

华夏新锦汇灵活配置混合型证券投资基金

2023 年中期报告

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：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二三年八月三十日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 8 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	1
§2 基金简介.....	3
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	4
3.1 主要会计数据和财务指标.....	4
3.2 基金净值表现.....	5
§4 管理人报告.....	6
§5 托管人报告.....	11
§6 中期报告财务会计报告（未经审计）.....	12
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	13
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	14
6.4 报表附注.....	16
§7 投资组合报告.....	32
7.1 期末基金资产组合情况.....	33
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	33
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	34
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	35
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	48
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	49
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	49
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	49
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	49
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	49
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	49
7.12 投资组合报告附注.....	49
§8 基金份额持有人信息.....	50
§9 开放式基金份额变动.....	51
§10 重大事件揭示.....	51
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	54
§12 备查文件目录.....	54

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华夏新锦汇灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	华夏新锦汇混合	
基金主代码	004048	
交易代码	004048	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017年3月8日	
基金管理人	华夏基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	60,784,226.64 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华夏新锦汇混合 A	华夏新锦汇混合 C
下属分级基金的交易代码	004048	004049
报告期末下属分级基金的份额总额	4,677,799.50 份	56,106,427.14 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在控制风险的前提下，把握市场机会，追求资产的稳健增值。
投资策略	主要投资策略包括资产配置策略、股票投资策略、固定收益品种投资策略、资产支持证券投资策略、权证投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略、股票期权投资策略等。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×50%+上证国债指数收益率×50%。
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	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	王小飞
	联系电话	021-6063 7103
	电子邮箱	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话	400-818-6666	021-60637228
传真	010-63136700	021-60635778
注册地址	北京市顺义区安庆大街甲3号院	北京市西城区金融大街25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	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码	100033	100033

法定代表人	杨明辉	田国立
-------	-----	-----

2.5 信息披露方式

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

2.6 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	华夏基金管理有限公司	北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 8 层

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日）	
	华夏新锦汇混合 A	华夏新锦汇混合 C
本期已实现收益	-224,244.11	-4,908,676.35
本期利润	-168,874.37	-4,584,689.08
加权平均基金份额本期利润	-0.0581	-0.0943
本期加权平均净值利润率	-6.60%	-10.48%
本期基金份额净值增长率	-8.85%	-8.91%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)	
	华夏新锦汇混合 A	华夏新锦汇混合 C
期末可供分配利润	-630,739.02	-8,226,906.04
期末可供分配基金份额利润	-0.1348	-0.1466
期末基金资产净值	4,061,528.16	49,055,843.00
期末基金份额净值	0.8683	0.8743
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)	
	华夏新锦汇混合 A	华夏新锦汇混合 C
基金份额累计净值增长率	7.33%	-15.61%

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

华夏新锦汇混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-0.24%	0.20%	0.81%	0.43%	-1.05%	-0.23%
过去三个月	-1.61%	0.19%	-1.87%	0.41%	0.26%	-0.22%
过去六个月	-8.85%	0.41%	0.79%	0.42%	-9.64%	-0.01%
过去一年	-20.45%	0.47%	-5.44%	0.49%	-15.01%	-0.02%
过去三年	-11.86%	0.36%	2.62%	0.60%	-14.48%	-0.24%
自基金合同生效起至今	7.33%	0.30%	22.12%	0.60%	-14.79%	-0.30%

华夏新锦汇混合 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-0.25%	0.20%	0.81%	0.43%	-1.06%	-0.23%
过去三个月	-1.64%	0.19%	-1.87%	0.41%	0.23%	-0.22%
过去六个月	-8.91%	0.41%	0.79%	0.42%	-9.70%	-0.01%
2022 年 8 月 11 日起至今	-15.61%	0.46%	-1.51%	0.50%	-14.10%	-0.04%

注：2017 年 3 月 8 日至 2020 年 8 月 10 日，2022 年 2 月 17 日至 2022 年 3 月 27 日，2022 年 4 月 27 日至 2022 年 6 月 16 日，2022 年 7 月 6 日至 2022 年 8 月 10 日期间，华夏新锦汇混合 C 类基金份额为零。

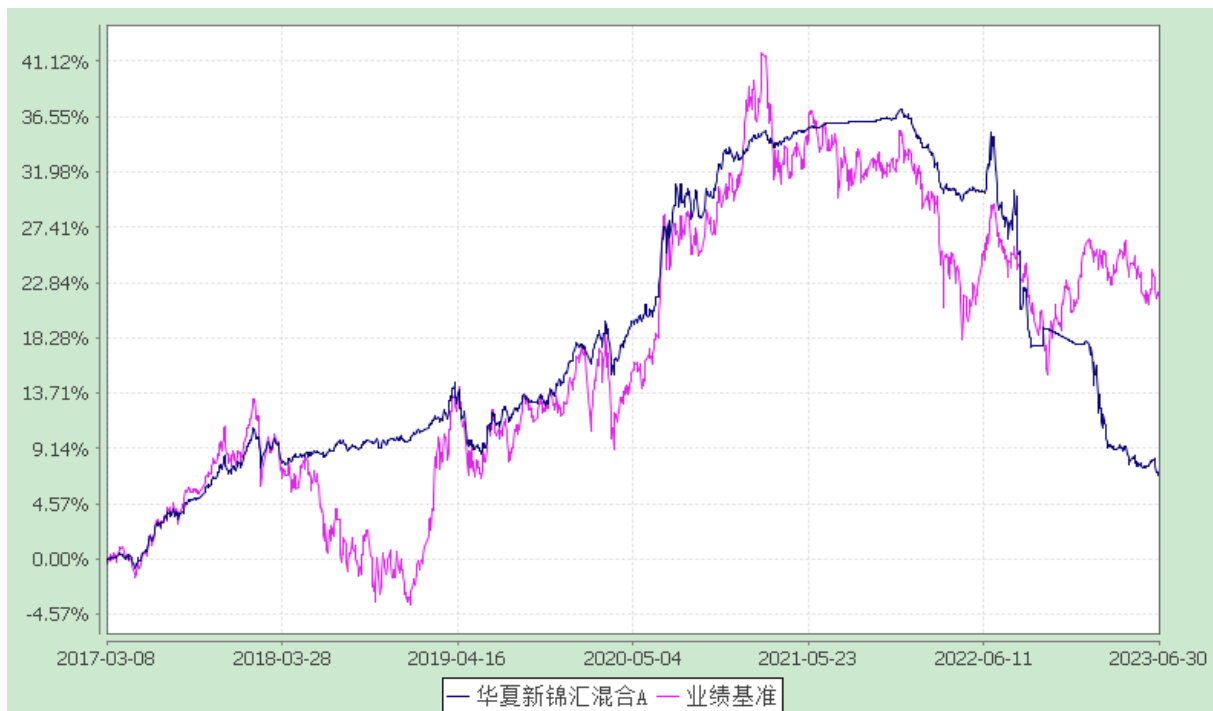
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华夏新锦汇灵活配置混合型证券投资基金

