
华夏睿磐泰茂混合型证券投资基金

2022 年年度报告

2022 年 12 月 31 日

基金管理人：华夏基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：二〇二三年三月三十日

§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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 3 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中的财务资料经审计，安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2022 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	1
§2 基金简介.....	3
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况.....	4
3.1 主要会计数据和财务指标.....	4
3.2 基金净值表现.....	5
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	7
§4 管理人报告.....	8
§5 托管人报告.....	15
§6 审计报告.....	15
§7 年度财务报表.....	17
7.1 资产负债表.....	17
7.2 利润表.....	19
7.3 净资产（基金净值）变动表.....	20
7.4 报表附注.....	21
§8 投资组合报告.....	52
8.1 期末基金资产组合情况.....	53
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	53
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	68
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	69
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	69
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	70
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	70
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	70
8.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	70
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	70
8.12 投资组合报告附注.....	70
§9 基金份额持有人信息.....	71
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	71
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	71
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	71
§10 开放式基金份额变动.....	71
§11 重大事件揭示.....	72
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	76
§13 备查文件目录.....	76

§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	1,386,258,624.78 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	1,022,339,071.11 份	363,919,553.67 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》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.ChinaAMC.com
基金年度报告备置地点	基金管理人和/或基金托管人的住所/办公地址

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层
注册登记机构	华夏基金管理有限公司	北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 8 层

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2022 年		2021 年		2020 年	
	华夏睿磐泰茂混合 A	华夏睿磐泰茂混合 C	华夏睿磐泰茂混合 A	华夏睿磐泰茂混合 C	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	-24,725,158.60	-14,984,203.96	64,927,383.04	27,938,705.36	38,447,186.10	17,467,233.49
本期利润	-50,127,410.41	-24,830,072.43	61,786,557.81	27,541,423.26	49,133,121.50	23,243,070.08
加权平均基金份额本期利润	-0.0382	-0.0366	0.1220	0.1026	0.1440	0.1542
本期加权平均净值利润率	-2.98%	-2.89%	9.79%	8.23%	12.97%	14.00%
本期基金份额净值增长率	-3.04%	-3.33%	10.67%	10.34%	12.40%	12.06%
3.1.2 期末数据和指标	2022 年末		2021 年末		2020 年末	
	华夏睿磐泰茂混合 A	华夏睿磐泰茂混合 C	华夏睿磐泰茂混合 A	华夏睿磐泰茂混合 C	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	243,884,826.97	80,290,236.18	232,883,708.28	169,149,600.55	57,833,627.23	18,944,366.28
期末可供分配基金份额利润	0.2386	0.2206	0.2582	0.2438	0.1239	0.1145

期末基金资产净值	1,287,766,964.93	451,864,117.11	1,171,796,462.73	891,085,001.58	548,025,045.21	192,654,550.03
期末基金份额净值	1.2596	1.2417	1.2991	1.2845	1.1739	1.1641
3.1.3 累计期末指标	2022 年末		2021 年末		2020 年末	
	华夏睿磐泰茂混合 A	华夏睿磐泰茂混合 C	华夏睿磐泰茂混合 A	华夏睿磐泰茂混合 C	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	28.66%	26.72%	32.69%	31.09%	19.91%	18.80%

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
过去三个月	-1.92%	0.17%	0.63%	0.17%	-2.55%	0.00%
过去六个月	-2.33%	0.17%	-0.62%	0.16%	-1.71%	0.01%
过去一年	-3.04%	0.19%	-0.32%	0.19%	-2.72%	0.00%
过去三年	20.61%	0.23%	10.64%	0.19%	9.97%	0.04%
过去五年	28.34%	0.26%	20.29%	0.19%	8.05%	0.07%
自基金合同生效起至今	28.66%	0.26%	20.35%	0.19%	8.31%	0.07%

华夏睿磐泰茂混合 C：

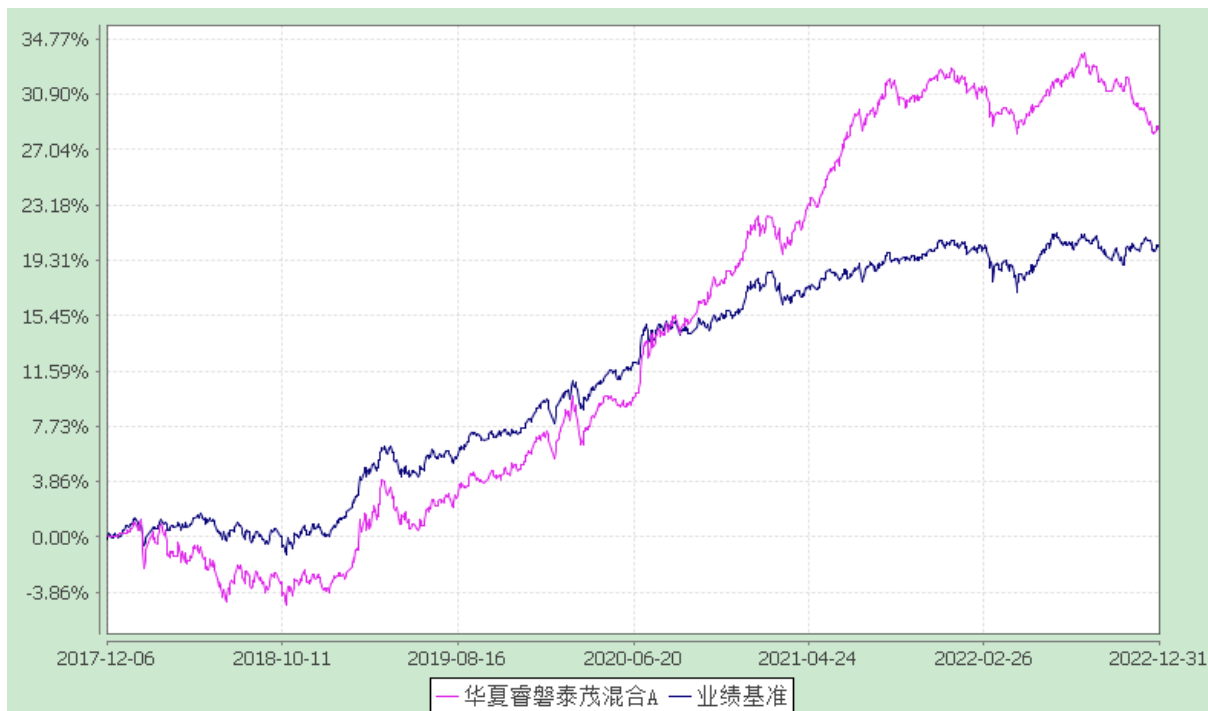
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-1.99%	0.17%	0.63%	0.17%	-2.62%	0.00%
过去六个月	-2.47%	0.17%	-0.62%	0.16%	-1.85%	0.01%
过去一年	-3.33%	0.19%	-0.32%	0.19%	-3.01%	0.00%
过去三年	19.53%	0.23%	10.64%	0.19%	8.89%	0.04%
过去五年	26.45%	0.26%	20.29%	0.19%	6.16%	0.07%
自基金合同生效起至今	26.72%	0.26%	20.35%	0.19%	6.37%	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

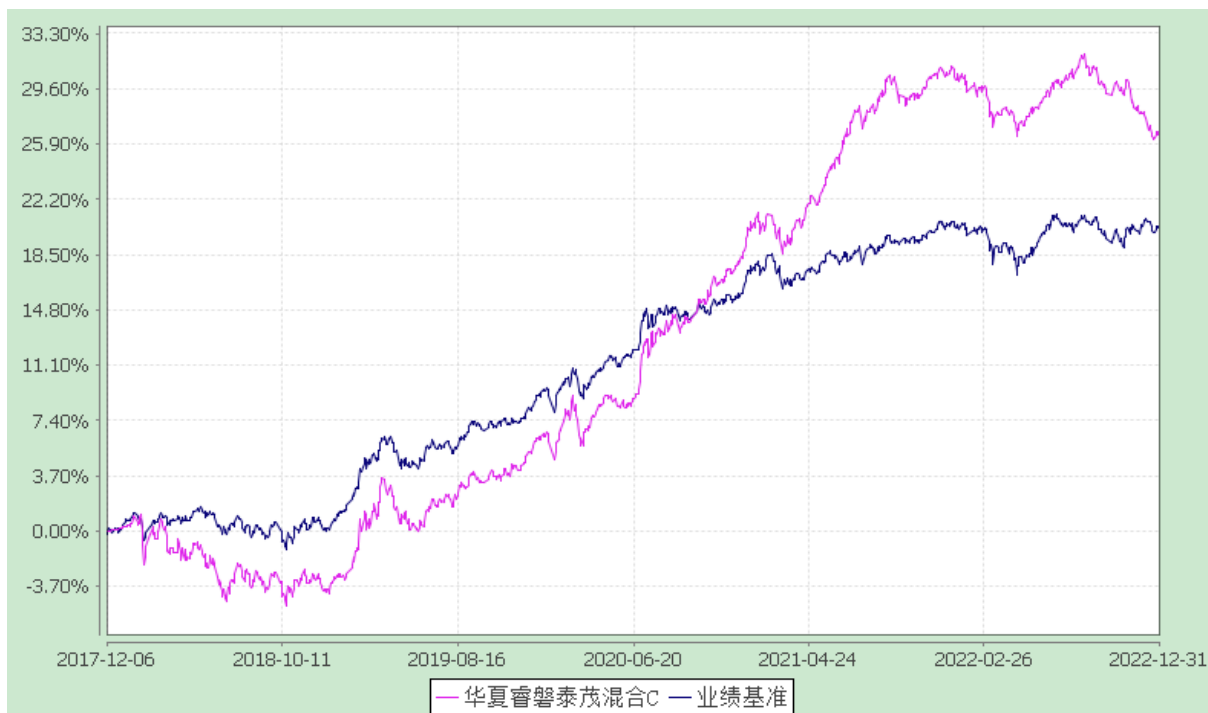
较

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 12 月 31 日)

华夏睿磐泰茂混合 A



华夏睿磐泰茂混合 C

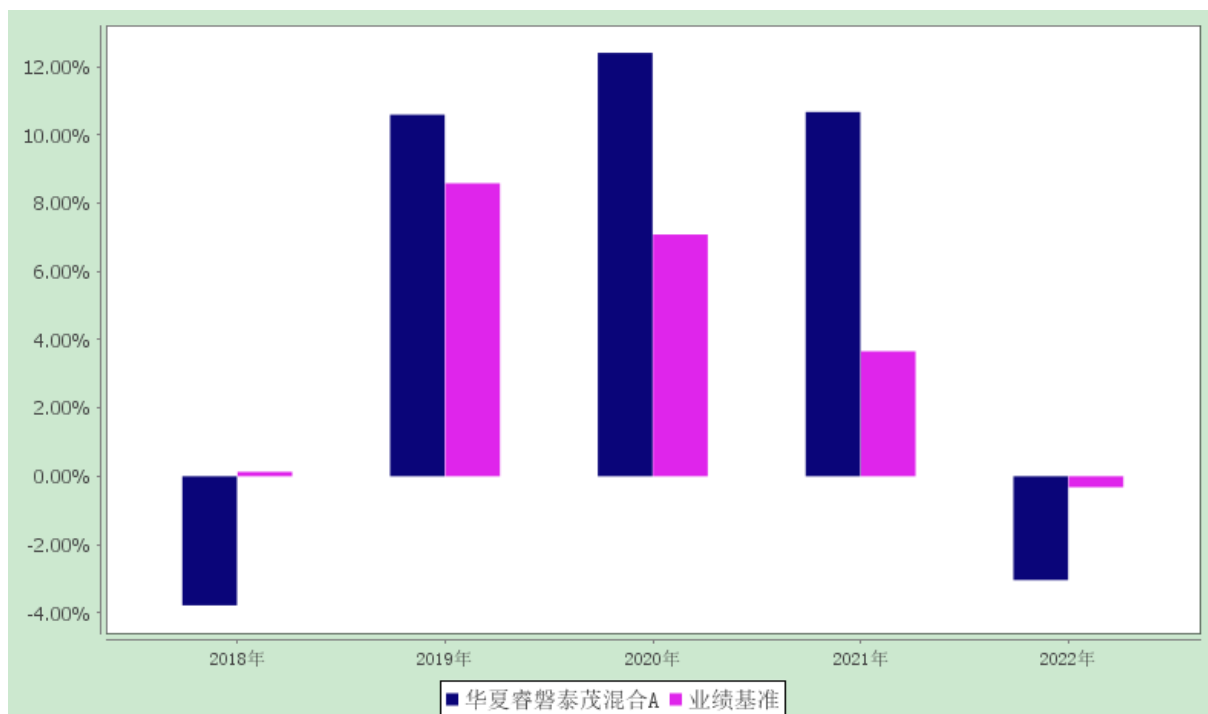


3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

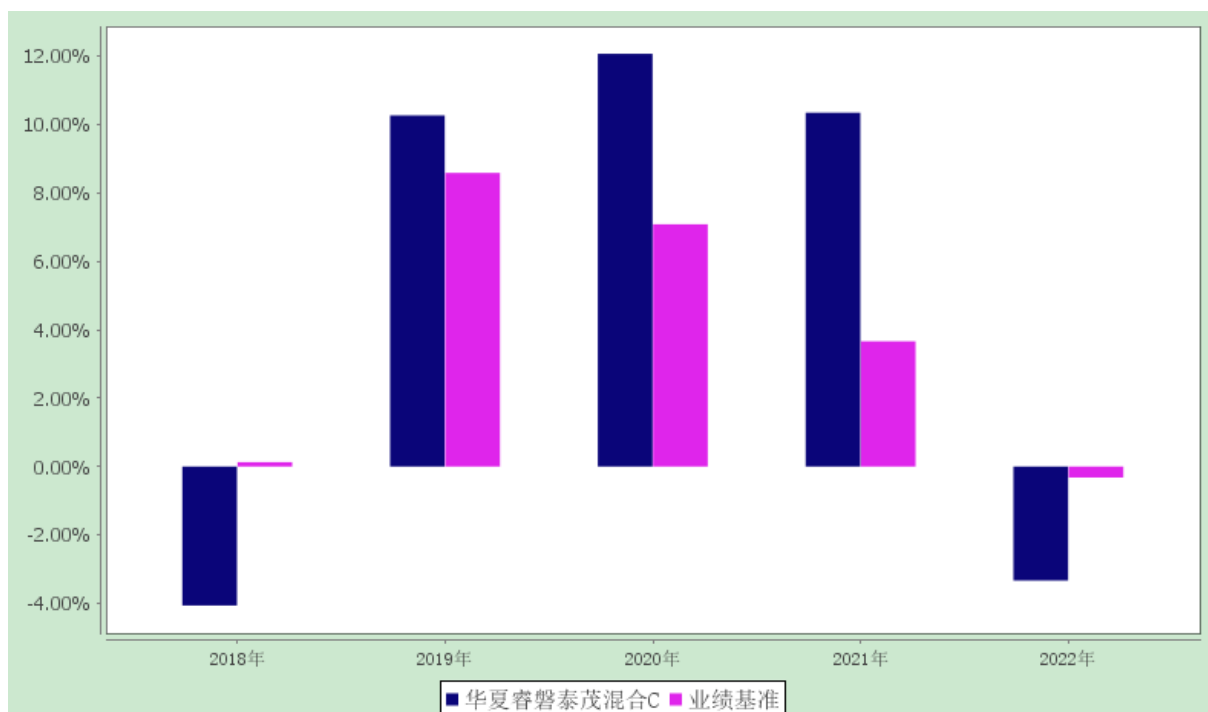
华夏睿磐泰茂混合型证券投资基金

过去五年基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图

华夏睿磐泰茂混合 A



华夏睿磐泰茂混合 C



3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年无利润分配事项。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

