

华夏创新研选混合型证券投资基金

2023 年第 2 季度报告

2023 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：浙商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二三年七月二十日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人浙商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 7 月 18 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华夏创新研选混合
基金主代码	015227
交易代码	015227
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2022 年 8 月 23 日
报告期末基金份额总额	187,169,006.01 份
投资目标	在合理控制风险的前提下，力求实现基金资产的稳健增值，获取长期稳定的投资回报。
投资策略	<p>本基金的投资策略包括资产配置策略、股票投资策略、固定收益品种投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略、股票期权投资策略等。</p> <p>股票投资策略部分，在我国经济结构调整、产业优化转型背景下，本基金重点关注创新所带来的发展机遇，主要投资于能够创造新技术、新工艺和新产品，采用新的生产方式和管理机制，开发新领域并提供新服务，在市场竞争中掌握主动权的优质上市公司。在对个股进行持续、深入、全面研究的基础上，本基金主要从技术创新、管理机制创新、商业模式创新维度筛选投资标的。</p>
业绩比较基准	中证 800 指数收益率×60%+中证港股通综合指数收益率×20%+上证国债指数收益率×20%。
风险收益特征	<p>本基金为混合型基金，60%-95%的基金资产投资于股票，其预期风险和预期收益低于股票基金，高于普通债券基金与货币市场基金。</p> <p>本基金还可通过港股通渠道投资于香港证券市场，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还将面临汇率风险、香港市场风险等特殊投资风险。</p>

基金管理人	华夏基金管理有限公司	
基金托管人	浙商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	华夏创新研选混合 A	华夏创新研选混合 C
下属分级基金的交易代码	015227	015228
报告期末下属分级基金的份额总额	81,710,815.66 份	105,458,190.35 份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期	
	(2023 年 4 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)	
	华夏创新研选混合 A	华夏创新研选混合 C
1. 本期已实现收益	-3,049,954.49	-4,205,735.65
2. 本期利润	-9,766,199.15	-13,981,538.82
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.1180	-0.1243
4. 期末基金资产净值	86,074,985.17	110,614,044.87
5. 期末基金份额净值	1.0534	1.0489

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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

华夏创新研选混合A:

阶段	净值增长	净值增长	业绩比较	业绩比较	①-③	②-④
----	------	------	------	------	-----	-----

	率①	率标准差 ②	基准收益 率③	基准收益 率标准差 ④		
过去三个月	-10.06%	1.12%	-3.08%	0.65%	-6.98%	0.47%
过去六个月	-3.78%	1.18%	0.28%	0.65%	-4.06%	0.53%
自基金合 同生效起 至今	5.34%	1.12%	-3.66%	0.80%	9.00%	0.32%

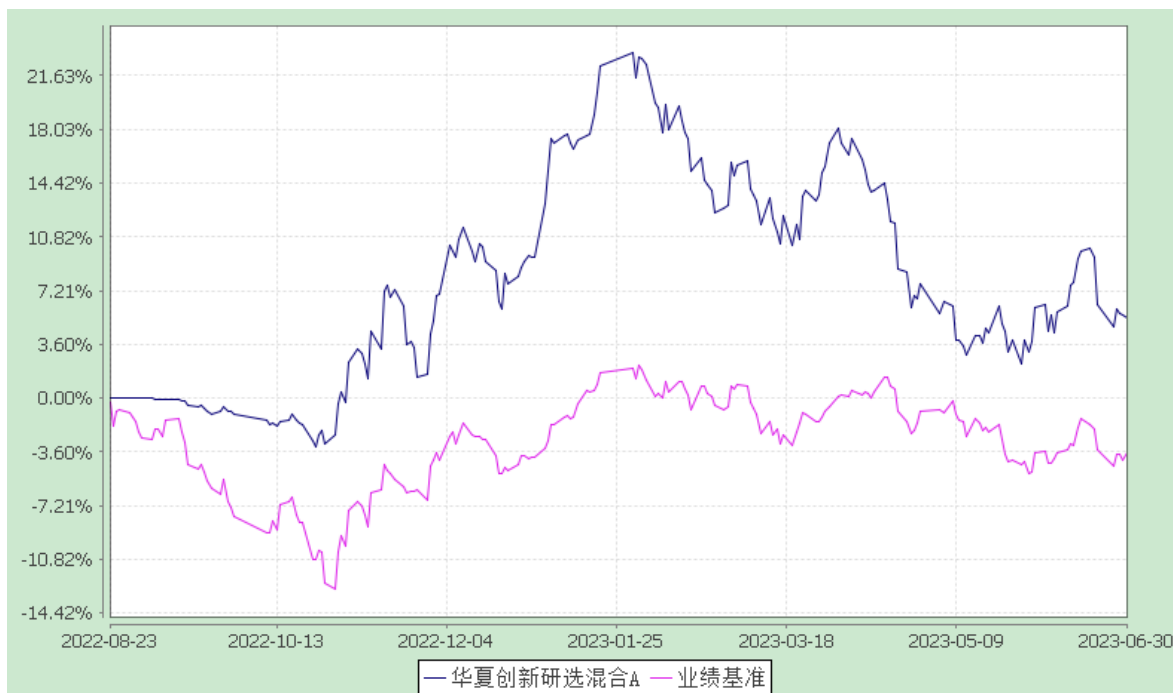
华夏创新研选混合C:

阶段	净值增长 率①	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	-10.18%	1.13%	-3.08%	0.65%	-7.10%	0.48%
过去六个月	-4.02%	1.18%	0.28%	0.65%	-4.30%	0.53%
自基金合 同生效起 至今	4.89%	1.12%	-3.66%	0.80%	8.55%	0.32%

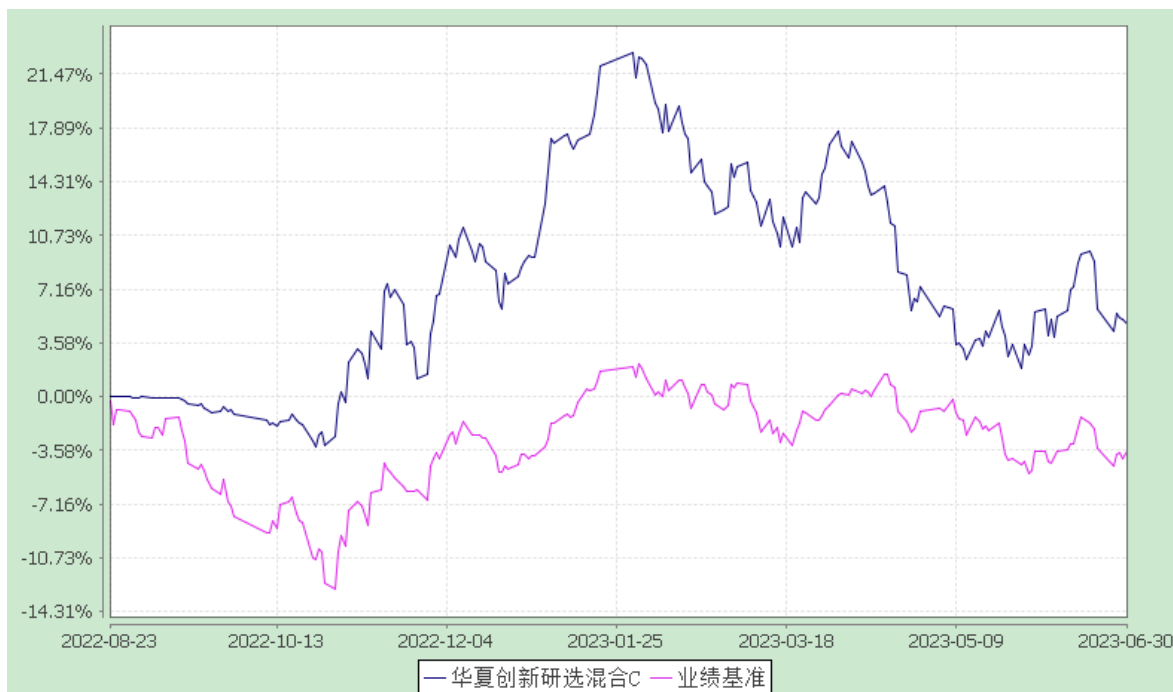
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华夏创新研选混合型证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2022 年 8 月 23 日至 2023 年 6 月 30 日)

华夏创新研选混合 A:



华夏创新研选混合 C:



注：①本基金合同于 2022 年 8 月 23 日生效。

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

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
叶力舟	本基金的基金经理	2022-08-23	-	8 年	硕士。2015 年 7 月加入华夏基金管理有限公司。历任投资研究部研究员、基金经理助理。
屠环宇	本基金的基金经理	2022-08-23	-	8 年	硕士。2015 年 7 月加入华夏基金管理有限公司。历任投资研究部研究员、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 公平交易专项说明