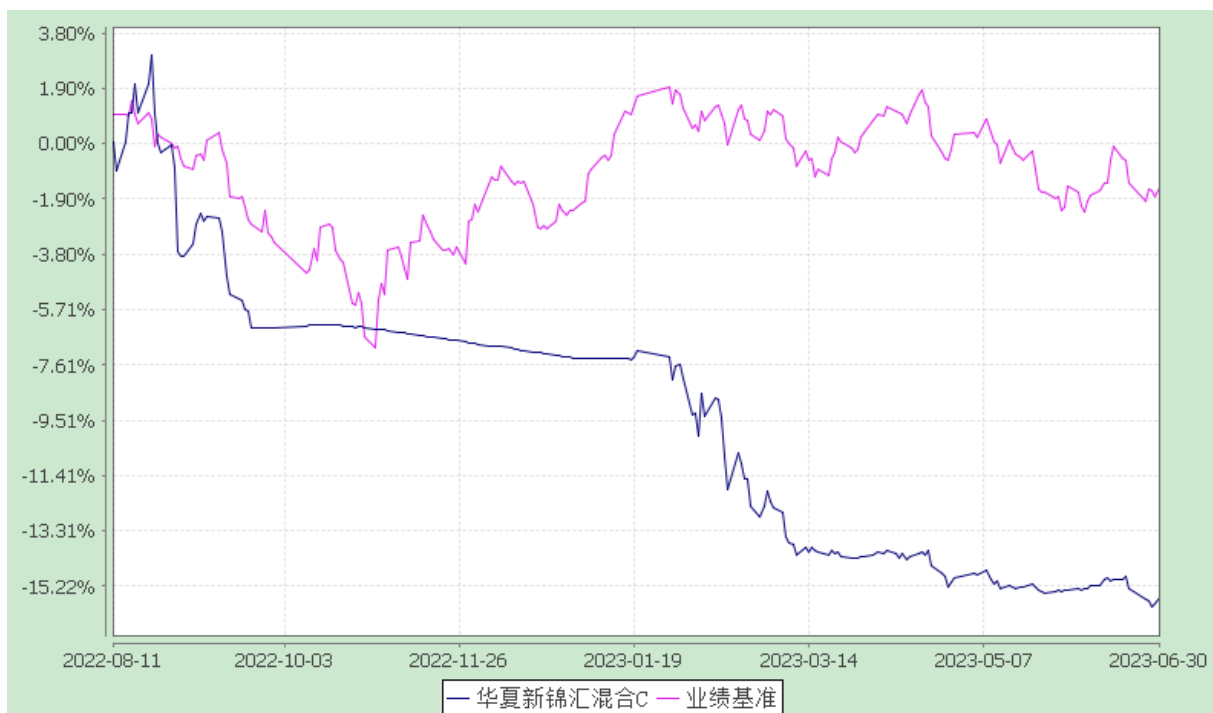
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2017 年 3 月 8 日至 2023 年 6 月 30 日)

华夏新锦汇混合 A



华夏新锦汇混合 C



注：2017年3月8日至2020年8月10日，2022年2月17日至2022年3月27日，2022年4月27日至2022年6月16日，2022年7月6日至2022年8月10日期间，华夏新锦汇混合C类基金份额为零。

§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、青岛、武汉、沈阳设有分公司,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、SmartBeta 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 2023 年 6 月 30 日,华夏基金旗下多只产品近 1 年同类排名领先(基金排名不作为产品未来表现的保证),其中:

主动权益产品:在养老目标风险 FOF(权益资产 0-30%)(A 类)中,华夏保守养老一年持有混合(FOF)(A 类)排名第 1/59;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 1/22;在汽车主题行业偏股型基金(A 类)中,华夏新能源车龙头混合发起式(A 类)排名第 1/11;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 2/66、华夏新兴消费混合(A 类)排名第 9/66;在 QDII 混合基金(A 类)中,华夏全球科技先锋混合(QDII)排名第 3/43;在偏债型基金(A 类)中,华夏磐泰混合(LOF)(A 类)排名前 2%(13/619)、华夏睿磐泰盛混合排名前 3%(19/619)、华夏永利一年持有混合(A 类)排名前 10%(61/619);在灵活配置型基金(基准股票比例 30%-60%)(A 类)中,华夏稳增混合排名前 3%(14/440)、华夏新锦绣混合(A 类)排名前 4%(18/440);在标准股票型基金(A 类)中,华夏智胜先锋股票(LOF)(A 类)排名前 4%(13/317)、华夏智胜价值成长股票(A 类)排名前 6%(20/317);在偏股型基金(股票上限 95%)(A 类)中,华夏磐利一年定开混合(A 类)排名前 5%(11/214)、华夏磐锐一

年定开混合(A类)排名前 10%(21/214); 在偏股型基金(股票上下限 60%-95%)(A类)中, 华夏核心制造混合(A类)排名前 9%(126/1403)、华夏价值精选混合排名前 9%(133/1403)。

固收与固收+产品: 在 QDII 债券型基金(A类)中, 华夏大中华信用债券 (QDII) (A类)排名第 1/24、华夏收益债券 (QDII) (A类)排名第 3/24; 在短期纯债债券型基金(A类)中, 华夏 30 天滚动短债债券发起式(A类)排名第 8/108; 在长期纯债债券型基金(A类)中, 华夏鼎隆债券(A类)排名前 6%(71/1228)、华夏鼎航债券(A类)排名前 6%(76/1228)、华夏鼎英债券(A类)排名前 7%(87/1228); 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)排名前 9%(32/376); 在普通债券型基金(二级)(A类)中, 华夏恒融债券排名前 8%(30/368)。

指数与量化产品: 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 1/132、华夏中证 500 指数智选增强(A类)排名第 2/132; 在主题指数股票 ETF 联接基金(A类)中, 华夏中证动漫游戏 ETF 发起式联接(A类)排名第 1/110; 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 2/16; 在 QDII 跨境股票 ETF 基金中, 华夏纳斯达克 100ETF (QDII) 排名第 2/33、华夏野村日经 225ETF 排名第 7/33; 在 QDII 跨境股票 ETF 联接基金(A类)中, 华夏恒生 ETF 联接(A类)排名第 3/10; 在主题指数股票 ETF 基金中, 华夏中证动漫游戏 ETF 排名第 1/313、华夏中证云计算与大数据主题 ETF 排名第 6/313、华夏中证大数据产业 ETF 排名前 5%(15/313)、华夏中证文化传媒 ETF 排名前 6%(18/313)、华夏中证金融科技主题 ETF 排名前 10%(30/313); 在规模指数股票 ETF 基金中, 华夏沪港通恒生 ETF 排名第 4/136; 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 4/102; 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 6/30。

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十八届中国基金业明星基金奖评选活动中, 华夏基金凭借卓越的投资实力以及优秀的中长期业绩回报, 将两大奖项收入囊中: 公司层面, 华夏基金荣获“三年期海外投资明星基金公司”; 产品层面, 华夏沪深 300ETF 荣获“三年持续回报指数型明星基金奖”。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, 2023 年上半年, 华夏基金继续以客户需求为导向, 努力提高客户使用的便利性和服务体验: (1) 华夏基金直销渠道优化页面显示, 升级搜索及查询功能, 给客户更方便直观的使用体验; (2) 华夏基金管家客户端优化“忘记密码”功能及定投模块, 从客户投资需求出发, 进一步提升操作体验; (3) 与华润银行等代销机构合作, 拓展更加丰富的客户理财渠道; (4) 开展“帮

你问了 ChatGPT”、“华夏基金户口本”、“指数攻防值来啦！”、“亲子财商 36 计”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		
韩丽楠	本基金的 基金经理	2022-02-09	2023-04-06	13 年	硕士。曾任诺德基金管理有限公司研究员，上海元普投资管理有限公司固定收益投资总监，西部利得基金管理有限公司基金经理等。2021 年 10 月加入华夏基金管理有限公司。
胡杰	本基金的 基金经 理、投委 会成员	2023-04-06	-	19 年	硕士。曾任华润置地（上海）有限公司项目发展主管，鹏华基金管理有限公司研究总监助理。2006 年 9 月加入华夏基金管理有限公司。历任投资研究部总经理助理、基金经理助理。
胡杰	本基金的 基金经理 助理	2023-01-17	2023-02-20	19 年	硕士。曾任华润置地（上海）有限公司项目发展主管，鹏华基金管理有限公司研究总监助理。2006 年 9 月加入华夏基金管理有限公司。历任投资研究部总经理助理、基金经理助理。
武文琦	本基金的 基金经理 助理	2022-12-20	2023-01-16	7 年	硕士。2016 年 7 月加入华夏基金管理有限公司。历任研究员。

注：①上述“任职日期”和“离任日期”为根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。首任基金经理的，其“任职日期”为基金合同生效日。

②证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，本基金管理人旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 90 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 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

债券市场方面，今年年初信贷表现较好，经济呈现复苏局面，但持续性存在分歧，以十年期利率为代表的长端利率债在一季度出现新高，但整体震荡为主跌幅不大；流动性总量充足但对宽信用的指向性较强，对应资金利率波动大、1 年存单收益抬升，使得曲线偏平坦、3 年以内的短期品种跟随资金利率波动。到了二季度，资金面偏宽松，央行净回笼 10790 亿元，DR007 较 3 月底下行 70bp；利率债方面，收益率曲线持续下行，短端利率下行较多；信用债方面，高等级信用债收益率持续下行，短端下行幅度大于长端。组合均衡配置了关键期限的国债，在流动性管理上，利用回购等提高资金使用效率。