华夏基金管理有限公司成立于 1998 年 4 月 9 日，是经中国证监会批准成立的首批全国性基金管理公司之一。公司总部设在北京，在北京、上海、深圳、成都、南京、杭州、广州和青岛设有分公司，在香港、深圳、上海设有子公司。公司是首批全国社保基金管理人、首批企业年金基金管理人、境内首批 QDII 基金管理人、境内首只 ETF 基金管理人、境内首只沪港通 ETF 基金管理人、首批内地与香港基金互认基金管理人、首批基本养老保险基金投资管理人资格、首家加入联合国责任投资原则组织的公募基金公司、首批公募 FOF 基金管理人、首批公募养老目标基金管理人、首批个人养老金基金管理人、境内首批中日互通 ETF 基金管理人、首批商品期货 ETF 基金管理人、首批公募 MOM 基金管理人、首批纳入互联互通 ETF 基金管理人、首批北交所主题基金管理人以及特定客户资产管理人、保险资金投资管理人、公募 REITs 管理人，国内首家承诺“碳中和”具体目标和路径的公募基金公司，香港子公司是首批 RQFII 基金管理人。华夏基金是业务领域最广泛的基金管理公司之一。

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 12 月 31 日，华夏基金旗下多只产品近 1 年同类排名领先（基金排名不作为产品未来表现的保证），其中：

主动权益产品：在 TMT 与信息技术行业偏股型基金(A 类)中华夏互联网龙头混合(A 类)排名第 2/22；在低碳环保行业股票型基金(A 类)中华夏节能环保股票(A 类)排名第 2/10；在 TMT 与信息技术行业股票型基金(A 类)中华夏科技成长股票排名第 4/20；在医药医疗健康行业偏股型基金(A 类)中华夏逸享健康混合(A 类)排名第 8/60、华夏乐享健康混合(A 类)排名第 17/60；在消费行业偏股型基金(A 类)中华夏网购精选混合(A 类)排名第 12/61；在标准股票型基金(A 类)中华夏智胜价值成长股票(A 类)排名第 12/307；在灵活配置型基金(基准股票比例 30%-60%)(A 类)中华夏新锦绣混合(A 类)排名第 12/451、华夏新锦升混合(A 类)排名第 18/451、华夏新趋势混合(A 类)排名第 78/451；在偏股型基金(股票上限 80%)(A 类)中华夏经典混合排名第 18/148；在偏股型基金(股票上限 95%)(A 类)中华夏新兴经济一年持有混合(A 类)排名第 17/211、华夏磐利一年定开混合(A 类)排名第 38/211、

华夏蓝筹混合(LOF)(A类)排名第 44/211、华夏磐锐一年定开混合(A类)排名第 45/211、华夏兴华混合(A类)排名第 49/211；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)排名第 28/461；在偏债型基金(A类)中华夏睿磐泰盛混合排名第 30/532、华夏磐泰混合(LOF)(A类)排名第 43/532；在偏股型基金(股票上下限 60%-95%)(A类)中华夏价值精选混合排名第 60/1177。

固收与固收+产品：在信用债指数债券型基金(A类)中华夏亚债中国指数(A类)排名第 2/14；在普通债券型基金(二级)(A类)中华夏恒融债券排名第 6/336、华夏稳健增利 4 个月债券(A类)排名第 16/336；在利率债指数债券型基金(A类)中华夏中债 1-3 年政金债指数(A类)排名第 21/107；在普通债券型基金(可投转债)(A类)中华夏鼎禄三个月定开债券(A类)排名第 33/357；在长期纯债债券型基金(A类)中华夏鼎隆债券(A类)排名第 59/1158、华夏鼎英债券(A类)排名第 60/1158。

指数与量化产品：在对冲策略绝对收益目标基金(A类)中华夏安泰对冲策略 3 个月定开混合排名第 1/23；在规模指数股票 ETF 基金中华夏沪港通恒生 ETF 排名第 1/131、华夏中证沪港深 500ETF 排名第 26/131、华夏上证 50ETF 排名第 30/131；在规模指数股票 ETF 联接基金(A类)中华夏沪港通恒生 ETF 联接(A类)排名第 1/92、华夏上证 50ETF 联接(A类)排名第 25/92；在行业指数股票 ETF 联接基金(A类)中华夏中证银行 ETF 联接(A类)排名第 2/28、华夏中证全指房地产 ETF 联接(A类)排名第 7/28；在增强规模指数股票型基金(A类)中华夏中证 500 指数增强(A类)排名第 2/123、华夏中证 500 指数智选增强(A类)排名第 4/123、华夏沪深 300 指数增强(A类)排名第 38/123；在行业指数股票 ETF 基金中华夏中证银行 ETF 排名第 6/51、华夏中证全指房地产 ETF 排名第 16/51；在主题指数股票 ETF 基金中华夏金融 ETF 发起式排名第 11/257、华夏中证浙江国资创新发展 ETF 排名第 37/257、华夏中证细分食品饮料产业主题 ETF 排名第 40/257、华夏中证央企 ETF 排名第 47/257、华夏中证细分有色金属产业主题 ETF 排名第 67/257；在主题指数股票 ETF 联接基金(A类)中华夏中证浙江国资创新发展 ETF 联接(A类)排名第 21/89、华夏中证央企 ETF 联接(A类)排名第 27/89。

在《中国证券报》第十九届中国基金业金牛奖评选中，华夏基金荣获“被动投资金牛基金公司”，成为业内连续 7 年获此殊荣的基金公司。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中，在“年度十大明星基金公司奖”评选中，华夏基金成功获奖。此外，华夏基金还获得“三年海外投资明星基金公司奖”。在《上海证券报》主办的第十九届“金基金”奖评选活动中，华夏基金将三大金基金奖项收入囊中：公司层面，华夏基金荣获“金基金 被动投资基金管理公司奖”；产品层面，华夏能源革新股票荣获“金基金 投资回报基金奖”，华夏沪深 300ETF 荣获“金基金 指数基金三年期奖”。

在客户服务方面，2022 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；养老专区升级，为个人养老金账户的开立、充值及交易提供一站式服务，提升客户整体操作感受；（3）与兰州银行、晋商银行、成都银行、九州证券、瑞银基金销售等代销机构合作，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”、“童言童语话理财”、“寻找代言人”、“成为首批 Y 星人”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。
武文琦	本基金的基金经理助理	2022-12-05	-	6 年	硕士。2016 年 7 月加入华夏基金管理有限公司。历任研究员。
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。

4.1.3 基金经理薪酬机制

本基金管理人旗下基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的，不存在基金经理薪酬激励与其在管私募资产管理计划浮动管理费或产品业绩表现挂钩的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规制定了《华夏基金管理有限公司公平交易制度》。公司通过科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时，通过监察稽核、事后分析和信息披露来保证公平交易过程和结果的监督。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《华夏基金管理有限公司公平交易制度》的规定。

4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

本基金管理人一贯严格执行公平交易原则，对兼任基金经理的交易情况进行持续监测。本年度所有相关组合的交易行为均符合法规、制度和流程要求，未发现违反公平交易原则的情况。本年度同一基金经理管理的不同组合在邻近交易日的同向和反向交易，交易时机和交易价差均可合理解释，未发现异常。

本基金管理人根据《基金经理兼任私募资产管理计划投资经理工作指引（试行）》要求，针对

同经理管理多个组合间的收益率差异进行归因分析，本年度各组合间收益率差异均属正常情况，主要原因为业绩基准不同、投资策略不同，收益率差异可以合理解释。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，本基金管理人旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 113 次，其中 110 次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，其余 3 次为投资策略需要所致，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。

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

2022 年债券市场的年内波动较大，年初的降息行情快速在 1 月走完，春节后即迎来调整，10Y 国债最高点触及 2.85%。基金在年初保持偏高久期，并在春节后逐步缩短久期控制回撤。4 月-5 月受上海、北京大范围疫情防控的影响，资金价格迅速走低，但债券收益率还没有显著下行，组合捕捉了这一机会，6 月起逐步加仓 10Y，30Y 国债迅速拉长组合久期，8 月央行超预期降息后，组合享受了较为客观的资本利得。进入 3 季度后，考虑债券收益率的绝对点位已经较低，组合有逐步减持长债缩短久期，但对防疫政策和地产政策的转向速度、转向程度预估不足，虽有减持动作，但仍未避免在 11 月-12 月的债市暴跌中出现较大回撤。同时，由于理财赎回潮的发酵，产品的主流持仓品种银行二永受伤较大，加大了回撤幅度。

权益市场今年整体呈现“W 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，权益市场呈现下行走势；二季度，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；三季度，国内疫情暴发有所反复，同时美联储持续加息引发了市场对全球经济下行的担忧，权益市场再次呈现下行走势；四季度，利好政策频出，权益市场也迎来了一波反弹行情。整体而言，今年权益市场走势一波三折，各行业表现也较为分化，以煤炭为首的周期板块表现较优，在市场整体下跌行情下仍取得正收益表现，同时去年表现不佳的消费者服务板块也有着不错的表现，前几年表现较优的军工新能源等板块今年表现相对靠后，板块层面也体现了一定程度的轮动现象。

本基金报告期内，股票端投资采取与反脆弱相结合的系统化主观投资策略作为核心策略，采取自下而上组合投资结合中观配置，自上而下的宏观框架指导的组合构建方式，在全市场范畴内寻找兼顾安全边际和景气度、具备较高投资性价比的行业和个股，同时积极使用衍生品工具管理产品的波动和回撤水平。复盘角度来看，全年维度除去四到八月的景气投资驱动主线之外，其余时间整体

市场的投资主线呈现较为频繁切换的特征。报告期内产品股票持仓的资产结构方面，全年维度以均衡配置为主，复盘角度来看持仓组合经历了“均衡偏小盘成长-均衡偏成长-均衡偏大盘价值”的应对市场变化的持仓风格调整，在产品仓位管理方面，以产品投资目标的指导下，积极应对股票市场的波动。债券端组合以稳健的票息策略为主，在年内有明确趋势性行情的条件下加仓长久期利率债增厚收益。在配置品种上做了进一步的分散，降低了二永占整体信用债持仓的比重，增配存单、政金债等高流动性品种。与此同时，严控信用风险，不做资质下沉，没有弱资质城投、煤炭钢铁的持仓，也没有地产债的持仓，确保组合底仓的安全。

报告期内产品先后经历了年初俄乌冲突及局部疫情暴发等黑天鹅事件对股票市场的冲击以及年底银行理财资金赎回对债券市场的冲击，让我们重新审慎投资框架和方法论需要进一步完善之处，并针对待完善之处着重研究予以补充，为日后更好地实现产品的投资目标提供可能性。我们始终坚信产品收益风险特征的延续性是通过不断完善和迭代投资框架、提升对市场认知而实现的，这也是我们在研究和投资过程中的努力目标。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2022 年 12 月 31 日，华夏睿磐泰茂混合 A 基金份额净值为 1.2596 元，本报告期份额净值增长率为-3.04%；华夏睿磐泰茂混合 C 基金份额净值为 1.2417 元，本报告期份额净值增长率为-3.33%，同期业绩比较基准增长率为-0.32%。

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 2023 年，我们认为是不确定性和确定性并存的市场环境，全年管理组合的核心理念是寻找不确定性中的确定性投资机会，把握市场的交易节奏，相对于债券资产更看好来自于股票资产的收益机会。我们针对今年确定性的投资线索制定全年维度基准假设情景：关键词为信心重建、政策支持、聚焦成长；2023 年的不确定性的要素对标对基准假设情景的扰动因素，关键词为长尾疫情、海外衰退和地缘政治。具体地，我们看好 2023 年在国内经济复苏背景下多投资主线在股票市场的表现，特别是在信心重建的背景下将有利于景气成长投资的表现；在股票市场的交易节奏把握上，上半年是良好的获取收益的窗口，后续需紧密关注经济复苏、通胀相关数据的边际变化，以及政策支持力度的成色；在债券市场展望方面，我们认为疫情放开后的复苏程度仍需观察，理财赎回近日有边际好转的迹象。在对债券市场的节奏把握上，我们认为 1 季度继续执行票息策略的风险不大，久期上不会太短。2 季度属开工生产旺季，数据较多且稳增长政策有不确定性，容易对债市预期形成更多扰动，这段时间需要保持谨慎，切忌追涨，大概率会采取震荡市策略高抛低吸、耐心观察。下半年由于社融的基数偏低，不排除各项经济金融读数超预期的可能性，若兑现，组合会转向防御性久期控制回撤。

珍惜基金份额持有人的每一分投资和每一份信任，本基金将继续奉行华夏基金管理有限公司“为信任奉献回报”的经营理念，规范运作，审慎投资，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求长期、稳定的回报。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人持续加强合规管理、风险控制和监察稽核工作。在合规管理方面，公司通过合规审核、合规检查、合规咨询、合规宣传与合规培训等对合规风险进行管理，确保公司合规体系高效运行，合规风险有效控制。公司不断强化合规制度建设，在投资者适当性管理和员工投资行为合规管理等方面修订多项管理制度。持续强化合规队伍专业能力建设，提升合规人员解读政策法律、预判防控合规风险的能力。公司通过法律法规答题、合规培训、合规谈话等形式，多措并举厚植合规经营文化。公司严格落实信息披露法规要求，依法合规开展信息披露工作。在风险控制方面，公司秉承数字化管理理念，持续完善内部风险管理系统建设，稳步夯实投资风险基础。在严格管控基金日常投资运作风险的同时，持续完善风险管理制度建设，提升基金流动性风险、市场风险、合规风险、操作风险等关键风险的管控水平，努力保障各项风险管理措施落实到位。在监察稽核方面，公司定期和不定期开展内部稽核及离任审计工作，排查业务风险隐患，促进公司整体业务合规运作、稳健经营。