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，本公司严格执行了《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 61 次，均为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

今年 2 季度以来权益市场整体呈现出收益率波动大、行业风格轮动快的特征，其主要原因系短期经济数据波动和政策预期变化所致；同时港股市场由于受到海外加息所导致的流动性和汇率冲击，承受了风险偏好进一步下降所带来股价压力。从具体行业方向来看，与宏观经济景气度相关度比较高的顺周期行业和公司整体承压，而包括人工智能在内的具备产业创新驱动力细分方向的早期主题类投资，贡献了比较好的阶段性收益。

从本产品的投资布局来看，仍然聚焦投资于科技赛道中掌握核心技术环节的优质标的，我们相信全年的投资主线仍是在成长赛道中选择能实现产品突破、业绩突破的好公司。具体来说，我们投资于科技软件硬件、互联网、先进制造、现代服务业四大行业，并在以下三大方向上进行重点布局：1) 前沿技术能力储备丰富+供需环境改善、盈利能力显著提升的互联网优质平台；2) 具备 AI 数字化场景落地能力的优质软件公司；3) 具备核心技术环节突破机遇的科技硬件和医疗器械企业。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2023 年 6 月 30 日，华夏创新研选混合 A 基金份额净值为 1.0534 元，本报告期份额净值增长率为-10.06%；华夏创新研选混合 C 基金份额净值为 1.0489 元，本报告期份额净值增长率为-10.18%，同期业绩比较基准增长率为-3.08%。

4.5 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	171,009,878.39	86.14
	其中：股票	171,009,878.39	86.14
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-

	其中：债券	-	-
	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	27,305,365.03	13.75
8	其他资产	213,928.03	0.11
9	合计	198,529,171.45	100.00

注：本基金本报告期末通过港股通机制投资香港股票的公允价值为 78,333,668.59 元，占基金资产净值比例为 39.83%。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	52,368,586.00	26.63
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	1,804,960.00	0.92
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	32,513,561.40	16.53
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	572,994.00	0.29
M	科学研究和技术服务业	2,236,270.00	1.14
N	水利、环境和公共设施管理业	4,506.40	0.00

O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	2,149,032.00	1.09
R	文化、体育和娱乐业	1,026,300.00	0.52
S	综合	-	-
	合计	92,676,209.80	47.12

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
通讯服务	40,829,856.64	20.76
非必需消费品	21,347,486.20	10.85
信息技术	12,318,454.92	6.26
金融	2,336,297.32	1.19
必需消费品	1,501,573.51	0.76
保健	-	-
材料	-	-
房地产	-	-
工业	-	-
公用事业	-	-
能源	-	-
合计	78,333,668.59	39.83

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	01024	快手—W	370,800	18,307,148.35	9.31
2	00700	腾讯控股	58,800	17,976,839.80	9.14
3	03690	美团—W	149,460	16,852,833.70	8.57
4	688389	普门科技	255,555	6,002,986.95	3.05
5	601728	中国电信	1,060,400	5,970,052.00	3.04
6	002698	博实股份	281,200	4,918,188.00	2.50
7	00268	金蝶国际	509,000	4,918,136.35	2.50
8	688031	星环科技	34,307	4,571,064.68	2.32
9	01211	比亚迪股份	19,500	4,494,652.50	2.29
10	002371	北方华创	13,600	4,320,040.00	2.20

注：所用证券代码采用当地市场代码。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.5 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无股指期货投资。

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无国债期货投资。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 报告期内，本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求，未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）

1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	18,000.00
4	应收利息	-
5	应收申购款	195,928.03
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	213,928.03

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告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。

5.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华夏创新研选混合A	华夏创新研选混合C
本报告期期初基金份额总额	83,575,535.29	116,597,426.66
报告期间基金总申购份额	4,645,373.88	27,193,783.64
减：报告期间基金总赎回份额	6,510,093.51	38,333,019.95
报告期间基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	81,710,815.66	105,458,190.35

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

1、报告期内披露的主要事项

2023 年 4 月 6 日发布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。

2、其他相关信息

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、保险资金投资管理资格、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。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予基金注册的文件；
- 2、《华夏创新研选混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《华夏创新研选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。

9.2 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。

9.3 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

二〇二三年七月二十日