股票市场方面，一季度市场经历了对经济复苏强预期向弱现实回归的波动，并在风格上出现了较大切换，政府坚持高质量发展道路，对经济只托底不刺激。操作上在 2 月增加了顺周期行业的配置，但 3 月市场热点切换较快，故降低仓位以控制市场波动风险。4-6 月经济数据持续羸弱，超出了市场的预期，因此在 TMT 大幅回调后，市场仍然选择了偏主题的方向。我们操作上，6 月进行了增仓，结构整体偏成长。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2023 年 6 月 30 日，华夏新锦汇混合 A 基金份额净值为 0.8683 元，本报告期份额净值增长率为-8.85%；华夏新锦汇混合 C 基金份额净值为 0.8743 元，本报告期份额净值增长率为-8.91%，同期业绩比较基准增长率为 0.79%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

当前宽信用政策仍处吹风阶段，并没有实际落地，因此我们当前仍假设强货币+弱信用组合，

主题投资短期内占优，机器人、信创等明确有时间节点的方向加大关注。AI 相关政策在党中央会议密集加码后，国务院和地方政府推进可能形成新的政策共振。估值角度，由于 7 月政治局会议刺激的行业（非银、地产）处于低估状态，故短期不宜过分偏离指数。随着时间的推移，我们认为，待 8-9 月库存见底后，市场宽信用预期渐起，对应配置转向可选消费（汽车、白酒、医药）、周期（有色、钢铁、化工）。短期内，政策刺激（活跃资本市场、地产）的程度、调控（医药反腐）力度等都存分歧，因此行情呈博弈状态，但齿轮已经开始转动，犹豫孕育着机会。

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

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基

金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

§6 中期报告财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华夏新锦汇灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	5,222,701.39	2,303,652.86
结算备付金		60,927.45	-
存出保证金		31,085.83	30,593.52
交易性金融资产	6.4.7.2	51,990,187.79	-
其中：股票投资		10,760,704.80	-
基金投资		-	-
债券投资		41,229,482.99	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	200,053.48
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	90,000.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		57,304,902.46	2,624,299.86
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
负债：			

短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		3,923,156.75	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		26,126.04	1,090.94
应付托管费		4,354.34	181.83
应付销售服务费		4,046.63	178.30
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	229,847.54	349,932.79
负债合计		4,187,531.30	351,383.86
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	60,784,226.64	2,368,426.22
未分配利润	6.4.7.8	-7,666,855.48	-95,510.22
净资产合计		53,117,371.16	2,272,916.00
负债和净资产总计		57,304,902.46	2,624,299.86

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，华夏新锦汇混合 A 基金份额净值 0.8683 元，华夏新锦汇混合 C 基金份额净值 0.8743 元；华夏新锦汇混合基金份额总额 60,784,226.64 份（其中 A 类 4,677,799.50 份，C 类 56,106,427.14 份）。

6.2 利润表

会计主体：华夏新锦汇灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-4,490,895.69	-307,128.93
1.利息收入		40,475.82	29,152.57
其中：存款利息收入	6.4.7.9	26,014.76	11,776.95
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		14,461.06	17,375.62
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-4,913,194.61	-2,257,292.87
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-5,174,651.81	-3,038,325.13

基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	209,450.07	693,158.50
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	-	-
股利收益	6.4.7.14	52,007.13	87,873.76
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	379,357.01	1,921,011.37
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	2,466.09	-
减：二、营业总支出		262,667.76	267,408.74
1.管理人报酬		138,985.45	154,102.41
2.托管费		23,164.25	25,683.74
3.销售服务费		21,927.27	3,025.79
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		-	1,380.03
其中：卖出回购金融资产支出		-	1,380.03
6.信用减值损失	6.4.7.17	-	-
7.税金及附加		-	-
8.其他费用	6.4.7.18	78,590.79	83,216.77
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-4,753,563.45	-574,537.67
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-4,753,563.45	-574,537.67
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-4,753,563.45	-574,537.67

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：华夏新锦汇灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益(若有)	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	2,368,426.22	-	-95,510.22	2,272,916.00
二、本期期初净资产（基金净值）	2,368,426.22	-	-95,510.22	2,272,916.00

三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	58,415,800.42	-	-7,571,345.26	50,844,455.16
（一）、综合收益总额	-	-	-4,753,563.45	-4,753,563.45
（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）	58,415,800.42	-	-2,817,781.81	55,598,018.61
其中：1.基金申购款	86,940,676.50	-	-5,784,843.75	81,155,832.75
2.基金赎回款	-28,524,876.08	-	2,967,061.94	-25,557,814.14
（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）	60,784,226.64	-	-7,666,855.48	53,117,371.16
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	53,681,307.72	-	8,432,263.57	62,113,571.29
二、本期期初净资产（基金净值）	53,681,307.72	-	8,432,263.57	62,113,571.29
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-4,034,430.50	-	-1,209,042.82	-5,243,473.32
（一）、综合收益总额	-	-	-574,537.67	-574,537.67
（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）	-4,034,430.50	-	-634,505.15	-4,668,935.65
其中：1.基金申购款	18,013,379.77	-	1,987,884.12	20,001,263.89
2.基金赎回款	-22,047,810.27	-	-2,622,389.27	-24,670,199.54
（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）	49,646,877.22	-	7,223,220.75	56,870,097.97

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：杨明辉，主管会计工作负责人：朱威，会计机构负责人：朱威

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华夏新锦汇灵活配置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[2016] 2825 号《关于准予华夏新锦汇灵活配置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》、《华夏新锦汇灵活配置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 3 月 2 日至 2017 年 3 月 3 日共募集 500,031,536.88 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_A13 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华夏新锦汇灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2017 年 3 月 8 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 500,184,322.68 份基金份额，其中认购资金利息折合 152,785.80 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，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华夏新锦汇灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板、存托凭证及其他中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、中小企业私募债券、可转换债券、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、衍生品（包括权证、股指期货、国债期货、股票期权等）、货币市场工具（含同业存单）、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布和修订的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、

《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 6.4.4 所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

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

《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 以发行基金方式募集资金不属于增值税征收范围，不征收增值税。

(2) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

(3) 基金买卖股票、债券的差价收入免征增值税，暂不征收企业所得税。

(4) 存款利息收入不征收增值税。

(5) 国债、地方政府债利息收入，金融同业往来利息收入免征增值税。

(6) 对基金取得的债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(7) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(8) 对基金在境内取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利收入时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不征收企业所得税。基金在境内从上市公司分配取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，全额计入应纳税所得额，持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，减按 50% 计入应纳税所得额，持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中国结算”）提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。对香港市场投资者取得的股息、红利收入按照 10% 的税率代扣所得税。

(9) 基金在境内卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(10) 基金在境外证券交易所进行交易或取得的源自境外证券市场的收益，其涉及的税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行。

(11) 本基金分别按实际缴纳的增值税额的 7%、3%、2% 缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	5,222,701.39
等于：本金	5,222,056.90
加：应计利息	644.49
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	5,222,701.39

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	10,716,135.17	-	10,760,704.80	44,569.63
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	394,204.79	41,229,482.99	334,787.38
	银行间市场	-	-	-
	合计	394,204.79	41,229,482.99	334,787.38
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	51,216,625.99	394,204.79	51,990,187.79	379,357.01

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 其他资产

无。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	210,011.75
其中：交易所市场	210,011.75
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	19,835.79
合计	229,847.54

6.4.7.7 实收基金

华夏新锦汇混合 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	43,506.67	43,506.67
本期申购	4,656,068.12	4,656,068.12
本期赎回（以“-”号填列）	-21,775.29	-21,775.29
本期末	4,677,799.50	4,677,799.50

华夏新锦汇混合 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	2,324,919.55	2,324,919.55
本期申购	82,284,608.38	82,284,608.38
本期赎回（以“-”号填列）	-28,503,100.79	-28,503,100.79
本期末	56,106,427.14	56,106,427.14