报告期内，本基金管理人所管理的基金整体运作合法合规。本基金管理人将继续以风险控制为核心，坚持基金份额持有人利益优先的原则，提高监察稽核工作的科学性和有效性，切实保障基金合规稳健运作。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及基金合同约定，本基金管理人作为准确、及时进行基金估值和份额净值计价，制定了基金估值和份额净值计价的业务管理制度，建立了估值委员会，使用可靠的估值业务系统，设有完善的风险监测、控制和报告机制。本基金托管人审阅本基金管理人采用的估值原则及技术，并复核、审查基金资产净值和基金份额申购、赎回价格。会计师事务所在估值调整导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上时对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性发表专业意见。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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 12 月 31 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遵规守信、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 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，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年度报告中的财务指标、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 审计报告

安永华明（2023）审字第 60739337_A50 号

华夏睿磐泰茂混合型证券投资基金全体基金份额持有人：

6.1 审计意见

我们审计了华夏睿磐泰茂混合型证券投资基金的财务报表，包括 2022 年 12 月 31 日的资产负债表，2022 年度的利润表、净资产（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。

我们认为，后附的华夏睿磐泰茂混合型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了华夏睿磐泰茂混合型证券投资基金 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和净值变动情况。

6.2 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报

表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于华夏睿磐泰茂混合型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

6.3 其他信息

华夏睿磐泰茂混合型证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。

我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。

结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。

基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。

6.4 管理层和治理层对财务报表的责任

管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时，管理层负责评估华夏睿磐泰茂混合型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。

治理层负责监督华夏睿磐泰茂混合型证券投资基金的财务报告过程。

6.5 注册会计师对财务报表审计的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

(3) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

(4) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对华夏睿磐泰茂混合型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致华夏睿磐泰茂混合型证券投资基金不能持续经营。

(5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

中国注册会计师

蒋燕华 王海彦

北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层

2023 年 3 月 28 日

§7 年度财务报表

7.1 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 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	185,167,000.24	26,365,124.52
结算备付金		30,811,178.03	15,504,742.60
存出保证金		270,657.00	47,150.38
交易性金融资产	7.4.7.2	1,518,332,821.83	1,795,568,668.35
其中：股票投资		295,743,893.36	285,101,776.86
基金投资		-	-

债券投资		1,222,588,928.47	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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	220,000,270.00
应收清算款		11,048,943.08	-
应收股利		-	-
应收申购款		1,022,711.81	2,170,732.99
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	14,923,212.68
资产总计		1,746,653,311.99	2,074,579,901.52
负债和净资产	附注号	本期末 2022 年 12 月 31 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	4,918,869.54
应付赎回款		2,749,461.01	3,773,654.40
应付管理人报酬		1,352,170.29	1,209,174.80
应付托管费		338,042.53	302,293.67
应付销售服务费		129,206.80	203,061.86
应付投资顾问费		-	-
应交税费		53,646.54	21,200.50
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	2,399,702.78	1,270,182.44
负债合计		7,022,229.95	11,698,437.21
净资产:			
实收基金	7.4.7.7	1,386,258,624.78	1,595,720,328.53
未分配利润	7.4.7.8	353,372,457.26	467,161,135.78
净资产合计		1,739,631,082.04	2,062,881,464.31
负债和净资产总计		1,746,653,311.99	2,074,579,901.52

注：①报告截止日 2022 年 12 月 31 日，华夏睿磐泰茂混合 A 基金份额净值 1.2596 元，华夏睿磐泰茂混合 C 基金份额净值 1.2417 元；华夏睿磐泰茂混合基金份额总额 1,386,258,624.78 份（其中 A 类 1,022,339,071.11 份，C 类 363,919,553.67 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 年年度报告资产负债表中“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 年年度报告资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额。

7.2 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
一、营业总收入		-45,242,905.45	102,421,308.83
1.利息收入		1,265,527.05	26,787,988.45
其中：存款利息收入	7.4.7.9	934,556.32	390,261.15
债券利息收入		-	25,897,363.53
资产支持证券利息收入		-	61,291.29
买入返售金融资产收入		330,970.73	439,072.48
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-13,020,367.50	78,880,722.20
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-93,076,496.67	66,993,247.58
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	72,177,378.64	13,240,971.63
资产支持证券投资收益	7.4.7.12	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.13	3,031,774.66	-2,755,936.29
股利收益	7.4.7.14	4,846,975.87	1,402,439.28
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.15	-35,248,120.28	-3,538,107.33
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	1,760,055.28	290,705.51
减：二、营业总支出		29,714,577.39	13,093,327.76
1.管理人报酬		20,371,730.48	7,660,840.73
2.托管费		5,092,932.64	1,915,210.11
3.销售服务费		2,596,946.01	993,568.60
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		1,286,900.88	195,981.24
其中：卖出回购金融资产支出		1,286,900.88	195,981.24
6.信用减值损失	7.4.7.17	-	-
7.税金及附加		67,611.28	27,436.84
8.其他费用	7.4.7.18	298,456.10	2,300,290.24
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-74,957,482.84	89,327,981.07
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-74,957,482.84	89,327,981.07
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-74,957,482.84	89,327,981.07

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 年年度报告利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在 2022 年年度报告利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

7.3 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	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）	-209,461,703.75	-	-113,788,678.52	-323,250,382.27
（一）、综合收益总额	-	-	-74,957,482.84	-74,957,482.84
（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）	-209,461,703.75	-	-38,831,195.68	-248,292,899.43
其中：1. 基金申购款	2,072,563,496.55	-	579,106,117.01	2,651,669,613.56
2. 基金赎回款	-2,282,025,200.30	-	-617,937,312.69	-2,899,962,512.99
（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）	1,386,258,624.78	-	353,372,457.26	1,739,631,082.04
项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	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	632,354,005.10	-	108,325,590.14	740,679,595.24

资产（基金净值）				
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	963,366,323.43	-	358,835,545.64	1,322,201,869.07
（一）、综合收益总额	-	-	89,327,981.07	89,327,981.07
（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）	963,366,323.43	-	269,507,564.57	1,232,873,888.00
其中：1.基金申购款	1,312,928,990.53	-	356,584,614.76	1,669,513,605.29
2.基金赎回款	-349,562,667.10	-	-87,077,050.19	-436,639,717.29
（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）	1,595,720,328.53	-	467,161,135.78	2,062,881,464.31

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：杨明辉，主管会计工作负责人：朱威，会计机构负责人：朱威

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

华夏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）。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布和修订的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》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 7.4.4 所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

I. 新金融工具准则(自 2022 年 1 月 1 日起适用)

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

1、金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产

分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

(1) 债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益。基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资、资产支持证券投资 and 基金投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

(2) 权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

2、金融负债的分类

本基金的金融负债于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

3、衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

II. 原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用)

1、金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金目前暂无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

2、金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债包括交易性金融负债及衍生金融负债等。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

I. 新金融工具准则(自 2022 年 1 月 1 日起适用)

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，其公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益。

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益。

本基金对以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础，进行减值处理并确认损失准备。本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实

际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况。当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产。当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

II. 原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用)

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利、债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及金融负债按照公允价值进行后续计量，应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

- 1、存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近

交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

2、当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

3、如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。对于曾经实施份额拆分或折算的基金，由于基金份额拆分或折算引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日或基金份额折算日根据拆分前或折算前的基金份额数及确定的拆分或折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。对于已开放转换业务的基金，上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/（累计亏损）。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

I. 新金融工具准则(自 2022 年 1 月 1 日起适用)

境内基金投资在持有期间应取得的现金红利于除息日确认为投资收益；境外基金投资在持有期间应取得的基金分红收益扣除基金交易所在地适用的预缴所得税后的净额确认投资收益。境内股票

投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益；境外股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除股票交易所在地适用的预缴所得税后的净额确认为投资收益。境内债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。境外债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在交易所在地适用的预缴所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；处置时其公允价值与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的按直线法近似计算。

II. 原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用)

境内基金投资在持有期间应取得的现金红利于除息日确认为投资收益；境外基金投资在持有期间应取得的基金分红收益扣除基金交易所在地适用的预缴所得税后的净额确认投资收益。境内股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益；境外股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除股票交易所在地适用的预缴所得税后的净额确认为投资收益。境内债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。境外债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在交易所在地适用的预缴所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率或票面利率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；处置时其公允价值与初始确认金额之间的差额扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的按直线法近似计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

针对基金合同约定费率和计算方法的费用，本基金在费用涵盖期间按合同约定进行确认。

其他以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的按直线法近似计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

同一类别内的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红权益再投资日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。期末可供分配利润指期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

由于本基金各基金份额类别在费用收取上不同，其对应的可分配收益可能有所不同。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

1、对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

2、对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》进行估值。

3、对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场交易的固定收益品种，按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

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》、《关于印发《资产管理产品相关会计处理规定》的通知》（财会[2022]14 号）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。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 税项

根据财税[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]103 号《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81 号《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]125 号《财政部、国家税务总局、证监会关于内地与香港基金互认有关税收政策的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《财政部、国家税务总局关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《财政部、国家税务总局关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
活期存款	185,167,000.24	26,365,124.52
等于：本金	185,135,151.16	26,365,124.52
加：应计利息	31,849.08	-
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	185,167,000.24	26,365,124.52

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2022 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		305,378,874.17	-	295,743,893.36	-9,634,980.81
贵金属投资- 金交所黄金 合约		-	-	-	-
债券	交易 市场	400,062,551.69	6,675,055.12	405,463,980.23	-1,273,626.58
	银行 间市场	811,310,044.57	11,774,708.24	817,124,948.24	-5,959,804.57
	合计	1,211,372,596.26	18,449,763.36	1,222,588,928.47	-7,233,431.15
资产支持证 券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		1,516,751,470.43	18,449,763.36	1,518,332,821.83	-16,868,411.96
项目		上年度末 2021 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		283,286,607.69	-	285,101,776.86	1,815,169.17
贵金属投资- 金交所黄金 合约		-	-	-	-
债券	交易 市场	424,473,967.06	-	429,018,391.49	4,544,424.43
	银行 间市场	1,069,428,385.28	-	1,081,448,500.00	12,020,114.72
	合计	1,493,902,352.34	-	1,510,466,891.49	16,564,539.15
资产支持证 券		-	-	-	-

基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,777,188,960.03	-	1,795,568,668.35	18,379,708.32

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
合计	-	-
项目	上年度末 2021 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	120,000,000.00	-
银行间市场	100,000,270.00	-
合计	220,000,270.00	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

7.4.7.5 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
应收利息	-	14,923,212.68
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
合计	-	14,923,212.68

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	347.12	1,488.19
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	2,199,355.66	1,068,694.25
其中：交易所市场	2,188,671.41	1,051,143.96

银行间市场	10,684.25	17,550.29
应付利息	-	-
预提费用	200,000.00	200,000.00
合计	2,399,702.78	1,270,182.44

7.4.7.7 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12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	901,979,570.73	901,979,570.73
本期申购	1,134,770,233.21	1,134,770,233.21
本期赎回（以“-”号填列）	-1,014,410,732.83	-1,014,410,732.83
本期末	1,022,339,071.11	1,022,339,071.11

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12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	693,740,757.80	693,740,757.80
本期申购	937,793,263.34	937,793,263.34
本期赎回（以“-”号填列）	-1,267,614,467.47	-1,267,614,467.47
本期末	363,919,553.67	363,919,553.67

7.4.7.8 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
上年度末	232,883,708.28	36,933,183.72	269,816,892.00
本期利润	-24,725,158.60	-25,402,251.81	-50,127,410.41
本期基金份额交易产生的变动数	35,726,277.29	10,012,134.94	45,738,412.23
其中：基金申购款	282,258,406.58	45,576,937.19	327,835,343.77
基金赎回款	-246,532,129.29	-35,564,802.25	-282,096,931.54
本期已分配利润	-	-	-
本期末	243,884,826.97	21,543,066.85	265,427,893.82

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
上年度末	169,149,600.55	28,194,643.23	197,344,243.78
本期利润	-14,984,203.96	-9,845,868.47	-24,830,072.43
本期基金份额交易产生的变动数	-73,875,160.41	-10,694,447.50	-84,569,607.91
其中：基金申购款	215,607,638.50	35,663,134.74	251,270,773.24

基金赎回款	-289,482,798.91	-46,357,582.24	-335,840,381.15
本期已分配利润	-	-	-
本期末	80,290,236.18	7,654,327.26	87,944,563.44

7.4.7.9 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12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
活期存款利息收入	513,762.55	241,259.43
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	417,750.48	148,463.80
其他	3,043.29	537.92
合计	934,556.32	390,261.15

7.4.7.10 股票投资收益

7.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-93,076,496.67	66,993,247.58
股票投资收益——赎回差价收入	-	-
股票投资收益——申购差价收入	-	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-	-
合计	-93,076,496.67	66,993,247.58

7.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
卖出股票成交总额	2,730,591,665.12	637,112,998.66
减：卖出股票成本总额	2,816,739,312.24	570,119,751.08
减：交易费用	6,928,849.55	-
买卖股票差价收入	-93,076,496.67	66,993,247.58

7.4.7.11 债券投资收益

7.4.7.11.1 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12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
----	-----------------------------	----------------------------------

债券投资收益——利息收入	75,948,280.69	-
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-3,770,902.05	13,240,971.63
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	72,177,378.64	13,240,971.63

7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022年1月1日至2022年12月31日	2021年1月1日至2021年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	5,127,650,611.34	1,646,342,869.31
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	5,080,122,010.66	1,610,259,128.07
减：应计利息总额	51,232,752.21	22,842,769.61
减：交易费用	66,750.52	-
买卖债券差价收入	-3,770,902.05	13,240,971.63

7.4.7.12 资产支持证券投资收益

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12月31日	2021年1月1日至2021年12月31日
卖出资产支持证券成交总额	-	5,892,223.23
减：卖出资产支持证券成本总额	-	5,689,000.00
减：应计利息总额	-	203,223.23
减：交易费用	-	-
资产支持证券投资收益	-	-

