材料	3,235,398.00	0.33

20	603392	万泰生物	3,143,599.00	0.32
----	--------	------	--------------	------

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	774,393,044.30
卖出股票收入（成交）总额	633,853,217.64

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	120,371,042.69	5.17
2	央行票据	-	-
3	金融债券	894,293,611.77	38.43
	其中：政策性金融债	6,362,510.14	0.27
4	企业债券	363,047,351.33	15.60
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	345,241,810.29	14.83
7	可转债（可交换债）	147,584.20	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,723,101,400.28	74.04

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	2228037	22 交通银行小微债 01	800,000	79,955,506.85	3.44
2	2028038	20 中国银行二级 01	600,000	63,933,090.41	2.75
3	101900298	19 金隅 MTN001	600,000	62,350,701.37	2.68
4	2020002	20 杭州银行永续债	500,000	52,106,369.86	2.24
5	2080351	20 沪国盛债 02	500,000	51,885,013.70	2.23

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

本基金本报告期末无国债期货投资。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货投资。

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,广发银行股份有限公司、华夏银行股份有限公司、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	115,784.75
2	应收清算款	261,466,042.01
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	25,319,133.72
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	286,900,960.48

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

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	0.23	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
华夏睿磐泰利混合 A	16,250	82,205.46	1,228,130,956.25	91.94%	107,707,828.34	8.06%
华夏睿磐泰利混合 C	51,170	8,318.24	247,320,447.16	58.10%	178,323,815.09	41.90%
合计	67,420	26,127.01	1,475,451,403.41	83.76%	286,031,643.43	16.24%

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	华夏睿磐泰利混合 A	149,848.49	0.01%
	华夏睿磐泰利混合 C	874.14	0.00%
	合计	150,722.63	0.01%

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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	华夏睿磐泰利混合 A	0
	华夏睿磐泰利混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	华夏睿磐泰利混合 A	0
	华夏睿磐泰利混合 C	0

	合计	0
--	----	---

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华夏睿磐泰利混合 A	华夏睿磐泰利混合 C
基金合同生效日（2017 年 12 月 27 日）基金份额总额	29,272,313.05	19,062,398.32
本报告期期初基金份额总额	572,221,970.00	167,795,516.69
本报告期基金总申购份额	975,718,855.90	411,739,410.02
减：本报告期基金总赎回份额	212,102,041.31	153,890,664.46
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,335,838,784.59	425,644,262.25

§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。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

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

本基金管理人及其高级管理人员在本报告期内无受稽查或处罚等情况。

本报告期内，本基金托管人及其高级管理人员在开展基金托管业务过程中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	
东方财富证券	1	388,669,759.86	27.99%	284,224.61	28.00%	-
华林证券	1	259,746,003.20	18.71%	189,952.61	18.71%	-
华宝证券	1	230,370,411.17	16.59%	168,470.16	16.59%	-
开源证券	2	229,185,188.00	16.51%	167,605.20	16.51%	-
华金证券	1	143,401,356.70	10.33%	104,869.73	10.33%	-
申万宏源证券	1	105,496,415.64	7.60%	77,149.60	7.60%	-
中国银河证券	1	31,399,830.23	2.26%	22,962.65	2.26%	-
中金公司	1	137,659.55	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，本基金还选择了华创证券、世纪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	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	成交金额	占当期	成交金	占当期	成交金	占当

名称		债券成交总额的比例		债券回购成交总额的比例	额	权证成交总额的比例	额	期基金成交总额的比例
东方财富证券	34,244,840.00	6.65%	8,960,000,000.00	89.20%	-	-	-	-
华林证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-	-	-
开源证券	10,016,000.00	1.95%	400,000,000.00	3.98%	-	-	-	-
华金证券	17,082,724.78	3.32%	90,000,000.00	0.90%	-	-	-	-
申万宏源证券	35,824,945.60	6.96%	330,000,000.00	3.29%	-	-	-	-
中国银河证券	387,557,122.30	75.28%	265,000,000.00	2.64%	-	-	-	-
中金公司	30,081,800.00	5.84%	-	-	-	-	-	-

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利混合型证券投资基金取消申购、定期定额申购及转换转入业务上限的公告	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联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-02-12
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
15	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	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、《华夏睿磐泰利混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《华夏睿磐泰利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