6.4.7.8 未分配利润

华夏新锦汇混合 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	-1,942.14	-120.75	-2,062.89
本期利润	-224,244.11	55,369.74	-168,874.37
本期基金份额交易产生的变动数	-404,552.77	-40,781.31	-445,334.08
其中：基金申购款	-407,018.47	-40,836.45	-447,854.92
基金赎回款	2,465.70	55.14	2,520.84
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-630,739.02	14,467.68	-616,271.34

华夏新锦汇混合 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	-128,454.87	35,007.54	-93,447.33
本期利润	-4,908,676.35	323,987.27	-4,584,689.08
本期基金份额交易产生的变动数	-3,189,774.82	817,327.09	-2,372,447.73
其中：基金申购款	-6,536,101.71	1,199,112.88	-5,336,988.83
基金赎回款	3,346,326.89	-381,785.79	2,964,541.10
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-8,226,906.04	1,176,321.90	-7,050,584.14

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	23,826.99
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	1,970.38
其他	217.39
合计	26,014.76

6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	122,577,491.90
减：卖出股票成本总额	127,417,550.42
减：交易费用	334,593.29
买卖股票差价收入	-5,174,651.81

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	209,470.63
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-20.56
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	209,450.07

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	306,300.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	299,964.00
减：应计利息总额	6,300.00
减：交易费用	56.56
买卖债券差价收入	-20.56

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.13 衍生工具收益

6.4.7.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.13.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资产生的股利收益	52,007.13

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	52,007.13

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
1.交易性金融资产	379,357.01
——股票投资	44,569.63
——债券投资	334,787.38
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	379,357.01

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
基金赎回费收入	2,466.09
合计	2,466.09

6.4.7.17 信用减值损失

无。

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
审计费用	19,835.79
信息披露费	-
证券出借违约金	-
银行费用	155.00
银行间账户维护费	18,000.00
其他	40,600.00
合计	78,590.79

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

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%）。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华夏基金管理有限公司	基金管理人
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人
中信证券股份有限公司（“中信证券”）	基金管理人的股东
上海华夏财富投资管理有限公司（“华夏财富”）	基金管理人的子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
中信证券	228,264,767.65	87.61%	25,453,100.10	26.13%

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
中信证券	32,297,325.20	79.15%	21,536,792.00	44.78%

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
中信证券	49,141,000.00	100.00%	11,000,000.00	21.87%

6.4.10.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
中信证券	166,930.18	87.17%	20,775.64	9.89%
关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
中信证券	19,540.65	26.41%	19,540.65	9.58%

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日
	当期发生的基金应支付的管理费	138,985.45
其中：支付销售机构的客户维护费	22,132.55	-

注：①支付基金管理人的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 0.60%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

②基金管理人报酬计算公式为：日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×0.60%/当年天数。

③客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用按照代销机构所代销基金的份额保有量作为基数进行计算，从基金

管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月 30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30 日
当期发生的基金应支付的托管费	23,164.25	25,683.74

注：①支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值 0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

②基金托管费计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.10%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得 销售 服务 费的 各关 联方 名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日 当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华夏新锦汇混合 A	华夏新锦汇混合 C	合计
华夏 基金 管理 有限 公司	-	10,919.75	10,919.75
华夏 财富	-	6,855.35	6,855.35
中信 证券	-	505.59	505.59
合计	-	18,280.69	18,280.69
获得 销售 服务 费的 各关 联方 名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日 当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华夏新锦汇混合 A	华夏新锦汇混合 C	合计

关联方名称			
华夏基金管理有限公司	-	3,025.79	3,025.79
合计	-	3,025.79	3,025.79

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 0.10% 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 × 0.10% / 当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行活期存款	5,222,701.39	23,826.99	2,032,141.69	10,699.12

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

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位： 股/张）	总金额
中信证券	603162	海通发展	新股发行	489	18,215.25
中信证券	001286	陕西能源	新股发行	1,000	9,600.00
上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位： 股/张）	总金额
中信证券	301200	大族数控	新股发行	500	38,280.00

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配事项。

6.4.12 期末（2023 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的风险管理政策是使基金投资风险可测、可控、可承担。本基金管理人建立了由风险管

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

6.4.13.3 流动性风险

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

本基金管理人通过限制投资集中度来管理投资品种变现的流动性风险。除在“6.4.12 期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限制的情况外，本基金所投资的证券均能及时变现。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	合计
银行存款	5,222,701.39	-	-	5,222,701.39
结算备付金	60,927.45	-	-	60,927.45
结算保证金	31,085.83	-	-	31,085.83
债券投资	9,109,549.46	23,928,359.15	8,191,574.38	41,229,482.99
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 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	合计
银行存款	2,303,652.86	-	-	2,303,652.86
结算备付金	-	-	-	-
结算保证金	30,593.52	-	-	30,593.52
债券投资	-	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
买入返售金融资产	200,053.48	-	-	200,053.48
应收直销申购款	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	利率下降 25 个基点	395,181.88	-
利率上升 25 个基点	-391,911.97	-	

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 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	10,760,704.80	20.26	-	-
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	1,447,966.89	2.73	-	-
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	12,208,671.69	22.98	-	-

注：①本表中交易性金融资产-债券投资科目仅包含可转换公司债券和可交换公司债券等。

②由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日

	-5%	-532,947.61	-
	+5%	532,947.61	-

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 6 月 30 日
第一层次	12,208,671.69
第二层次	39,781,516.10
第三层次	-
合计	51,990,187.79

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

截至 2023 年 6 月 30 日止，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	10,760,704.80	18.78
	其中：股票	10,760,704.80	18.78
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	41,229,482.99	71.95
	其中：债券	41,229,482.99	71.95
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	5,283,628.84	9.22
8	其他各项资产	31,085.83	0.05
9	合计	57,304,902.46	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	280,536.00	0.53
C	制造业	8,630,146.80	16.25
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	124,785.00	0.23
E	建筑业	113,464.00	0.21
F	批发和零售业	120,010.00	0.23
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	560,873.00	1.06
J	金融业	559,535.00	1.05
K	房地产业	371,355.00	0.70
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-

	合计	10,760,704.80	20.26
--	----	---------------	-------

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	601689	拓普集团	14,900	1,202,430.00	2.26
2	002338	奥普光电	24,800	1,045,320.00	1.97
3	002920	德赛西威	3,200	498,592.00	0.94
4	000333	美的集团	7,700	453,684.00	0.85
5	300750	宁德时代	1,700	388,943.00	0.73
6	600481	双良节能	25,500	356,490.00	0.67
7	000651	格力电器	9,700	354,147.00	0.67
8	300274	阳光电源	2,900	338,227.00	0.64
9	000063	中兴通讯	6,500	296,010.00	0.56
10	000568	泸州老窖	1,400	293,398.00	0.55
11	600690	海尔智家	11,400	267,672.00	0.50
12	300660	江苏雷利	6,700	255,940.00	0.48
13	001979	招商蛇口	14,900	194,147.00	0.37
14	601088	中国神华	6,000	184,500.00	0.35
15	600048	保利发展	13,600	177,208.00	0.33
16	600519	贵州茅台	100	169,100.00	0.32
17	603986	兆易创新	1,500	159,375.00	0.30
18	002371	北方华创	500	158,825.00	0.30
19	002179	中航光电	3,500	158,725.00	0.30
20	688012	中微公司	1,000	156,450.00	0.29
21	600600	青岛啤酒	1,500	155,445.00	0.29
22	300990	同飞股份	3,080	154,924.00	0.29
23	601318	中国平安	3,000	139,200.00	0.26
24	600536	中国软件	2,800	131,264.00	0.25
25	601985	中国核电	17,700	124,785.00	0.23
26	600584	长电科技	4,000	124,680.00	0.23
27	600153	建发股份	11,000	120,010.00	0.23
28	002463	沪电股份	5,700	119,358.00	0.22
29	601398	工商银行	24,200	116,644.00	0.22
30	688981	中芯国际	2,300	116,196.00	0.22
31	601800	中国交建	10,400	113,464.00	0.21
32	603369	今世缘	2,100	110,880.00	0.21
33	601169	北京银行	23,200	107,416.00	0.20
34	600036	招商银行	3,200	104,832.00	0.20
35	002415	海康威视	3,100	102,641.00	0.19
36	600941	中国移动	1,100	102,630.00	0.19
37	300161	华中数控	1,900	101,688.00	0.19