7.4.7.13 衍生工具收益

7.4.7.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

7.4.7.13.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额	上年度可比期间收益金额
	2022年1月1日至2022年12月31日	2021年1月1日至2021年12月31日
股指期货投资收益	3,229,423.42	107,667.07
国债期货投资收益	-197,648.76	-2,863,603.36

7.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31 日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31 日
股票投资产生的股利收益	4,846,975.87	1,402,439.28
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	4,846,975.87	1,402,439.28

7.4.7.15 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12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31 日
1.交易性金融资产	-35,248,120.28	-4,485,627.33
——股票投资	-11,450,149.98	-21,913,528.63
——债券投资	-23,797,970.30	17,429,401.30
——资产支持证券投资	-	-1,500.00
——基金投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	-	947,520.00
——权证投资	-	-
——期货投资	-	947,520.00
3.其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	-35,248,120.28	-3,538,107.33

7.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
基金赎回费收入	1,760,055.28	290,705.51
合计	1,760,055.28	290,705.51

7.4.7.17 信用减值损失

无。

7.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31 日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31 日
审计费用	80,000.00	80,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00

证券出借违约金	-	-
银行费用	61,256.10	43,462.52
银行间账户维护费	36,000.00	36,000.00
其他	1,200.00	2,020,827.72
合计	298,456.10	2,300,290.24

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
华夏基金管理有限公司	基金管理人
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
MACKENZIE FINANCIAL CORPORATION	基金管理人的股东
POWER CORPORATION OF CANADA	基金管理人的股东
天津海鹏科技咨询有限公司	基金管理人的股东
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）”）	基金管理人第一大股东的子公司

注：①根据华夏基金管理有限公司于 2023 年 1 月 6 日发布的公告，华夏基金管理有限公司股权结构变更为中信证券（出资比例 62.2%）、MACKENZIE FINANCIAL CORPORATION（出资比例 27.8%）、天津海鹏科技咨询有限公司（出资比例 10%）。

②下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

无。

7.4.10.1.2 债券交易

无。

7.4.10.1.3 债券回购交易

无。

7.4.10.1.4 应支付关联方的佣金

无。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	20,371,730.48	7,660,840.73
其中：支付销售机构的客户维护费	3,162,764.54	879,731.90

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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	5,092,932.64	1,915,210.11

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

②基金托管费计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.20%/当年天数。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年12月31日 当期发生的基金应支付的销售服务费		
	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	-	432,060.69	432,060.69
华夏财富	-	4,219.30	4,219.30

中信证券 (山东)	-	149.92	149.92
中信证券	-	29.90	29.90
合计	-	436,459.81	436,459.81
获得	上年度可比期间		
销售	2021年1月1日至2021年12月31日		
服务	当期发生的基金应支付的销售服务费		
费的			
各关	华夏睿磐泰茂混合 A	华夏睿磐泰茂混合 C	合计
联方			
名称			
华夏	-	338,962.46	338,962.46
基金			
管理			
有限			
公司			
华夏	-	1,518.83	1,518.83
财富			
中信	-	106.84	106.84
证券			
(山			
东)			
中信	-	23.31	23.31
证券			
合计	-	340,611.44	340,611.44

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。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

7.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

无。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年12月31日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31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	185,167,000.24	513,762.55	26,365,124.52	241,259.43

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。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2022年1月1日至2022年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
中信证券	688041	海光信息	新股发行	47,080	1,694,880.00
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	688061	灿瑞科技	新股发行	3,972	447,604.68
中信证券	301109	军信股份	新股发行	12,250	426,422.50
中信证券	688380	中微半导	新股发行	12,677	391,212.22
中信证券	301269	华大九天	新股发行	11,677	381,721.13
中信证券	688141	杰华特	新股发行	9,946	380,533.96
中信证券	301165	锐捷网络	新股发行	10,769	348,700.22
中信证券	301349	信德新材	新股发行	1,798	249,706.24
中信证券	301302	华如科技	新股发行	4,651	241,991.53
中信证券	301335	天元宠物	新股发行	4,192	209,516.16
中信证券	688432	有研硅	新股发行	20,044	198,636.04
中信证券	688370	丛麟科技	新股发行	3,254	194,459.04
中信证券	301171	易点天下	新股发行	9,845	178,982.10
中信证券	301377	鼎泰高科	新股发行	7,695	176,061.60
中信证券	688150	莱特光电	新股发行	5,626	124,053.30
中信证券	688252	天德钰	新股发行	5,201	112,757.68
中信证券	301230	泓博医药	新股发行	2,687	107,480.00
中信证券	688290	景业智能	新股发行	3,040	103,025.60

中信证券	688525	佰维存储	新股发行	4,614	64,549.86
中信证券	603235	天新药业	新股发行	572	21,095.36
中信证券	001322	箭牌家居	新股发行	1,595	20,224.60
中信证券	001330	博纳影业	新股发行	3,564	17,926.92
中信证券	603132	金徽股份	新股发行	1,342	14,493.60
中信证券	001339	智微智能	新股发行	812	13,690.32
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	601377	兴业证券	配股发行	2,070	10,764.00
中信证券	603151	邦基科技	新股发行	535	9,603.25
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 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
中信证券	600941	中国移动	新股发行	124,803	7,186,156.74
中信证券	688235	百济神州	新股发行	18,016	3,469,881.60
中信证券	600905	三峡能源	新股发行	1,296,803	3,436,527.95
中信证券	601728	中国电信	新股发行	562,873	2,549,814.69
中信证券	688176	亚虹医药	新股发行	37,990	873,010.20
中信证券	688739	成大生物	新股发行	5,991	659,010.00
中信证券	688819	天能股份	新股发行	12,488	521,873.52
中信证券	688187	时代电气	新股发行	16,198	508,293.24
中信证券	688192	迪哲医药	新股发行	8,926	469,329.08
中信证券	688211	中科微至	新股发行	4,238	382,267.60
中信证券	688798	艾为电子	新股发行	3,396	260,065.68
中信证券	688660	电气风电	新股发行	46,114	250,860.16
中信证券	688779	长远锂科	新股发行	43,086	243,435.90
中信证券	601825	沪农商行	新股发行	15,480	137,772.00
中信证券	688670	金迪克	新股发行	2,310	127,465.80
中信证券	688276	百克生物	新股发行	3,486	126,716.10
中信证券	688212	澳华内镜	新股发行	3,496	78,660.00
中信证券	688776	国光电气	新股发行	1,447	74,433.68
中信证券	688575	亚辉龙	新股发行	3,435	50,838.00
中信证券	300982	苏文电能	新股发行	3,170	50,181.10
中信证券	600955	维远股份	新股发行	1,694	50,074.64
中信证券	300993	玉马遮阳	新股发行	4,097	49,573.70
中信证券	688315	诺禾致源	新股发行	3,711	47,352.36
中信证券	300997	欢乐家	新股发行	9,279	45,838.26
中信证券	688607	康众医疗	新股发行	1,890	43,866.90
中信证券	300930	屹通新材	新股发行	3,220	42,214.20
中信证券	301028	东亚机械	新股发行	7,329	38,916.99
中信证券	301049	超越科技	新股发行	1,954	37,790.36
中信证券	688509	正元地信	新股发行	15,433	30,403.01
中信证券	603529	爱玛科技	新股发行	1,019	28,389.34
中信证券	688690	纳微科技	新股发行	3,477	28,059.39
中信证券	603071	物产环能	新股发行	1,627	25,088.34

中信证券	301055	张小泉	新股发行	3,541	24,432.90
中信证券	300966	共同药业	新股发行	2,858	23,549.92
中信证券	688565	力源科技	新股发行	2,464	23,136.96
中信证券	605555	德昌股份	新股发行	655	21,189.25
中信证券	301059	金三江	新股发行	2,581	20,880.29
中信证券	600935	华塑股份	新股发行	4,811	18,955.34
中信证券	301053	远信工业	新股发行	1,544	18,327.28
中信证券	301062	上海艾录	新股发行	5,225	17,294.75
中信证券	688226	威腾电气	新股发行	2,693	17,289.06
中信证券	600916	中国黄金	新股发行	3,371	16,821.29
中信证券	688305	科德数控	新股发行	1,496	16,500.88
中信证券	688071	华依科技	新股发行	1,101	15,116.73
中信证券	605566	福莱蒾特	新股发行	435	14,011.35
中信证券	605060	联德股份	新股发行	883	13,765.97
中信证券	605599	菜百股份	新股发行	980	9,800.00
中信证券	605488	福莱新材	新股发行	416	8,498.88
中信证券	605138	盛泰集团	新股发行	723	7,208.31
中信证券	001208	华菱线缆	新股发行	1,754	6,437.18
中信证券	605020	永和股份	新股发行	850	5,890.50
中信证券	003040	楚天龙	新股发行	1,101	5,086.62
中信证券	001219	青岛食品	新股发行	272	4,678.40
中信证券	601279	英利汽车	新股发行	2,004	4,148.28

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

7.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配事项。

7.4.12 期末（2022 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688432	有研硅	2022-11-03	6 个月	新发流通受限	9.91	11.24	20,044	198,636.04	225,294.56	-
688498	源杰科技	2022-12-14	6 个月	新发流通受限	100.66	113.13	1,582	159,244.12	178,971.66	-
688084	晶品特装	2022-12-01	6 个月	新发流通受限	60.98	74.73	1,875	114,337.50	140,118.75	-
301269	华大	2022-	6 个月	新发	32.69	87.94	1,168	38,181.92	102,713.92	-

	九天	07-21		流通受限						
688291	金橙子	2022-10-17	6 个月	新发流通受限	26.77	24.11	3,961	106,035.97	95,499.71	-
688420	美腾科技	2022-12-01	6 个月	新发流通受限	48.96	39.04	2,408	117,895.68	94,008.32	-
688252	天德钰	2022-09-20	6 个月	新发流通受限	21.68	15.78	5,201	112,757.68	82,071.78	-
688416	恒烁股份	2022-08-22	6 个月	新发流通受限	65.11	37.01	2,147	139,791.17	79,460.47	-
301267	华夏眼科	2022-10-26	6 个月	新发流通受限	50.88	66.20	1,006	51,185.28	66,597.20	-
301095	广立微	2022-07-28	6 个月	新发流通受限	58.00	86.49	740	42,920.00	64,002.60	-
301308	江波龙	2022-07-27	6 个月	新发流通受限	55.67	56.72	819	45,593.73	46,453.68	-
301327	华宝新能	2022-09-08	6 个月	新发流通受限	237.50	176.97	242	57,475.00	42,826.74	-
301165	锐捷网络	2022-11-14	6 个月	新发流通受限	32.38	31.61	1,077	34,873.26	34,043.97	-
301356	天振股份	2022-11-03	6 个月	新发流通受限	63.00	43.33	614	38,682.00	26,604.62	-
301195	北路智控	2022-07-25	6 个月	新发流通受限	71.17	73.04	330	23,486.10	24,103.20	-
301389	隆扬电子	2022-10-18	6 个月	新发流通受限	22.50	17.16	1,269	28,552.50	21,776.04	-
301330	熵基科技	2022-08-10	6 个月	新发流通受限	43.32	31.31	694	30,064.08	21,729.14	-
301152	天力锂能	2022-08-19	6 个月	新发流通受限	57.00	46.64	433	24,681.00	20,195.12	-
301391	卡莱特	2022-11-24	6 个月	新发流通受限	96.00	80.97	247	23,712.00	19,999.59	-
301349	信德新材	2022-08-30	6 个月	新发流通受限	138.88	103.52	180	24,998.40	18,633.60	-
301171	易点	2022-	6 个月	新发	18.18	17.72	985	17,907.30	17,454.20	-

	天下	08-10		流通受限						
301363	美好医疗	2022-09-28	6 个月	新发流通受限	30.66	37.85	445	13,643.70	16,843.25	-
301115	建科股份	2022-08-23	6 个月	新发流通受限	42.05	24.04	685	28,804.25	16,467.40	-
301223	中荣股份	2022-10-13	6 个月	新发流通受限	26.28	18.13	815	21,418.20	14,775.95	-
301328	维峰电子	2022-08-30	6 个月	新发流通受限	78.80	76.96	191	15,050.80	14,699.36	-
301121	紫建电子	2022-08-01	6 个月	新发流通受限	61.07	49.77	290	17,710.30	14,433.30	-
301139	元道通信	2022-06-30	6 个月	新发流通受限	38.46	25.31	566	21,768.36	14,325.46	-
301335	天元宠物	2022-11-11	6 个月	新发流通受限	49.98	33.82	420	20,991.60	14,204.40	-
301377	鼎泰高科	2022-11-11	6 个月	新发流通受限	22.88	17.63	770	17,617.60	13,575.10	-
301230	泓博医药	2022-10-21	6 个月	新发流通受限	40.00	48.32	269	10,760.00	12,998.08	-
301396	宏景科技	2022-11-04	6 个月	新发流通受限	40.13	31.90	396	15,891.48	12,632.40	-
301338	凯格精机	2022-08-08	6 个月	新发流通受限	46.33	48.99	257	11,906.81	12,590.43	-
301280	珠城科技	2022-12-19	6 个月	新发流通受限	67.40	44.80	279	18,804.60	12,499.20	-
301365	矩阵股份	2022-11-14	6 个月	新发流通受限	34.72	23.87	516	17,915.52	12,316.92	-
301366	一博科技	2022-09-19	6 个月	新发流通受限	65.35	45.09	268	17,513.80	12,084.12	-
301283	聚胶股份	2022-08-26	6 个月	新发流通受限	52.69	51.41	235	12,382.15	12,081.35	-
301132	满坤科技	2022-08-03	6 个月	新发流通受限	26.80	24.48	468	12,542.40	11,456.64	-
301277	新天	2022-	6 个月	新发	27.00	25.78	439	11,853.00	11,317.42	-