38	300408	三环集团	3,400	99,790.00	0.19
39	601138	工业富联	3,900	98,280.00	0.19
40	600938	中国海油	5,300	96,036.00	0.18
41	688111	金山办公	200	94,444.00	0.18
42	000977	浪潮信息	1,900	92,150.00	0.17
43	600989	宝丰能源	7,300	92,053.00	0.17
44	601658	邮储银行	18,700	91,443.00	0.17
45	300896	爱美客	200	88,990.00	0.17
46	002230	科大讯飞	1,300	88,348.00	0.17
47	603345	安井食品	600	88,080.00	0.17
48	600845	宝信软件	1,700	86,377.00	0.16
49	600732	爱旭股份	2,700	83,025.00	0.16
50	600586	金晶科技	7,800	60,216.00	0.11
51	002472	双环传动	1,600	58,080.00	0.11
52	300496	中科创达	600	57,810.00	0.11
53	300260	新莱应材	1,400	55,328.00	0.10
54	688017	绿的谐波	331	53,754.40	0.10
55	000837	秦川机床	3,300	53,724.00	0.10
56	002050	三花智控	1,700	51,442.00	0.10
57	600426	华鲁恒升	1,600	49,008.00	0.09
58	603298	杭叉集团	2,000	47,100.00	0.09
59	688378	奥来德	216	10,670.40	0.02
60	600933	爱柯迪	400	9,316.00	0.02

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600036	招商银行	3,133,205.60	137.85
2	601318	中国平安	2,879,002.58	126.67
3	601088	中国神华	2,344,126.00	103.13
4	603369	今世缘	2,118,184.00	93.19
5	002142	宁波银行	2,001,432.00	88.06
6	601899	紫金矿业	1,957,982.51	86.14
7	300274	阳光电源	1,907,584.98	83.93
8	000001	平安银行	1,872,032.00	82.36
9	000858	五粮液	1,784,968.00	78.53
10	603986	兆易创新	1,780,541.00	78.34
11	300059	东方财富	1,697,488.68	74.68
12	600406	国电南瑞	1,609,473.24	70.81
13	600859	王府井	1,605,563.00	70.64
14	300896	爱美客	1,591,831.00	70.03

15	000596	古井贡酒	1,557,625.00	68.53
16	000568	泸州老窖	1,458,409.00	64.16
17	601689	拓普集团	1,421,985.00	62.56
18	688123	聚辰股份	1,419,015.84	62.43
19	600048	保利发展	1,367,951.00	60.18
20	601166	兴业银行	1,349,645.00	59.38
21	000651	格力电器	1,346,766.00	59.25
22	000002	万科 A	1,345,186.00	59.18
23	600872	中炬高新	1,343,711.85	59.12
24	300661	圣邦股份	1,328,519.00	58.45
25	300015	爱尔眼科	1,321,038.95	58.12
26	300750	宁德时代	1,302,830.00	57.32
27	600763	通策医疗	1,268,639.96	55.82
28	688378	奥来德	1,166,792.64	51.33
29	300124	汇川技术	1,111,864.00	48.92
30	002304	洋河股份	1,067,184.00	46.95
31	600875	东方电气	1,058,094.00	46.55
32	600487	亨通光电	1,054,166.30	46.38
33	601006	大秦铁路	1,028,330.00	45.24
34	600276	恒瑞医药	1,000,209.00	44.01
35	002338	奥普光电	984,493.00	43.31
36	002049	紫光国微	967,518.20	42.57
37	600057	厦门象屿	965,727.00	42.49
38	601298	青岛港	965,112.00	42.46
39	603259	药明康德	949,010.00	41.75
40	601601	中国太保	944,598.00	41.56
41	300454	深信服	937,701.00	41.26
42	603920	世运电路	935,006.00	41.14
43	688012	中微公司	926,356.92	40.76
44	600674	川投能源	900,221.00	39.61
45	600519	贵州茅台	897,845.00	39.50
46	002048	宁波华翔	885,945.00	38.98
47	000513	丽珠集团	871,461.00	38.34
48	600598	北大荒	869,234.00	38.24
49	300122	智飞生物	862,271.00	37.94
50	600761	安徽合力	832,623.00	36.63
51	001215	千味央厨	822,448.00	36.18
52	688308	欧科亿	821,442.57	36.14
53	002101	广东鸿图	801,978.00	35.28
54	601567	三星医疗	794,043.00	34.93
55	603596	伯特利	788,646.00	34.70
56	300782	卓胜微	766,112.94	33.71
57	002318	久立特材	763,842.00	33.61

58	601658	邮储银行	747,941.00	32.91
59	603871	嘉友国际	733,753.00	32.28
60	600210	紫江企业	730,348.00	32.13
61	688518	联赢激光	727,861.72	32.02
62	600933	爱柯迪	712,654.00	31.35
63	002493	荣盛石化	708,477.00	31.17
64	000333	美的集团	698,572.00	30.73
65	300408	三环集团	692,636.00	30.47
66	601838	成都银行	690,080.27	30.36
67	600007	中国国贸	684,926.00	30.13
68	600377	宁沪高速	683,150.00	30.06
69	600741	华域汽车	682,067.00	30.01
70	002532	天山铝业	676,712.00	29.77
71	600477	杭萧钢构	669,661.00	29.46
72	601398	工商银行	663,795.00	29.20
73	600586	金晶科技	663,244.20	29.18
74	603279	景津装备	654,883.00	28.81
75	002920	德赛西威	646,571.00	28.45
76	603298	杭叉集团	638,190.00	28.08
77	600985	淮北矿业	636,605.00	28.01
78	600690	海尔智家	635,127.00	27.94
79	600660	福耀玻璃	626,708.00	27.57
80	603228	景旺电子	597,264.00	26.28
81	600971	恒源煤电	579,689.00	25.50
82	300757	罗博特科	577,720.00	25.42
83	688798	艾为电子	574,040.44	25.26
84	002050	三花智控	565,167.00	24.87
85	000895	双汇发展	558,957.00	24.59
86	000703	恒逸石化	551,709.00	24.27
87	600566	济川药业	551,090.00	24.25
88	603730	岱美股份	548,044.60	24.11
89	688558	国盛智科	537,439.59	23.65
90	000831	中国稀土	533,692.00	23.48
91	601126	四方股份	531,944.00	23.40
92	600111	北方稀土	531,407.00	23.38
93	002335	科华数据	529,600.00	23.30
94	301273	瑞晨环保	528,257.00	23.24
95	600195	中牧股份	526,428.00	23.16
96	002410	广联达	525,956.00	23.14
97	688766	普冉股份	517,773.20	22.78
98	603013	亚普股份	514,174.00	22.62
99	300161	华中数控	511,498.04	22.50
100	688106	金宏气体	509,996.31	22.44

101	000725	京东方 A	500,495.00	22.02
102	002460	赣锋锂业	496,767.00	21.86
103	601800	中国交建	487,573.00	21.45
104	600941	中国移动	483,010.00	21.25
105	601319	中国人保	480,752.00	21.15
106	688128	中国电研	474,796.25	20.89
107	688630	芯碁微装	468,759.99	20.62
108	300394	天孚通信	466,677.00	20.53
109	600600	青岛啤酒	465,378.00	20.47
110	002648	卫星化学	460,560.60	20.26
111	600398	海澜之家	456,691.00	20.09
112	603179	新泉股份	448,092.00	19.71
113	601169	北京银行	438,834.00	19.31
114	002003	伟星股份	437,661.03	19.26
115	000063	中兴通讯	431,590.00	18.99
116	603323	苏农银行	430,593.00	18.94
117	300009	安科生物	426,968.00	18.79
118	600285	羚锐制药	425,056.00	18.70
119	002138	顺络电子	421,465.00	18.54
120	688536	思瑞浦	414,523.08	18.24
121	603345	安井食品	412,891.00	18.17
122	601699	潞安环能	396,784.00	17.46
123	000338	潍柴动力	371,803.00	16.36
124	600481	双良节能	367,653.00	16.18
125	600938	中国海油	348,419.00	15.33
126	001979	招商蛇口	345,287.00	15.19
127	600025	华能水电	343,683.00	15.12
128	601985	中国核电	342,747.00	15.08
129	600993	马应龙	341,369.00	15.02
130	002371	北方华创	340,238.00	14.97
131	603566	普莱柯	339,906.00	14.95
132	002032	苏泊尔	339,118.00	14.92
133	300990	同飞股份	338,960.00	14.91
134	300430	诚益通	338,066.00	14.87
135	603868	飞科电器	333,370.00	14.67
136	603997	继峰股份	327,763.00	14.42
137	600499	科达制造	325,809.00	14.33
138	600438	通威股份	322,580.00	14.19
139	300861	美畅股份	321,962.00	14.17
140	688508	芯朋微	319,639.61	14.06
141	000538	云南白药	317,376.00	13.96
142	603815	交建股份	304,715.00	13.41
143	002807	江阴银行	304,348.00	13.39

144	688981	中芯国际	300,325.30	13.21
145	603979	金诚信	295,507.00	13.00
146	601390	中国中铁	291,174.00	12.81
147	603305	旭升集团	290,506.00	12.78
148	300415	伊之密	289,487.00	12.74
149	002415	海康威视	284,100.00	12.50
150	603589	口子窖	280,548.00	12.34
151	601128	常熟银行	278,652.00	12.26
152	002372	伟星新材	275,660.00	12.13
153	600970	中材国际	273,216.00	12.02
154	688114	华大智造	268,666.31	11.82
155	002219	新里程	268,620.00	11.82
156	000630	铜陵有色	266,916.00	11.74
157	300660	江苏雷利	264,464.00	11.64
158	600418	江淮汽车	263,263.00	11.58
159	300395	菲利华	262,618.00	11.55
160	002158	汉钟精机	262,169.00	11.53
161	600183	生益科技	260,981.00	11.48
162	600230	沧州大化	259,448.00	11.41
163	000970	中科三环	256,834.00	11.30
164	600536	中国软件	253,838.00	11.17
165	002327	富安娜	253,719.00	11.16
166	603583	捷昌驱动	250,922.00	11.04
167	300832	新产业	248,710.00	10.94
168	601728	中国电信	246,652.00	10.85
169	300770	新媒股份	245,052.00	10.78
170	000988	华工科技	237,765.00	10.46
171	002463	沪电股份	234,000.00	10.30
172	601019	山东出版	223,061.00	9.81
173	002179	中航光电	222,852.00	9.80
174	603816	顾家家居	221,991.00	9.77
175	600517	国网英大	212,860.00	9.37
176	000717	中南股份	212,667.00	9.36
177	600236	桂冠电力	212,627.00	9.35
178	000883	湖北能源	212,574.00	9.35
179	600839	四川长虹	211,751.00	9.32
180	600886	国投电力	211,110.00	9.29
181	002520	日发精机	207,746.00	9.14
182	601186	中国铁建	202,452.00	8.91
183	000977	浪潮信息	201,275.00	8.86
184	002368	太极股份	199,865.00	8.79
185	002484	江海股份	199,235.00	8.77
186	002409	雅克科技	189,465.00	8.34

187	002847	盐津铺子	185,750.00	8.17
188	601138	工业富联	184,880.00	8.13
189	300450	先导智能	183,911.00	8.09
190	002959	小熊电器	174,887.00	7.69
191	601952	苏垦农发	173,241.00	7.62
192	300033	同花顺	168,771.00	7.43
193	002034	旺能环境	167,968.00	7.39
194	601668	中国建筑	166,071.00	7.31
195	002594	比亚迪	162,075.00	7.13
196	688023	安恒信息	160,902.81	7.08
197	603639	海利尔	158,078.00	6.95
198	300502	新易盛	156,815.00	6.90
199	600585	海螺水泥	156,565.00	6.89
200	688271	联影医疗	150,631.15	6.63
201	603367	辰欣药业	150,103.00	6.60
202	300634	彩讯股份	144,116.00	6.34
203	300604	长川科技	142,628.00	6.28
204	688008	澜起科技	139,760.56	6.15
205	002230	科大讯飞	139,416.00	6.13
206	001696	宗申动力	136,034.00	5.98
207	600028	中国石化	134,985.00	5.94
208	688322	奥比中光	134,906.52	5.94
209	601600	中国铝业	131,201.00	5.77
210	300348	长亮科技	129,761.00	5.71
211	300568	星源材质	129,726.00	5.71
212	600584	长电科技	127,851.00	5.62
213	002439	启明星辰	122,995.00	5.41
214	601117	中国化学	121,850.00	5.36
215	600153	建发股份	120,975.00	5.32
216	600062	华润双鹤	119,826.00	5.27
217	301188	力诺特玻	117,951.00	5.19
218	600612	老凤祥	117,856.00	5.19
219	002979	雷赛智能	117,640.00	5.18
220	600348	华阳股份	115,752.00	5.09
221	300212	易华录	114,933.00	5.06
222	300613	富瀚微	114,298.00	5.03
223	688152	麒麟信安	108,867.51	4.79
224	300037	新宙邦	108,828.00	4.79
225	000951	中国重汽	108,025.00	4.75
226	002602	世纪华通	105,967.00	4.66
227	002261	拓维信息	105,357.00	4.64
228	002291	遥望科技	105,187.00	4.63
229	601555	东吴证券	105,006.00	4.62

230	300253	卫宁健康	103,518.00	4.55
231	300339	润和软件	103,089.00	4.54
232	601225	陕西煤业	103,050.00	4.53
233	300687	赛意信息	102,913.00	4.53
234	002236	大华股份	102,872.00	4.53
235	002373	千方科技	100,905.00	4.44
236	600588	用友网络	100,385.00	4.42
237	600989	宝丰能源	96,464.00	4.24
238	688111	金山办公	96,460.00	4.24
239	000983	山西焦煤	94,395.00	4.15
240	300996	普联软件	94,079.00	4.14
241	601628	中国人寿	93,327.00	4.11
242	300825	阿尔特	93,250.00	4.10
243	300423	昇辉科技	92,930.00	4.09
244	600845	宝信软件	92,874.00	4.09
245	688037	芯源微	88,596.92	3.90
246	002517	恺英网络	79,415.00	3.49
247	600522	中天科技	78,408.00	3.45
248	600732	爱旭股份	77,481.60	3.41
249	600197	伊力特	74,170.00	3.26
250	000898	鞍钢股份	73,483.00	3.23
251	603027	千禾味业	72,472.00	3.19
252	601636	旗滨集团	69,376.00	3.05
253	300496	中科创达	65,001.54	2.86
254	688262	国芯科技	64,757.28	2.85
255	603699	纽威股份	63,833.00	2.81
256	601288	农业银行	62,496.00	2.75
257	600601	方正科技	61,868.00	2.72
258	688777	中控技术	54,841.43	2.41
259	603728	鸣志电器	53,047.00	2.33
260	688017	绿的谐波	52,973.24	2.33
261	603019	中科曙光	52,846.00	2.33
262	601333	广深铁路	52,780.00	2.32
263	300182	捷成股份	52,709.00	2.32
264	000034	神州数码	52,558.00	2.31
265	300260	新莱应材	52,491.00	2.31
266	000837	秦川机床	52,448.00	2.31
267	002913	奥士康	52,360.00	2.30
268	002837	英维克	52,289.00	2.30
269	002436	兴森科技	51,924.00	2.28
270	002472	双环传动	51,807.00	2.28
271	000938	紫光股份	51,494.00	2.27
272	002156	通富微电	51,479.00	2.26

273	601100	恒立液压	51,434.00	2.26
274	000681	视觉中国	51,297.00	2.26
275	000021	深科技	51,163.00	2.25
276	002555	三七互娱	51,070.00	2.25
277	600426	华鲁恒升	50,694.00	2.23
278	300620	光库科技	50,480.00	2.22
279	002756	永兴材料	48,404.00	2.13
280	605398	新炬网络	48,125.00	2.12
281	600925	苏能股份	47,066.88	2.07
282	605168	三人行	45,887.00	2.02