	地	11-09		流通受限						
301379	天山电子	2022-10-19	6 个月	新发流通受限	31.51	24.63	449	14,147.99	11,058.87	-
301306	西测测试	2022-07-19	6 个月	新发流通受限	43.23	42.29	255	11,023.65	10,783.95	-
301273	瑞晨环保	2022-10-11	6 个月	新发流通受限	37.89	37.79	277	10,495.53	10,467.83	-
301265	华新环保	2022-12-08	6 个月	新发流通受限	13.28	11.40	819	10,876.32	9,336.60	-
301176	逸豪新材	2022-09-21	6 个月	新发流通受限	23.88	16.89	544	12,990.72	9,188.16	-
301318	维海德	2022-08-03	6 个月	新发流通受限	64.68	41.74	206	13,324.08	8,598.44	-
301326	捷邦科技	2022-09-09	6 个月	新发流通受限	51.72	36.62	227	11,740.44	8,312.74	-
301398	星源卓镁	2022-12-08	6 个月	新发流通受限	34.40	28.94	255	8,772.00	7,379.70	-
301313	凡拓数创	2022-09-22	6 个月	新发流通受限	25.25	29.14	247	6,236.75	7,197.58	-
301276	嘉曼服饰	2022-09-01	6 个月	新发流通受限	40.66	22.61	303	12,319.98	6,850.83	-
301388	欣灵电气	2022-10-26	6 个月	新发流通受限	25.88	21.60	292	7,556.96	6,307.20	-
301368	丰立智能	2022-12-07	6 个月	新发流通受限	22.33	18.52	337	7,525.21	6,241.24	-
301319	唯特偶	2022-09-22	6 个月	新发流通受限	47.75	53.27	115	5,491.25	6,126.05	-
301270	汉仪股份	2022-08-19	6 个月	新发流通受限	25.68	28.37	210	5,392.80	5,957.70	-
301309	万得凯	2022-09-08	6 个月	新发流通受限	39.00	24.46	228	8,892.00	5,576.88	-
301316	慧博云通	2022-09-29	6 个月	新发流通受限	7.60	14.32	359	2,728.40	5,140.88	-
7.4.12.1.2 受限证券类别：债券										

证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
110091	合力转债	2022-12-13	1 个月内(含)	新发流通受限	100.00	100.01	1,170	117,000.00	117,009.74	期末估值单价为含息价格
118029	富淼转债	2022-12-15	1 个月内(含)	新发流通受限	100.00	100.01	180	18,000.00	18,001.34	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。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指由于基金所投资债券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息，债券发行人信用评级降低导致债券价格下降，或基金在交易过程中发生交收违约，而造成基金资产损失的可能性。

本基金管理人通过信用分析团队建立了内部评级体系和交易对手库，对发行人及债券投资进行内部评级，对交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度，以控制可能出现的信用风险。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是在市场或持有资产流动性不足的情况下，基金管理人可能无法迅速、低成本地调整基金投资组合，从而对基金收益造成不利影响。

本基金管理人通过限制投资集中度来管理投资品种变现的流动性风险。除在“7.4.12 期末本基金

持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限制的情况外，本基金所投资的证券均能及时变现。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

在日常运作中，本基金的流动性安排能够与基金合同约定的申购赎回安排以及投资者的申购赎回规律相匹配。

在资产端，本基金主要投资于基金合同约定的具有良好流动性的金融工具。基金管理人持续监测本基金持有资产的市场交易量、交易集中度等涉及资产流动性水平的风险指标，并定期开展压力测试，详细评估在不同的压力情景下资产变现情况的变化。

在负债端，基金管理人持续监测本基金开放期内投资者历史申赎、投资者类型和结构变化等数据，审慎评估不同市场环境可能带来的投资者潜在赎回需求，当市场环境或投资者结构发生变化时，及时调整组合资产结构及比例，预留充足现金头寸，保持基金资产可变现规模和期限与负债赎回规模和期限的匹配。

如遭遇极端市场情形或投资者非预期巨额赎回情形，基金管理人将采用本基金合同约定的赎回申请处理方式及其他各类流动性风险管理工具，控制极端情况下的潜在流动性风险。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指由于市场变化或波动所引起的资产损失的可能性，本基金管理人通过监测组合敏感性指标来衡量市场风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率变动引起组合中资产特别是债券投资的市场价格变动，从而影响基金投资收益的风险。

本基金管理人定期对组合中债券投资部分面临的利率风险进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	合计
银行存款	185,167,000.24	-	-	185,167,000.24
结算备付金	30,811,178.03	-	-	30,811,178.03
结算保证金	270,657.00	-	-	270,657.00
债券投资	266,452,036.00	799,422,094.26	156,714,798.21	1,222,588,928.47
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	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。

7.4.13.4.1.2 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 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
	利率下降 25 个基点	8,624,104.92	15,475,639.52
	利率上升 25 个基点	-8,516,340.38	-15,191,230.25

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险为除市场利率和外汇汇率以外的市场因素（单个证券发行主体自身经营情况或证券市场整体波动）发生变动时导致基金资产发生损失的风险。

本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险。此外，本基金管理人对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法进行风险度量和分析，以对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 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	295,743,893.36	17.00	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	18,518,311.66	1.06	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	314,262,205.02	18.06	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。

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
	-5%	-13,595,511.51	-14,403,240.42
	+5%	13,595,511.51	14,403,240.42

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	312,350,809.64	341,520,338.00
第二层次	1,204,205,627.89	1,454,048,330.35
第三层次	1,776,384.30	-
合计	1,518,332,821.83	1,795,568,668.35

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	1,867,099.38	1,867,099.38
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	-90,715.08	-90,715.08
其中：计入损益的利得或损失	-	-90,715.08	-90,715.08
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	1,776,384.30	1,776,384.30
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-90,715.08	-90,715.08

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

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	1,776,384.30	平均价格亚式期权模型	预期年化波动率	0.1891-2.4756	负相关

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

截至 2022 年 12 月 31 日止，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，其账面价值与公允价值差异很小。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	295,743,893.36	16.93
	其中：股票	295,743,893.36	16.93
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,222,588,928.47	70.00
	其中：债券	1,222,588,928.47	70.00
	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	215,978,178.27	12.37
8	其他各项资产	12,342,311.89	0.71
9	合计	1,746,653,311.99	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	6,646,814.00	0.38
B	采矿业	13,503,490.50	0.78
C	制造业	180,505,373.98	10.38
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,881,545.90	0.34
E	建筑业	6,100,152.00	0.35
F	批发和零售业	2,346,409.80	0.13
G	交通运输、仓储和邮政业	4,944,060.00	0.28
H	住宿和餐饮业	92,702.70	0.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,185,119.61	0.53
J	金融业	34,137,367.50	1.96
K	房地产业	20,929,663.00	1.20
L	租赁和商务服务业	3,963,364.00	0.23
M	科学研究和技术服务业	4,104,622.35	0.24
N	水利、环境和公共设施管理业	1,034,691.82	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	1,899,769.20	0.11
R	文化、体育和娱乐业	372,707.00	0.02
S	综合	96,040.00	0.01
	合计	295,743,893.36	17.00

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值
----	------	------	-------	------	---------

					比例(%)
1	300750	宁德时代	32,500	12,786,150.00	0.73
2	600519	贵州茅台	6,100	10,534,700.00	0.61
3	601166	兴业银行	386,500	6,798,535.00	0.39
4	600036	招商银行	146,900	5,473,494.00	0.31
5	601318	中国平安	97,200	4,568,400.00	0.26
6	300760	迈瑞医疗	14,200	4,486,774.00	0.26
7	300009	安科生物	467,400	4,374,864.00	0.25
8	000001	平安银行	322,800	4,248,048.00	0.24
9	600048	保利发展	252,700	3,823,351.00	0.22
10	000002	万科 A	198,100	3,605,420.00	0.21
11	300442	润泽科技	78,100	3,308,316.00	0.19
12	601012	隆基绿能	76,100	3,215,986.00	0.18
13	001914	招商积余	202,900	3,120,602.00	0.18
14	600438	通威股份	79,600	3,070,968.00	0.18
15	300390	天华超净	54,200	3,028,696.00	0.17
16	001979	招商蛇口	238,300	3,009,729.00	0.17
17	002142	宁波银行	92,610	3,005,194.50	0.17
18	600873	梅花生物	282,170	2,872,490.60	0.17
19	600383	金地集团	280,500	2,869,515.00	0.16
20	300498	温氏股份	144,100	2,828,683.00	0.16
21	002594	比亚迪	10,900	2,800,973.00	0.16
22	600325	华发股份	300,000	2,718,000.00	0.16
23	000651	格力电器	81,600	2,637,312.00	0.15
24	000568	泸州老窖	11,700	2,624,076.00	0.15
25	603259	药明康德	31,300	2,535,300.00	0.15
26	300014	亿纬锂能	24,900	2,188,710.00	0.13
27	600809	山西汾酒	7,600	2,165,924.00	0.12
28	600971	恒源煤电	290,800	2,082,128.00	0.12
29	601857	中国石油	413,900	2,057,083.00	0.12
30	601899	紫金矿业	199,100	1,991,000.00	0.11
31	002304	洋河股份	12,000	1,926,000.00	0.11
32	002938	鹏鼎控股	65,100	1,786,344.00	0.10
33	300861	美畅股份	36,112	1,775,265.92	0.10
34	002129	TCL 中环	46,500	1,751,190.00	0.10
35	002714	牧原股份	35,500	1,730,625.00	0.10
36	300763	锦浪科技	9,400	1,692,470.00	0.10
37	000858	五粮液	9,300	1,680,417.00	0.10
38	600837	海通证券	180,500	1,568,545.00	0.09
39	601668	中国建筑	276,700	1,502,481.00	0.09
40	300866	安克创新	25,300	1,499,531.00	0.09
41	002821	凯莱英	10,040	1,485,920.00	0.09
42	300628	亿联网络	24,503	1,484,636.77	0.09
43	601601	中国太保	56,300	1,380,476.00	0.08
44	601088	中国神华	49,700	1,372,714.00	0.08
45	600905	三峡能源	242,000	1,367,300.00	0.08
46	601211	国泰君安	95,200	1,293,768.00	0.07
47	000661	长春高新	7,600	1,265,020.00	0.07
48	002475	立讯精密	39,750	1,262,062.50	0.07
49	002049	紫光国微	9,500	1,252,290.00	0.07

50	600039	四川路桥	110,900	1,233,208.00	0.07
51	600089	特变电工	61,000	1,224,880.00	0.07
52	600008	首创环保	426,010	1,205,608.30	0.07
53	600690	海尔智家	49,000	1,198,540.00	0.07
54	300450	先导智能	29,144	1,173,046.00	0.07
55	601658	邮储银行	250,800	1,158,696.00	0.07
56	000333	美的集团	22,100	1,144,780.00	0.07
57	600790	轻纺城	245,100	1,139,715.00	0.07
58	002410	广联达	18,800	1,127,060.00	0.06
59	000012	南玻 A	165,100	1,107,821.00	0.06
60	002459	晶澳科技	18,300	1,099,647.00	0.06
61	300699	光威复材	15,200	1,098,200.00	0.06
62	002352	顺丰控股	18,900	1,091,664.00	0.06
63	002460	赣锋锂业	15,500	1,077,405.00	0.06
64	600660	福耀玻璃	28,000	981,960.00	0.06
65	002371	北方华创	4,300	968,790.00	0.06
66	002315	焦点科技	53,400	961,734.00	0.06
67	002404	嘉欣丝绸	147,800	941,486.00	0.05
68	300244	迪安诊断	36,900	927,297.00	0.05
69	000895	双汇发展	35,600	923,108.00	0.05
70	603968	醋化股份	42,400	921,352.00	0.05
71	600104	上汽集团	63,400	913,594.00	0.05
72	601398	工商银行	207,300	899,682.00	0.05
73	000529	广弘控股	100,800	884,016.00	0.05
74	601633	长城汽车	28,900	856,018.00	0.05
75	600018	上港集团	159,800	853,332.00	0.05
76	300795	米奥会展	20,900	852,929.00	0.05
77	000408	藏格矿业	32,700	849,219.00	0.05
78	600900	长江电力	39,800	835,800.00	0.05
79	601238	广汽集团	75,100	828,353.00	0.05
80	002422	科伦药业	31,000	824,910.00	0.05
81	601919	中远海控	79,900	822,171.00	0.05
82	601231	环旭电子	50,500	819,615.00	0.05
83	000617	中油资本	145,800	812,106.00	0.05
84	000792	盐湖股份	35,600	807,764.00	0.05
85	600060	海信视像	59,100	800,214.00	0.05
86	002244	滨江集团	89,200	787,636.00	0.05
87	600585	海螺水泥	28,700	785,806.00	0.05
88	601598	中国外运	204,300	784,512.00	0.05
89	600284	浦东建设	116,300	783,862.00	0.05
90	002050	三花智控	35,500	753,310.00	0.04
91	600188	兖矿能源	22,100	742,118.00	0.04
92	600256	广汇能源	82,200	741,444.00	0.04
93	300502	新易盛	30,988	735,965.00	0.04
94	600236	桂冠电力	127,200	732,672.00	0.04
95	002709	天赐材料	15,800	692,988.00	0.04
96	002027	分众传媒	103,600	692,048.00	0.04
97	002597	金禾实业	21,200	689,000.00	0.04
98	603083	剑桥科技	60,400	678,896.00	0.04
99	002772	众兴菌业	81,500	678,080.00	0.04

100	300122	智飞生物	7,700	676,291.00	0.04
101	600570	恒生电子	16,370	662,330.20	0.04
102	688616	西力科技	62,602	654,816.92	0.04
103	000733	振华科技	5,700	651,111.00	0.04
104	300394	天孚通信	25,400	643,890.00	0.04
105	600522	中天科技	39,700	641,155.00	0.04
106	301060	兰卫医学	31,400	615,754.00	0.04
107	600370	三房巷	201,300	609,939.00	0.04
108	600941	中国移动	9,000	609,030.00	0.04
109	600820	隧道股份	114,600	603,942.00	0.03
110	002363	隆基机械	85,600	603,480.00	0.03
111	600814	杭州解百	81,300	600,807.00	0.03
112	600583	海油工程	98,600	597,516.00	0.03
113	000726	鲁泰 A	80,200	591,876.00	0.03
114	300770	新媒股份	15,700	591,262.00	0.03
115	603100	川仪股份	18,500	578,865.00	0.03
116	600598	北大荒	41,900	576,544.00	0.03
117	301030	仕净科技	13,800	575,598.00	0.03
118	000881	中广核技	74,400	575,112.00	0.03
119	600888	新疆众和	70,000	573,300.00	0.03
120	300316	晶盛机电	9,000	572,040.00	0.03
121	601688	华泰证券	44,500	566,930.00	0.03
122	000301	东方盛虹	43,200	563,328.00	0.03
123	600938	中国海油	36,900	560,880.00	0.03
124	002466	天齐锂业	7,100	560,829.00	0.03
125	300580	贝斯特	29,700	553,014.00	0.03
126	300074	华平股份	146,300	548,625.00	0.03
127	300643	万通智控	38,400	546,048.00	0.03
128	000589	贵州轮胎	113,800	545,102.00	0.03
129	002393	力生制药	25,500	542,895.00	0.03
130	002229	鸿博股份	80,800	537,320.00	0.03
131	600133	东湖高新	97,600	536,800.00	0.03
132	002493	荣盛石化	43,600	536,280.00	0.03
133	300723	一品红	15,500	535,990.00	0.03
134	603339	四方科技	43,500	531,135.00	0.03
135	601877	正泰电器	19,100	529,070.00	0.03
136	301169	零点有数	17,500	526,750.00	0.03
137	300195	长荣股份	97,500	523,575.00	0.03
138	601958	金钼股份	45,000	519,750.00	0.03
139	002215	诺普信	98,400	518,568.00	0.03
140	603556	海兴电力	29,300	515,680.00	0.03
141	301117	佳缘科技	6,500	515,450.00	0.03
142	300130	新国都	42,700	515,389.00	0.03
143	601225	陕西煤业	27,600	512,808.00	0.03
144	002158	汉钟精机	21,400	512,530.00	0.03
145	601677	明泰铝业	28,000	507,920.00	0.03
146	601319	中国人保	97,300	507,906.00	0.03
147	600761	安徽合力	38,600	507,590.00	0.03
148	300845	捷安高科	27,700	506,356.00	0.03
149	301081	严牌股份	43,804	505,498.16	0.03