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600036	招商银行	2,921,425.00	128.53
2	601318	中国平安	2,576,601.00	113.36
3	601088	中国神华	2,156,116.00	94.86
4	603369	今世缘	2,083,277.00	91.66
5	601899	紫金矿业	1,992,604.50	87.67
6	002142	宁波银行	1,893,778.60	83.32
7	000001	平安银行	1,744,946.00	76.77
8	000858	五粮液	1,685,201.00	74.14
9	600406	国电南瑞	1,576,267.60	69.35
10	300274	阳光电源	1,525,146.00	67.10
11	300059	东方财富	1,524,539.00	67.07
12	600859	王府井	1,481,499.00	65.18
13	000596	古井贡酒	1,480,281.00	65.13
14	603986	兆易创新	1,422,685.00	62.59
15	300896	爱美客	1,385,644.00	60.96
16	600872	中炬高新	1,323,080.00	58.21
17	000002	万科 A	1,315,229.00	57.87
18	601166	兴业银行	1,289,029.00	56.71
19	688123	聚辰股份	1,247,271.83	54.88
20	300015	爱尔眼科	1,211,013.00	53.28
21	600048	保利发展	1,174,688.00	51.68
22	688378	奥来德	1,166,103.30	51.30
23	300661	圣邦股份	1,145,516.00	50.40
24	300124	汇川技术	1,139,767.00	50.15
25	000568	泸州老窖	1,104,993.00	48.62
26	600763	通策医疗	1,089,324.00	47.93
27	601006	大秦铁路	1,037,974.00	45.67

28	600875	东方电气	1,019,940.00	44.87
29	000651	格力电器	1,014,073.00	44.62
30	002304	洋河股份	1,002,743.00	44.12
31	600276	恒瑞医药	1,000,379.00	44.01
32	600487	亨通光电	994,748.40	43.77
33	601298	青岛港	983,367.00	43.26
34	600057	厦门象屿	964,233.10	42.42
35	603920	世运电路	938,745.00	41.30
36	600674	川投能源	927,771.00	40.82
37	601601	中国太保	922,170.00	40.57
38	000513	丽珠集团	881,508.00	38.78
39	600598	北大荒	863,930.00	38.01
40	002049	紫光国微	860,570.00	37.86
41	002048	宁波华翔	857,687.00	37.74
42	002101	广东鸿图	856,727.00	37.69
43	300750	宁德时代	847,098.00	37.27
44	300454	深信服	827,418.00	36.40
45	600761	安徽合力	822,565.00	36.19
46	603259	药明康德	810,504.00	35.66
47	001215	千味央厨	790,198.00	34.77
48	600933	爱柯迪	786,672.00	34.61
49	002318	久立特材	769,118.00	33.84
50	603871	嘉友国际	762,325.00	33.54
51	688012	中微公司	757,214.42	33.31
52	601567	三星医疗	755,433.00	33.24
53	300122	智飞生物	743,518.00	32.71
54	688308	欧科亿	738,935.53	32.51
55	002493	荣盛石化	731,954.00	32.20
56	603596	伯特利	722,081.00	31.77
57	600210	紫江企业	704,906.00	31.01
58	600519	贵州茅台	704,725.00	31.01
59	601838	成都银行	679,421.00	29.89
60	300782	卓胜微	674,348.00	29.67
61	600007	中国国贸	671,807.00	29.56
62	600377	宁沪高速	667,243.00	29.36
63	002532	天山铝业	667,198.00	29.35
64	688518	联赢激光	661,676.25	29.11
65	600741	华域汽车	654,745.00	28.81
66	601658	邮储银行	637,435.00	28.04
67	603279	景津装备	634,986.00	27.94
68	600477	杭萧钢构	624,242.00	27.46
69	600985	淮北矿业	618,168.00	27.20
70	600660	福耀玻璃	602,932.00	26.53

71	603228	景旺电子	594,460.00	26.15
72	600971	恒源煤电	575,938.58	25.34
73	300408	三环集团	573,284.00	25.22
74	688558	国盛智科	568,496.92	25.01
75	600566	济川药业	564,007.00	24.81
76	603298	杭叉集团	561,279.00	24.69
77	600586	金晶科技	558,702.00	24.58
78	000703	恒逸石化	558,172.00	24.56
79	603730	岱美股份	552,331.00	24.30
80	601398	工商银行	545,810.00	24.01
81	000895	双汇发展	539,978.00	23.76
82	300757	罗博特科	534,448.00	23.51
83	002410	广联达	532,138.60	23.41
84	688106	金宏气体	523,509.81	23.03
85	688798	艾为电子	517,485.08	22.77
86	601126	四方股份	512,065.00	22.53
87	600195	中牧股份	510,768.00	22.47
88	000831	中国稀土	509,701.00	22.42
89	000725	京东方 A	506,694.00	22.29
90	002050	三花智控	504,042.00	22.18
91	600111	北方稀土	489,939.00	21.56
92	603013	亚普股份	489,132.00	21.52
93	002460	赣锋锂业	486,600.00	21.41
94	601319	中国人保	478,495.00	21.05
95	688128	中国电研	476,376.61	20.96
96	300394	天孚通信	473,676.00	20.84
97	301273	瑞晨环保	471,155.00	20.73
98	002335	科华数据	467,276.00	20.56
99	688766	普冉股份	463,813.18	20.41
100	688630	芯碁微装	461,343.53	20.30
101	600398	海澜之家	454,035.00	19.98
102	002648	卫星化学	452,427.00	19.91
103	600285	羚锐制药	441,627.00	19.43
104	002003	伟星股份	433,239.00	19.06
105	300161	华中数控	429,058.00	18.88
106	603323	苏农银行	421,772.00	18.56
107	300009	安科生物	419,845.00	18.47
108	603179	新泉股份	418,525.00	18.41
109	002138	顺络电子	387,363.00	17.04
110	601699	潞安环能	377,581.00	16.61
111	300430	诚益通	375,981.00	16.54
112	688536	思瑞浦	372,881.58	16.41
113	600941	中国移动	365,457.00	16.08

114	000338	潍柴动力	355,043.00	15.62
115	600690	海尔智家	347,675.00	15.30
116	600993	马应龙	345,600.00	15.21
117	601800	中国交建	344,103.00	15.14
118	600025	华能水电	338,670.00	14.90
119	600438	通威股份	336,240.00	14.79
120	600499	科达制造	335,284.00	14.75
121	002032	苏泊尔	332,933.00	14.65
122	601169	北京银行	328,845.00	14.47
123	300415	伊之密	320,771.00	14.11
124	603566	普莱柯	317,753.00	13.98
125	300861	美畅股份	311,387.00	13.70
126	603868	飞科电器	307,735.00	13.54
127	603345	安井食品	304,803.00	13.41
128	603997	继峰股份	301,502.00	13.26
129	603979	金诚信	301,387.00	13.26
130	600970	中材国际	297,899.00	13.11
131	000538	云南白药	297,582.80	13.09
132	002807	江阴银行	297,386.00	13.08
133	600600	青岛啤酒	295,481.00	13.00
134	603815	交建股份	292,776.00	12.88
135	688508	芯朋微	292,740.38	12.88
136	601390	中国中铁	282,650.00	12.44
137	603305	旭升集团	277,324.00	12.20
138	601128	常熟银行	270,085.00	11.88
139	603589	口子窖	269,207.00	11.84
140	002372	伟星新材	262,129.00	11.53
141	000630	铜陵有色	256,178.00	11.27
142	002158	汉钟精机	254,191.00	11.18
143	002327	富安娜	251,195.00	11.05
144	600418	江淮汽车	246,923.00	10.86
145	600230	沧州大化	246,682.00	10.85
146	600938	中国海油	246,348.00	10.84
147	000988	华工科技	246,334.00	10.84
148	002219	新里程	244,737.00	10.77
149	300395	菲利华	242,196.00	10.66
150	601728	中国电信	240,962.00	10.60
151	000970	中科三环	240,748.00	10.59
152	688114	华大智造	240,565.08	10.58
153	600183	生益科技	238,852.00	10.51
154	300832	新产业	236,108.00	10.39
155	603583	捷昌驱动	235,309.00	10.35
156	000333	美的集团	234,848.00	10.33