150	300532	今天国际	34,400	498,112.00	0.03
151	603086	先达股份	37,800	494,802.00	0.03
152	601666	平煤股份	45,700	494,017.00	0.03
153	300803	指南针	10,800	493,776.00	0.03
154	603185	上机数控	4,500	476,325.00	0.03
155	002258	利尔化学	26,500	475,940.00	0.03
156	300059	东方财富	24,400	473,360.00	0.03
157	600037	歌华有线	57,700	469,678.00	0.03
158	301027	华蓝集团	34,700	468,450.00	0.03
159	600478	科力远	49,500	464,310.00	0.03
160	600348	华阳股份	32,570	464,122.50	0.03
161	002384	东山精密	18,600	459,978.00	0.03
162	601888	中国中免	2,100	453,663.00	0.03
163	603187	海容冷链	14,101	447,283.72	0.03
164	600886	国投电力	41,120	445,329.60	0.03
165	300964	本川智能	16,300	436,677.00	0.03
166	603225	新凤鸣	39,800	433,024.00	0.02
167	688668	鼎通科技	6,500	429,000.00	0.02
168	002254	泰和新材	20,100	426,321.00	0.02
169	301067	显盈科技	11,600	419,340.00	0.02
170	601233	桐昆股份	28,900	417,605.00	0.02
171	605088	冠盛股份	24,100	414,038.00	0.02
172	601985	中国核电	68,700	412,200.00	0.02
173	600963	岳阳林纸	75,300	410,385.00	0.02
174	688063	派能科技	1,300	410,345.00	0.02
175	603920	世运电路	28,400	408,392.00	0.02
176	002273	水晶光电	34,600	407,934.00	0.02
177	601669	中国电建	57,500	407,100.00	0.02
178	300121	阳谷华泰	39,000	404,040.00	0.02
179	600884	杉杉股份	22,100	402,220.00	0.02
180	000063	中兴通讯	15,500	400,830.00	0.02
181	601006	大秦铁路	59,600	398,128.00	0.02
182	603077	和邦生物	126,900	385,776.00	0.02
183	600731	湖南海利	51,600	384,936.00	0.02
184	600153	建发股份	28,000	382,200.00	0.02
185	603328	依顿电子	58,700	380,963.00	0.02
186	002100	天康生物	45,800	380,598.00	0.02
187	300709	精研科技	13,200	372,108.00	0.02
188	603529	爱玛科技	8,100	371,547.00	0.02
189	300979	华利集团	6,500	371,215.00	0.02
190	300739	明阳电路	28,200	363,216.00	0.02
191	002675	东诚药业	21,200	351,072.00	0.02
192	600276	恒瑞医药	9,100	350,623.00	0.02
193	600732	爱旭股份	9,200	347,944.00	0.02
194	000425	徐工机械	67,200	340,704.00	0.02
195	601689	拓普集团	5,800	339,764.00	0.02
196	300972	万辰生物	28,200	339,528.00	0.02
197	603118	共进股份	42,700	339,465.00	0.02
198	000417	合肥百货	62,104	338,466.80	0.02
199	600028	中国石化	77,400	337,464.00	0.02

200	002463	沪电股份	28,300	336,770.00	0.02
201	603786	科博达	5,100	335,733.00	0.02
202	000166	申万宏源	83,500	332,330.00	0.02
203	002508	老板电器	11,900	330,344.00	0.02
204	603500	祥和实业	28,900	327,726.00	0.02
205	600111	北方稀土	13,000	325,650.00	0.02
206	000915	华特达因	7,000	318,500.00	0.02
207	300743	天地数码	26,800	310,076.00	0.02
208	002997	瑞鹄模具	12,700	309,880.00	0.02
209	002179	中航光电	5,300	306,128.00	0.02
210	603355	莱克电气	10,900	305,636.00	0.02
211	002517	恺英网络	46,300	303,728.00	0.02
212	002532	天山铝业	39,300	303,396.00	0.02
213	300274	阳光电源	2,700	301,860.00	0.02
214	000921	海信家电	22,900	301,593.00	0.02
215	300894	火星人	11,900	300,832.00	0.02
216	300748	金力永磁	10,200	298,452.00	0.02
217	300476	胜宏科技	22,900	296,326.00	0.02
218	601966	玲珑轮胎	14,300	292,864.00	0.02
219	600499	科达制造	20,500	291,305.00	0.02
220	600073	上海梅林	36,600	290,970.00	0.02
221	600875	东方电气	13,800	290,076.00	0.02
222	003019	宸展光电	13,380	285,127.80	0.02
223	601117	中国化学	35,800	284,252.00	0.02
224	600801	华新水泥	19,100	283,062.00	0.02
225	300970	华绿生物	15,800	281,240.00	0.02
226	300741	华宝股份	11,900	280,007.00	0.02
227	603228	景旺电子	13,800	279,312.00	0.02
228	600887	伊利股份	9,000	279,000.00	0.02
229	301035	润丰股份	3,200	278,720.00	0.02
230	603360	百傲化学	15,800	277,606.00	0.02
231	603838	四通股份	47,200	274,232.00	0.02
232	002139	拓邦股份	26,400	273,768.00	0.02
233	002376	新北洋	40,800	272,952.00	0.02
234	605196	华通线缆	38,900	271,522.00	0.02
235	688528	秦川物联	26,290	267,895.10	0.02
236	603609	禾丰股份	22,600	267,584.00	0.02
237	300951	博硕科技	5,600	266,560.00	0.02
238	300272	开能健康	51,100	266,231.00	0.02
239	688571	杭华股份	38,069	266,102.31	0.02
240	603659	璞泰来	5,100	264,639.00	0.02
241	688533	上声电子	4,600	264,040.00	0.02
242	600233	圆通速递	13,100	263,179.00	0.02
243	688466	金科环境	17,167	259,221.70	0.01
244	688303	大全能源	5,400	257,472.00	0.01
245	688187	时代电气	4,700	256,479.00	0.01
246	688399	硕世生物	2,918	255,937.78	0.01
247	300385	雪浪环境	43,100	253,859.00	0.01
248	002908	德生科技	16,100	252,770.00	0.01
249	300680	隆盛科技	10,000	247,600.00	0.01

250	603596	伯特利	3,100	247,380.00	0.01
251	601717	郑煤机	22,100	246,636.00	0.01
252	000968	蓝焰控股	28,200	245,058.00	0.01
253	300860	锋尚文化	4,700	244,541.00	0.01
254	605507	国邦医药	9,200	243,524.00	0.01
255	002920	德赛西威	2,300	242,282.00	0.01
256	601799	星宇股份	1,900	242,003.00	0.01
257	688178	万德斯	13,798	240,637.12	0.01
258	601390	中国中铁	43,100	239,636.00	0.01
259	605123	派克新材	1,800	239,220.00	0.01
260	600389	江山股份	5,400	238,032.00	0.01
261	300002	神州泰岳	54,800	237,832.00	0.01
262	300881	盛德鑫泰	7,400	237,466.00	0.01
263	300938	信测标准	7,100	237,424.00	0.01
264	688169	石头科技	958	237,344.50	0.01
265	603903	中持股份	26,000	235,040.00	0.01
266	003035	南网能源	41,200	233,604.00	0.01
267	000950	重药控股	45,900	233,172.00	0.01
268	002047	宝鹰股份	59,400	232,848.00	0.01
269	300639	凯普生物	13,800	232,530.00	0.01
270	600557	康缘药业	12,400	232,500.00	0.01
271	601800	中国交建	28,400	228,620.00	0.01
272	002955	鸿合科技	9,600	226,080.00	0.01
273	688432	有研硅	20,044	225,294.56	0.01
274	601699	潞安环能	13,300	224,105.00	0.01
275	600702	舍得酒业	1,400	222,852.00	0.01
276	002135	东南网架	35,700	222,411.00	0.01
277	603612	索通发展	8,500	221,170.00	0.01
278	603283	赛腾股份	7,300	219,219.00	0.01
279	002541	鸿路钢构	7,400	216,746.00	0.01
280	000014	沙河股份	21,100	215,009.00	0.01
281	000011	深物业 A	18,400	213,256.00	0.01
282	300035	中科电气	10,300	211,974.00	0.01
283	603699	纽威股份	18,900	209,790.00	0.01
284	300910	瑞丰新材	1,700	209,627.00	0.01
285	301022	海泰科	7,800	209,430.00	0.01
286	002111	威海广泰	20,900	208,373.00	0.01
287	300015	爱尔眼科	6,700	208,169.00	0.01
288	603677	奇精机械	18,300	204,960.00	0.01
289	600548	深高速	22,800	204,744.00	0.01
290	605117	德业股份	600	198,720.00	0.01
291	002133	广宇集团	55,600	195,156.00	0.01
292	300438	鹏辉能源	2,500	194,975.00	0.01
293	000517	荣安地产	65,400	192,930.00	0.01
294	000878	云南铜业	16,300	191,525.00	0.01
295	002311	海大集团	3,100	191,363.00	0.01
296	000625	长安汽车	15,500	190,805.00	0.01
297	600901	江苏金租	34,800	190,704.00	0.01
298	002836	新宏泽	20,100	190,146.00	0.01
299	002036	联创电子	15,300	189,261.00	0.01

300	603799	华友钴业	3,400	189,142.00	0.01
301	001210	金房节能	7,400	188,922.00	0.01
302	300230	永利股份	49,900	188,622.00	0.01
303	688517	金冠电气	16,396	188,390.04	0.01
304	603898	好莱客	16,600	187,912.00	0.01
305	002986	宇新股份	8,600	186,964.00	0.01
306	603678	火炬电子	4,500	184,230.00	0.01
307	002847	盐津铺子	1,700	184,093.00	0.01
308	600926	杭州银行	14,000	183,120.00	0.01
309	603387	基蛋生物	14,600	182,500.00	0.01
310	600057	厦门象屿	17,700	181,779.00	0.01
311	000680	山推股份	43,900	181,307.00	0.01
312	600780	通宝能源	28,200	181,044.00	0.01
313	603421	鼎信通讯	21,600	180,792.00	0.01
314	002947	恒铭达	9,100	179,725.00	0.01
315	603600	永艺股份	18,400	179,400.00	0.01
316	300780	德恩精工	12,900	179,310.00	0.01
317	688498	源杰科技	1,582	178,971.66	0.01
318	002432	九安医疗	3,500	178,885.00	0.01
319	603369	今世缘	3,500	178,150.00	0.01
320	603095	越剑智能	8,000	177,280.00	0.01
321	002871	伟隆股份	13,500	177,255.00	0.01
322	603998	方盛制药	22,100	177,021.00	0.01
323	603613	国联股份	2,000	176,880.00	0.01
324	603519	立霸股份	16,000	176,800.00	0.01
325	000700	模塑科技	38,100	176,784.00	0.01
326	300126	锐奇股份	31,000	172,980.00	0.01
327	300787	海能实业	6,300	171,171.00	0.01
328	002478	常宝股份	30,400	171,152.00	0.01
329	300724	捷佳伟创	1,500	171,030.00	0.01
330	000729	燕京啤酒	16,100	170,982.00	0.01
331	301036	双乐股份	10,300	170,774.00	0.01
332	605060	联德股份	6,600	170,346.00	0.01
333	301042	安联锐视	5,300	170,183.00	0.01
334	301070	开勒股份	7,300	169,944.00	0.01
335	603035	常熟汽饰	7,900	167,875.00	0.01
336	002312	川发龙麟	15,900	167,268.00	0.01
337	002885	京泉华	5,600	166,992.00	0.01
338	000758	中色股份	34,900	165,775.00	0.01
339	601567	三星医疗	12,200	164,456.00	0.01
340	000983	山西焦煤	14,000	163,100.00	0.01
341	601975	招商南油	41,100	161,934.00	0.01
342	688050	爱博医疗	700	161,490.00	0.01
343	600600	青岛啤酒	1,500	161,250.00	0.01
344	000596	古井贡酒	600	160,140.00	0.01
345	002444	巨星科技	8,400	159,432.00	0.01
346	688068	热景生物	2,600	158,340.00	0.01
347	603688	石英股份	1,200	157,584.00	0.01
348	002756	永兴材料	1,700	156,689.00	0.01
349	300644	南京聚隆	11,200	154,672.00	0.01

350	603987	康德莱	11,200	154,336.00	0.01
351	688367	工大高科	9,708	153,580.56	0.01
352	300595	欧普康视	4,300	153,510.00	0.01
353	688096	京源环保	12,718	153,506.26	0.01
354	600566	济川药业	5,600	152,432.00	0.01
355	839680	广道数字	12,300	151,659.00	0.01
356	300321	同大股份	10,300	151,410.00	0.01
357	600426	华鲁恒升	4,500	149,175.00	0.01
358	605077	华康股份	4,900	148,666.00	0.01
359	600428	中远海特	24,400	145,424.00	0.01
360	300973	立高食品	1,500	144,270.00	0.01
361	688077	大地熊	2,900	143,985.00	0.01
362	688618	三旺通信	1,800	143,820.00	0.01
363	600050	中国联通	31,800	142,464.00	0.01
364	600210	紫江企业	28,400	142,000.00	0.01
365	002568	百润股份	3,800	141,968.00	0.01
366	688499	利元亨	900	141,642.00	0.01
367	603517	绝味食品	2,300	140,507.00	0.01
368	000970	中科三环	10,300	140,492.00	0.01
369	688084	晶品特装	1,875	140,118.75	0.01
370	002557	洽洽食品	2,800	140,000.00	0.01
371	002057	中钢天源	13,300	139,650.00	0.01
372	603860	中公高科	6,000	139,380.00	0.01
373	600366	宁波韵升	13,100	138,205.00	0.01
374	002507	涪陵榨菜	5,300	136,581.00	0.01
375	301085	亚康股份	4,900	136,514.00	0.01
376	600872	中炬高新	3,700	136,419.00	0.01
377	301053	远信工业	6,700	135,943.00	0.01
378	002831	裕同科技	4,100	135,587.00	0.01
379	300308	中际旭创	5,000	135,150.00	0.01
380	002402	和而泰	9,100	132,678.00	0.01
381	003816	中国广核	49,300	132,617.00	0.01
382	300673	佩蒂股份	7,400	130,610.00	0.01
383	688388	嘉元科技	2,900	130,065.00	0.01
384	301133	金钟股份	6,200	129,828.00	0.01
385	002074	国轩高科	4,500	129,735.00	0.01
386	002991	甘源食品	1,700	129,693.00	0.01
387	600633	浙数文化	15,800	129,402.00	0.01
388	000786	北新建材	5,000	129,400.00	0.01
389	603858	步长制药	6,100	128,161.00	0.01
390	300833	浩洋股份	1,500	125,760.00	0.01
391	688385	复旦微电	1,800	125,658.00	0.01
392	000902	新洋丰	10,900	125,459.00	0.01
393	600141	兴发集团	4,300	124,700.00	0.01
394	830839	万通液压	18,871	123,227.63	0.01
395	301045	天禄科技	7,518	122,092.32	0.01
396	688617	惠泰医疗	393	120,623.49	0.01
397	603949	雪龙集团	6,600	119,064.00	0.01
398	300073	当升科技	2,100	118,440.00	0.01
399	300984	金沃股份	5,800	118,146.00	0.01

400	600098	广州发展	21,000	116,550.00	0.01
401	002518	科士达	2,000	115,200.00	0.01
402	301000	肇民科技	4,300	114,509.00	0.01
403	002956	西麦食品	7,700	114,499.00	0.01
404	002768	国恩股份	3,900	113,178.00	0.01
405	000338	潍柴动力	11,100	112,998.00	0.01
406	603986	兆易创新	1,100	112,717.00	0.01
407	300907	康平科技	6,300	112,644.00	0.01
408	600582	天地科技	21,600	112,320.00	0.01
409	000034	神州数码	5,100	111,894.00	0.01
410	834599	同力股份	15,700	111,156.00	0.01
411	300070	碧水源	23,500	111,155.00	0.01
412	688103	国力股份	1,709	109,957.06	0.01
413	300952	恒辉安防	5,800	107,764.00	0.01
414	603868	飞科电器	1,600	107,728.00	0.01
415	605183	确成股份	5,700	107,673.00	0.01
416	603876	鼎胜新材	2,600	106,704.00	0.01
417	600777	新潮能源	48,700	106,166.00	0.01
418	605599	菜百股份	10,400	105,872.00	0.01
419	600785	新华百货	5,700	105,678.00	0.01
420	300810	中科海讯	6,000	103,920.00	0.01
421	301269	华大九天	1,168	102,713.92	0.01
422	300363	博腾股份	2,500	102,125.00	0.01
423	688255	凯尔达	3,928	100,988.88	0.01
424	300260	新莱应材	1,500	100,650.00	0.01
425	002841	视源股份	1,700	100,368.00	0.01
426	605500	森林包装	10,012	100,320.24	0.01
427	002738	中矿资源	1,500	99,990.00	0.01
428	831726	朱老六	9,800	99,176.00	0.01
429	837242	建邦科技	11,500	98,210.00	0.01
430	688091	上海谊众	1,400	97,720.00	0.01
431	832225	利通科技	16,500	97,185.00	0.01
432	688067	爱威科技	5,173	96,890.29	0.01
433	688312	燕麦科技	6,195	96,084.45	0.01
434	000567	海德股份	6,900	96,048.00	0.01
435	605138	盛泰集团	8,900	95,764.00	0.01
436	688291	金橙子	3,961	95,499.71	0.01
437	605180	华生科技	6,100	95,221.00	0.01
438	600250	南纺股份	16,200	94,446.00	0.01
439	688420	美腾科技	2,408	94,008.32	0.01
440	688639	华恒生物	600	93,150.00	0.01
441	301193	家联科技	2,800	92,708.00	0.01
442	605108	同庆楼	2,490	92,702.70	0.01
443	600309	万华化学	1,000	92,650.00	0.01
444	300798	锦鸡股份	13,600	92,480.00	0.01
445	301090	华润材料	9,100	91,546.00	0.01
446	001289	龙源电力	5,000	91,350.00	0.01
447	301039	中集车辆	11,400	90,858.00	0.01
448	000913	钱江摩托	4,900	90,552.00	0.01
449	688556	高测股份	1,200	90,024.00	0.01

450	688707	振华新材	2,000	89,900.00	0.01
451	600665	天地源	24,300	89,667.00	0.01
452	688215	瑞晟智能	2,900	89,175.00	0.01
453	301092	争光股份	3,300	88,902.00	0.01
454	301158	德石股份	5,600	88,760.00	0.01
455	603668	天马科技	4,900	87,808.00	0.01
456	603326	我乐家居	11,000	87,780.00	0.01
457	605296	神农集团	3,500	87,605.00	0.01
458	002965	祥鑫科技	1,500	87,315.00	0.01
459	301089	拓新药业	1,200	86,400.00	0.00
460	301086	鸿富瀚	1,500	85,695.00	0.00
461	605111	新洁能	1,100	85,338.00	0.00
462	688722	同益中	4,700	84,882.00	0.00
463	688520	神州细胞	1,400	84,840.00	0.00
464	831856	浩淼科技	16,000	84,480.00	0.00
465	300989	蕾奥规划	4,500	84,375.00	0.00
466	688677	海泰新光	740	83,620.00	0.00
467	300963	中洲特材	5,500	83,490.00	0.00
468	688252	天德钰	5,201	82,071.78	0.00
469	301103	何氏眼科	2,600	81,952.00	0.00
470	603639	海利尔	3,200	81,728.00	0.00
471	605488	福莱新材	6,100	81,496.00	0.00
472	688092	爱科科技	3,500	81,270.00	0.00
473	688597	煜邦电力	5,394	81,125.76	0.00
474	688655	迅捷兴	7,085	81,123.25	0.00
475	688575	亚辉龙	4,100	80,565.00	0.00
476	300977	深圳瑞捷	4,300	80,410.00	0.00
477	688082	盛美上海	1,004	80,219.60	0.00
478	603059	倍加洁	4,200	80,094.00	0.00
479	605298	必得科技	6,200	79,918.00	0.00
480	300923	研奥股份	4,000	79,600.00	0.00
481	688416	恒烁股份	2,147	79,460.47	0.00
482	605155	西大门	6,040	78,580.40	0.00
483	300535	达威股份	6,100	78,385.00	0.00
484	300856	科思股份	1,500	78,225.00	0.00
485	603488	展鹏科技	11,900	78,064.00	0.00
486	688223	晶科能源	5,300	77,645.00	0.00
487	301004	嘉益股份	2,600	77,428.00	0.00
488	300549	优德精密	6,300	77,112.00	0.00
489	300826	测绘股份	6,800	76,500.00	0.00
490	300897	山科智能	2,900	76,473.00	0.00
491	600995	南网储能	5,300	76,426.00	0.00
492	300948	冠中生态	6,200	76,384.00	0.00
493	600779	水井坊	900	75,978.00	0.00
494	838924	广脉科技	13,300	75,943.00	0.00
495	688350	富淼科技	4,600	75,624.00	0.00
496	688559	海目星	1,300	75,192.00	0.00
497	002937	兴瑞科技	3,300	74,745.00	0.00
498	601808	中海油服	4,500	74,610.00	0.00
499	600234	科新发展	10,700	74,579.00	0.00

500	300995	奇德新材	4,300	74,433.00	0.00
501	300684	中石科技	5,000	74,050.00	0.00
502	002085	万丰奥威	12,400	73,780.00	0.00
503	300417	南华仪器	7,600	73,720.00	0.00
504	301006	迈拓股份	4,700	73,367.00	0.00
505	002982	湘佳股份	1,700	73,134.00	0.00
506	600160	巨化股份	4,700	72,897.00	0.00
507	601163	三角轮胎	5,900	72,039.00	0.00
508	603909	建发合诚	6,700	71,690.00	0.00
509	300298	三诺生物	2,100	70,833.00	0.00
510	001301	尚太科技	1,164	68,722.56	0.00
511	601728	中国电信	16,300	68,297.00	0.00
512	301267	华夏眼科	1,006	66,597.20	0.00
513	300726	宏达电子	1,500	66,210.00	0.00
514	003036	泰坦股份	5,500	64,955.00	0.00
515	600562	国睿科技	3,800	64,410.00	0.00
516	301095	广立微	740	64,002.60	0.00
517	000630	铜陵有色	20,300	63,336.00	0.00
518	002007	华兰生物	2,700	61,101.00	0.00
519	600323	瀚蓝环境	3,300	60,918.00	0.00
520	688295	中复神鹰	1,400	60,438.00	0.00
521	300012	华测检测	2,700	60,210.00	0.00
522	600697	欧亚集团	4,300	60,114.00	0.00
523	600176	中国巨石	4,300	58,953.00	0.00
524	603886	元祖股份	3,000	58,860.00	0.00
525	300791	仙乐健康	1,600	58,832.00	0.00
526	300373	扬杰科技	1,100	57,860.00	0.00
527	601801	皖新传媒	11,000	57,310.00	0.00
528	600035	楚天高速	16,800	56,952.00	0.00
529	300494	盛天网络	3,800	56,734.00	0.00
530	300896	爱美客	100	56,635.00	0.00
531	603129	春风动力	500	56,260.00	0.00
532	300767	震安科技	1,200	56,100.00	0.00
533	600449	宁夏建材	4,700	55,789.00	0.00
534	600481	双良节能	4,300	55,642.00	0.00
535	300679	电连技术	1,500	55,500.00	0.00
536	601126	四方股份	3,800	55,480.00	0.00
537	688516	奥特维	275	55,275.00	0.00
538	002320	海峡股份	9,900	54,450.00	0.00
539	600026	中远海能	4,500	54,225.00	0.00
540	300777	中简科技	1,100	54,065.00	0.00
541	002401	中远海科	4,900	53,900.00	0.00
542	000823	超声电子	5,800	53,882.00	0.00
543	601908	京运通	8,200	53,874.00	0.00
544	301207	华兰疫苗	1,200	53,496.00	0.00
545	300042	朗科科技	4,400	53,416.00	0.00
546	600833	第一医药	4,700	53,016.00	0.00
547	002078	太阳纸业	4,600	52,992.00	0.00
548	601077	渝农商行	15,000	52,950.00	0.00
549	002467	二六三	10,600	52,682.00	0.00

550	600343	航天动力	6,000	52,500.00	0.00
551	002649	博彦科技	5,100	52,479.00	0.00
552	000933	神火股份	3,500	52,360.00	0.00
553	300149	睿智医药	5,000	52,050.00	0.00
554	600741	华域汽车	3,000	51,990.00	0.00
555	600403	大有能源	11,200	51,632.00	0.00
556	300761	立华股份	1,500	51,375.00	0.00
557	603797	联泰环保	9,300	51,336.00	0.00
558	600967	内蒙一机	6,200	51,212.00	0.00
559	688038	中科通达	4,300	51,127.00	0.00
560	688117	圣诺生物	2,300	51,106.00	0.00
561	300351	永贵电器	3,300	51,051.00	0.00
562	002993	奥海科技	1,500	51,015.00	0.00
563	600713	南京医药	9,900	50,688.00	0.00
564	000532	华金资本	4,700	50,619.00	0.00
565	002605	姚记科技	3,600	50,580.00	0.00
566	603079	圣达生物	4,000	50,200.00	0.00
567	300863	卡倍亿	600	50,112.00	0.00
568	600207	安彩高科	8,000	50,000.00	0.00
569	000400	许继电气	2,500	49,925.00	0.00
570	002360	同德化工	7,100	49,913.00	0.00
571	601928	凤凰传媒	6,300	49,896.00	0.00
572	300504	天邑股份	3,100	49,755.00	0.00
573	002130	沃尔核材	7,700	49,665.00	0.00
574	002869	金溢科技	2,300	49,496.00	0.00
575	688337	普源精电	500	48,845.00	0.00
576	600219	南山铝业	14,900	48,723.00	0.00
577	300124	汇川技术	700	48,650.00	0.00
578	600096	云天化	2,300	48,392.00	0.00
579	600525	长园集团	10,300	48,204.00	0.00
580	300400	劲拓股份	2,900	47,618.00	0.00
581	000498	山东路桥	6,900	47,403.00	0.00
582	603681	永冠新材	2,200	47,036.00	0.00
583	002957	科瑞技术	3,100	46,903.00	0.00
584	300598	诚迈科技	1,000	46,760.00	0.00
585	688518	联赢激光	1,600	46,736.00	0.00
586	002279	久其软件	6,600	46,596.00	0.00
587	603011	合锻智能	5,700	46,569.00	0.00
588	301308	江波龙	819	46,453.68	0.00
589	605056	咸亨国际	3,800	46,398.00	0.00
590	600173	卧龙地产	8,900	46,102.00	0.00
591	300990	同飞股份	500	45,940.00	0.00
592	000551	创元科技	5,300	45,421.00	0.00
593	605365	立达信	2,800	45,024.00	0.00
594	603590	康辰药业	1,800	44,892.00	0.00
595	002141	贤丰控股	11,100	44,622.00	0.00
596	603040	新坐标	2,600	44,408.00	0.00
597	603399	吉翔股份	3,200	44,160.00	0.00
598	603906	龙蟠科技	1,900	43,985.00	0.00
599	600658	电子城	11,100	43,290.00	0.00

600	000810	创维数字	3,100	43,214.00	0.00
601	601137	博威合金	2,900	42,949.00	0.00
602	301327	华宝新能	242	42,826.74	0.00
603	300207	欣旺达	2,000	42,300.00	0.00
604	605116	奥锐特	1,700	41,973.00	0.00
605	300507	苏奥传感	7,500	41,700.00	0.00
606	603871	嘉友国际	1,700	38,420.00	0.00
607	603277	银都股份	2,300	37,789.00	0.00
608	300570	太辰光	2,600	37,596.00	0.00
609	600281	华阳新材	7,700	34,111.00	0.00
610	301165	锐捷网络	1,077	34,043.97	0.00
611	603323	苏农银行	7,100	33,299.00	0.00
612	688658	悦康药业	1,700	32,844.00	0.00
613	600577	精达股份	7,300	30,952.00	0.00
614	688599	天合光能	478	30,477.28	0.00
615	301302	华如科技	466	29,837.98	0.00
616	300224	正海磁材	2,300	28,819.00	0.00
617	002832	比音勒芬	1,100	28,171.00	0.00
618	600795	国电电力	6,400	27,328.00	0.00
619	600051	宁波联合	3,600	27,144.00	0.00
620	301356	天振股份	614	26,604.62	0.00
621	002946	新乳业	1,900	25,137.00	0.00
622	301195	北路智控	330	24,103.20	0.00
623	688261	东微半导	100	23,700.00	0.00
624	002906	华阳集团	700	23,254.00	0.00
625	300034	钢研高纳	500	22,920.00	0.00
626	301389	隆扬电子	1,269	21,776.04	0.00
627	301330	熵基科技	694	21,729.14	0.00
628	601999	出版传媒	3,200	20,960.00	0.00
629	301152	天力锂能	433	20,195.12	0.00
630	301391	卡莱特	247	19,999.59	0.00
631	600720	祁连山	2,000	19,860.00	0.00
632	688408	中信博	200	19,680.00	0.00
633	301286	侨源股份	784	19,372.64	0.00
634	002529	海源复材	1,100	19,118.00	0.00
635	688122	西部超导	200	18,938.00	0.00
636	301349	信德新材	180	18,633.60	0.00
637	600830	香溢融通	2,900	18,270.00	0.00
638	600452	涪陵电力	1,200	18,120.00	0.00
639	000768	中航西飞	700	17,815.00	0.00
640	600760	中航沈飞	300	17,589.00	0.00
641	301171	易点天下	985	17,454.20	0.00
642	301363	美好医疗	445	16,843.25	0.00
643	300395	菲利华	300	16,500.00	0.00
644	301115	建科股份	685	16,467.40	0.00
645	300443	金雷股份	400	16,112.00	0.00
646	000738	航发控制	600	15,384.00	0.00
647	002013	中航机电	1,500	15,075.00	0.00
648	600662	外服控股	2,500	14,925.00	0.00
649	301223	中荣股份	815	14,775.95	0.00

650	000422	湖北宜化	1,000	14,710.00	0.00
651	301328	维峰电子	191	14,699.36	0.00
652	301121	紫建电子	290	14,433.30	0.00
653	600372	中航电子	900	14,373.00	0.00
654	301139	元道通信	566	14,325.46	0.00
655	301335	天元宠物	420	14,204.40	0.00
656	002985	北摩高科	305	13,755.50	0.00
657	301377	鼎泰高科	770	13,575.10	0.00
658	600862	中航高科	600	13,374.00	0.00
659	688033	天宜上佳	600	13,062.00	0.00
660	301230	泓博医药	269	12,998.08	0.00
661	002851	麦格米特	500	12,980.00	0.00
662	603667	五洲新春	969	12,897.39	0.00
663	300416	苏试试验	420	12,663.00	0.00
664	301396	宏景科技	396	12,632.40	0.00
665	301338	凯格精机	257	12,590.43	0.00
666	301280	珠城科技	279	12,499.20	0.00
667	300118	东方日升	500	12,410.00	0.00
668	603985	恒润股份	500	12,350.00	0.00
669	301365	矩阵股份	516	12,316.92	0.00
670	301366	一博科技	268	12,084.12	0.00
671	301283	聚胶股份	235	12,081.35	0.00
672	300424	航新科技	1,000	11,800.00	0.00
673	603105	芯能科技	800	11,784.00	0.00
674	301132	满坤科技	468	11,456.64	0.00
675	301277	新天地	439	11,317.42	0.00
676	600150	中国船舶	500	11,140.00	0.00
677	301379	天山电子	449	11,058.87	0.00
678	002196	方正电机	1,500	10,890.00	0.00
679	688676	金盘科技	300	10,854.00	0.00
680	301306	西测测试	255	10,783.95	0.00
681	301220	亚香股份	285	10,496.55	0.00
682	301273	瑞晨环保	277	10,467.83	0.00
683	603583	捷昌驱动	400	10,224.00	0.00
684	688123	聚辰股份	100	10,120.00	0.00
685	301265	华新环保	819	9,336.60	0.00
686	688112	鼎阳科技	100	9,325.00	0.00
687	301176	逸豪新材	544	9,188.16	0.00
688	301318	维海德	206	8,598.44	0.00
689	301326	捷邦科技	227	8,312.74	0.00
690	301125	腾亚精工	327	7,877.43	0.00
691	301398	星源卓镁	255	7,379.70	0.00
692	301313	凡拓数创	247	7,197.58	0.00
693	301276	嘉曼服饰	303	6,850.83	0.00
694	301388	欣灵电气	292	6,307.20	0.00
695	301368	丰立智能	337	6,241.24	0.00
696	301319	唯特偶	115	6,126.05	0.00
697	301270	汉仪股份	210	5,957.70	0.00
698	301309	万得凯	228	5,576.88	0.00
699	301316	慧博云通	359	5,140.88	0.00

700	600526	菲达环保	900	4,851.00	0.00
701	300134	大富科技	100	776.00	0.00
702	601991	大唐发电	100	279.00	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 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	55,310,066.00	2.68
2	300750	宁德时代	36,103,930.23	1.75
3	300124	汇川技术	34,539,675.39	1.67
4	601166	兴业银行	26,594,719.00	1.29
5	601318	中国平安	19,879,168.00	0.96
6	300390	天华超净	19,236,243.71	0.93
7	600036	招商银行	18,473,322.00	0.90
8	603259	药明康德	17,627,437.88	0.85
9	601012	隆基绿能	17,432,351.03	0.85
10	600438	通威股份	14,649,644.47	0.71
11	300244	迪安诊断	13,841,753.03	0.67
12	600887	伊利股份	13,696,902.00	0.66
13	300529	健帆生物	13,624,851.00	0.66
14	601899	紫金矿业	13,462,905.83	0.65
15	300760	迈瑞医疗	13,057,738.00	0.63
16	600900	长江电力	12,931,707.00	0.63
17	000333	美的集团	12,600,262.00	0.61
18	600873	梅花生物	12,426,993.90	0.60
19	000858	五粮液	12,237,981.05	0.59
20	300363	博腾股份	11,015,071.00	0.53

注：“买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 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	48,611,452.00	2.36
2	300124	汇川技术	36,436,758.12	1.77
3	300750	宁德时代	30,317,565.00	1.47
4	601166	兴业银行	23,172,542.30	1.12
5	300390	天华超净	20,183,332.00	0.98
6	601318	中国平安	20,048,531.01	0.97
7	600887	伊利股份	16,232,914.00	0.79
8	600036	招商银行	15,849,472.42	0.77
9	601012	隆基绿能	15,455,291.94	0.75
10	603259	药明康德	14,580,367.29	0.71
11	300529	健帆生物	13,318,972.24	0.65

12	600438	通威股份	12,910,747.00	0.63
13	300244	迪安诊断	12,592,059.37	0.61
14	601899	紫金矿业	12,187,786.25	0.59
15	300122	智飞生物	12,091,292.00	0.59
16	000858	五粮液	12,017,844.51	0.58
17	000333	美的集团	11,526,162.00	0.56
18	600900	长江电力	11,316,829.00	0.55
19	300832	新产业	11,110,025.30	0.54
20	002129	TCL 中环	11,091,616.00	0.54

注：“卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	2,838,831,578.72
卖出股票收入（成交）总额	2,730,591,665.12

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。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	64,393,448.21	3.70
2	央行票据	-	-
3	金融债券	799,152,106.66	45.94
	其中：政策性金融债	304,182,217.35	17.49
4	企业债券	221,487,121.71	12.73
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	119,037,940.23	6.84
7	可转债（可交换债）	18,518,311.66	1.06
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,222,588,928.47	70.28

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	2020016	20 江苏银行永续债	1,300,000	133,848,534.25	7.69
2	2020002	20 杭州银行永续债	1,150,000	120,423,652.05	6.92
3	018009	国开 1803	912,230	107,126,842.82	6.16
4	190311	19 进出 11	900,000	91,492,052.05	5.26
5	2020065	20 徽商银行	500,000	51,288,493.15	2.95

		二级 01			
--	--	-------	--	--	--

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末无股指期货投资。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末无国债期货投资。

8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货投资。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国进出口银行、中国农业发展银行、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。

8.12.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	270,657.00
2	应收清算款	11,048,943.08
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,022,711.81
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	12,342,311.89

8.12.4 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	18,208,622.11	1.05
2	118009	华锐转债	2,785.51	0.00
3	127061	美锦转债	212.98	0.00

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
华夏睿磐泰茂混合 A	27,559	37,096.38	891,611,294.94	87.21%	130,727,776.17	12.79%
华夏睿磐泰茂混合 C	34,576	10,525.21	248,919,922.96	68.40%	114,999,630.71	31.60%
合计	62,135	22,310.43	1,140,531,217.90	82.27%	245,727,406.88	17.73%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	华夏睿磐泰茂混合 A	47,002.30	0.00%
	华夏睿磐泰茂混合 C	94,539.42	0.03%
	合计	141,541.72	0.01%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和相关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

§10 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	1,134,770,233.21	937,793,263.34
减：本报告期基金总赎回份额	1,014,410,732.83	1,267,614,467.47
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,022,339,071.11	363,919,553.67

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，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。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期应支付给安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为 80,000 元人民币。截至本报告期末，该事务所已向本基金提供 5 年的审计服务。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人及其高级管理人员在本报告期内无受稽查或处罚等情况。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易	股票交易	应支付该券商的佣金	备注
------	----	------	-----------	----

	单元数量	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	
方正证券	2	1,769,546,656.47	32.03%	763,217.30	21.12%	-
中泰证券	1	566,953,321.22	10.26%	414,616.38	11.48%	-
广发证券	1	454,854,052.73	8.23%	332,635.69	9.21%	-
平安证券	1	386,213,902.94	6.99%	166,574.16	4.61%	-
申万宏源证券	2	356,467,218.96	6.45%	331,979.34	9.19%	-
华泰证券	1	338,279,431.21	6.12%	315,046.29	8.72%	-
粤开证券	1	272,576,955.04	4.93%	199,333.55	5.52%	-
东吴证券	2	265,760,088.42	4.81%	194,351.86	5.38%	-
光大证券	1	240,881,435.69	4.36%	224,331.77	6.21%	-
国盛证券	1	230,006,102.34	4.16%	168,202.19	4.66%	-
长江证券	2	196,545,330.72	3.56%	175,954.13	4.87%	-
华创证券	1	187,128,192.75	3.39%	136,849.29	3.79%	-
渤海证券	1	125,159,918.21	2.27%	91,530.05	2.53%	-
海通证券	2	102,343,314.80	1.85%	74,843.95	2.07%	-
东海证券	1	32,285,429.16	0.58%	23,609.91	0.65%	-
华西证券	1	156,738.49	0.00%	-	-	-

注：①为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择券商的标准，即：

i 经营行为规范。

ii 公司财务状况良好。

iii有良好的内控制度，在业内有良好的声誉。

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

v 建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯和服务。

②券商专用交易单元选择程序：

i 本基金管理人根据上述标准进行评估并确定选用的券商。

ii 本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议/证券经纪服务协议。

③除本表列示外，本基金还选择了安信证券、财信证券、诚通证券、东北证券、东方财富证券、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在上述租用的券商交易单元中，东海证券的交易单元为本基金本期新增的交易单元。本期没有剔除的券商交易单元。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
方正证券	156,633,969.25	19.38%	474,500,000.00	3.85%	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	17,654,537.20	2.18%	100,000,000.00	0.81%	-	-	-	-
平安证券	-	-	1,176,700,000.00	9.56%	-	-	-	-
申万宏源证券	267,274,735.80	33.07%	983,600,000.00	7.99%	-	-	-	-
华泰证券	7,300,061.50	0.90%	2,862,892,000.00	23.25%	-	-	-	-
粤开证券	96,027,774.11	11.88%	1,157,000,000.00	9.40%	-	-	-	-
东吴证券	62,987,345.81	7.79%	3,596,500,000.00	29.21%	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证券	97,906,282.60	12.11%	1,540,000,000.00	12.51%	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华创证券	53,514,347.93	6.62%	140,000,000.00	1.14%	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	18,029,298.33	2.23%	-	-	-	-	-	-
东海证券	10,838,355.48	1.34%	282,000,000.00	2.29%	-	-	-	-
华西证券	20,155,540.00	2.49%	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华夏基金管理有限公司关于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	中国证监会指定报刊及	2022-06-18

	方承销证券的公告	网站	
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	2022-07-07
16	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	2022-07-23
17	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	2022-07-30
18	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	2022-08-06
19	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	2022-08-10
20	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	2022-08-12
21	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	2022-08-13
22	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	2022-08-19
23	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	2022-09-01
24	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	2022-09-22
25	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	2022-10-14
26	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	2022-10-20
27	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	2022-10-22
28	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	2022-11-05
29	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	2022-11-12
30	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	2022-11-16
31	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	2022-11-26
32	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	2022-11-30
33	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	2022-12-16
34	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资非公开发行股票的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-12-17
35	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	2022-12-20
36	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	2022-12-23
37	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	2022-12-24

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2022-12-06至 2022-12-31	-	354,100,800.14	-	354,100,800.14	25.54%
产品特有风险							
本基金在报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额20%的情形，在市场流动性不足的情况下，如遇投资者巨额赎回或集中赎回，基金管理人可能无法以合理的价格及时变现基金资产，有可能对基金净值产生一定的影响，甚至可能引发基金的流动性风险。 在特定情况下，若持有基金份额占比较高的投资者大量赎回本基金，可能导致在其赎回后本基金资产规模持续低于正常运作水平，面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。							

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予基金注册的文件；
- 2、《华夏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。

13.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

13.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的住所免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

二〇二三年三月三十日