157	300770	新媒股份	234,809.00	10.33
158	601689	拓普集团	230,409.00	10.14
159	601019	山东出版	227,636.00	10.02
160	600886	国投电力	225,000.00	9.90
161	603816	顾家家居	222,701.00	9.80
162	601985	中国核电	220,782.00	9.71
163	000063	中兴通讯	213,826.00	9.41
164	601186	中国铁建	207,361.00	9.12
165	000883	湖北能源	205,027.00	9.02
166	600236	桂冠电力	204,526.36	9.00
167	002520	日发精机	197,958.00	8.71
168	000717	中南股份	196,605.00	8.65
169	600517	国网英大	196,314.00	8.64
170	002847	盐津铺子	191,723.00	8.44
171	002484	江海股份	189,673.00	8.34
172	002409	雅克科技	189,537.00	8.34
173	600839	四川长虹	187,773.00	8.26
174	002371	北方华创	182,147.00	8.01
175	002368	太极股份	178,831.88	7.87
176	002959	小熊电器	176,356.00	7.76
177	300990	同飞股份	172,001.00	7.57
178	601952	苏垦农发	167,559.00	7.37
179	688981	中芯国际	165,930.19	7.30
180	300450	先导智能	163,210.00	7.18
181	002415	海康威视	161,027.00	7.08
182	601668	中国建筑	160,927.00	7.08
183	002034	旺能环境	160,322.00	7.05
184	001979	招商蛇口	158,729.00	6.98
185	002594	比亚迪	156,210.00	6.87
186	300502	新易盛	150,399.00	6.62
187	603367	辰欣药业	148,666.00	6.54
188	603639	海利尔	146,487.00	6.44
189	600585	海螺水泥	143,214.00	6.30
190	688023	安恒信息	142,839.01	6.28
191	300604	长川科技	141,572.00	6.23
192	300033	同花顺	139,181.00	6.12
193	688271	联影医疗	138,481.38	6.09
194	600028	中国石化	135,527.00	5.96
195	601600	中国铝业	132,472.00	5.83
196	001696	宗申动力	131,982.00	5.81
197	688008	澜起科技	128,929.82	5.67
198	301188	力诺特玻	126,773.00	5.58
199	600612	老凤祥	124,607.00	5.48

200	300634	彩讯股份	123,561.00	5.44
201	300568	星源材质	117,695.00	5.18
202	002920	德赛西威	115,715.00	5.09
203	688322	奥比中光	113,791.24	5.01
204	002979	雷赛智能	113,629.00	5.00
205	300037	新宙邦	113,371.00	4.99
206	600348	华阳股份	113,207.00	4.98
207	601117	中国化学	113,198.00	4.98
208	300348	长亮科技	109,381.00	4.81
209	600062	华润双鹤	104,135.00	4.58
210	000977	浪潮信息	104,076.00	4.58
211	601138	工业富联	103,041.00	4.53
212	002439	启明星辰	101,959.00	4.49
213	300613	富瀚微	101,424.00	4.46
214	300996	普联软件	96,686.60	4.25
215	601628	中国人寿	96,139.00	4.23
216	300212	易华录	95,226.00	4.19
217	002373	千方科技	94,363.00	4.15
218	601555	东吴证券	94,051.00	4.14
219	601225	陕西煤业	93,315.00	4.11
220	600536	中国软件	92,372.00	4.06
221	300253	卫宁健康	92,199.00	4.06
222	002517	恺英网络	92,138.00	4.05
223	000983	山西焦煤	92,130.00	4.05
224	600588	用友网络	91,544.00	4.03
225	002291	遥望科技	91,137.00	4.01
226	000951	中国重汽	90,530.32	3.98
227	002261	拓维信息	89,968.00	3.96
228	300339	润和软件	89,752.00	3.95
229	002602	世纪华通	89,477.00	3.94
230	688152	麒麟信安	87,549.65	3.85
231	300687	赛意信息	86,724.00	3.82
232	300423	昇辉科技	86,677.00	3.81
233	300825	阿尔特	85,172.00	3.75
234	002236	大华股份	84,925.00	3.74
235	688037	芯源微	84,915.54	3.74
236	600522	中天科技	79,500.00	3.50
237	603027	千禾味业	76,884.00	3.38
238	002463	沪电股份	76,124.00	3.35
239	002179	中航光电	71,409.00	3.14
240	600197	伊力特	67,192.00	2.96
241	603699	纽威股份	65,032.00	2.86
242	000898	鞍钢股份	63,752.00	2.80

243	601636	旗滨集团	63,471.00	2.79
244	688262	国芯科技	61,943.31	2.73
245	300624	万兴科技	61,716.00	2.72
246	601288	农业银行	61,030.00	2.69
247	600601	方正科技	57,176.00	2.52
248	000681	视觉中国	55,535.00	2.44
249	002436	兴森科技	55,181.00	2.43
250	002913	奥士康	54,970.00	2.42
251	601333	广深铁路	52,780.00	2.32
252	002555	三七互娱	52,596.00	2.31
253	688777	中控技术	52,171.32	2.30
254	601100	恒立液压	50,499.00	2.22
255	300182	捷成股份	49,846.00	2.19
256	603728	鸣志电器	49,837.00	2.19
257	000021	深科技	47,666.00	2.10
258	600925	苏能股份	47,599.84	2.09
259	002837	英维克	47,248.00	2.08
260	002156	通富微电	46,933.00	2.06
261	000938	紫光股份	46,672.00	2.05
262	603019	中科曙光	45,668.00	2.01

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	138,133,685.59
卖出股票收入（成交）总额	122,577,491.90

注：“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	39,781,516.10	74.89
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	1,447,966.89	2.73
8	同业存单	-	-

9	其他	-	-
10	合计	41,229,482.99	77.62

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	019687	22 国债 22	81,000	8,251,583.18	15.53
2	019690	22 国债 25	81,000	8,191,574.38	15.42
3	019695	23 国债 02	77,000	7,863,847.56	14.80
4	019696	23 国债 03	77,000	7,812,928.41	14.71
5	019703	23 国债 10	39,000	3,920,525.75	7.38

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末无股指期货投资。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末无国债期货投资。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货投资。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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。

7.12.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	31,085.83
2	应收清算款	-

3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	31,085.83

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	113037	紫银转债	1,445,186.93	2.72

7.12.5 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。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
华夏新锦汇混合 A	206	22,707.76	-	-	4,677,799.50	100.00%
华夏新锦汇混合 C	37	1,516,389.92	27,932,336.62	49.78%	28,174,090.52	50.22%
合计	243	250,140.85	27,932,336.62	45.95%	32,851,890.02	54.05%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	华夏新锦汇混合 A	3,370,541.67	72.05%
	华夏新锦汇混合 C	583,553.51	1.04%
	合计	3,954,095.18	6.51%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	华夏新锦汇混合 A	0
	华夏新锦汇混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	华夏新锦汇混合 A	>100
	华夏新锦汇混合 C	50~100
	合计	>100

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华夏新锦汇混合 A	华夏新锦汇混合 C
基金合同生效日（2017 年 3 月 8 日）基金份额总额	500,184,322.68	-
本报告期期初基金份额总额	43,506.67	2,324,919.55
本报告期基金总申购份额	4,656,068.12	82,284,608.38
减：本报告期基金总赎回份额	21,775.29	28,503,100.79
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	4,677,799.50	56,106,427.14

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

华夏新锦汇灵活配置混合型证券投资基金于 2023 年 2 月 17 日公告以通讯方式召开基金份额持有人大会，审议《关于关于华夏新锦汇灵活配置混合型证券投资基金持续运作的议案》，会议议案于 2023 年 3 月 21 日获得通过，大会决议自同日起生效。自 2023 年 3 月 21 日起，本基金将根据基金合同现有规定持续运作，基金的投资、申购与赎回等保持不变。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期未发生影响基金管理人经营或基金运营业务的诉讼。

本报告期无涉及基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金所聘用的会计师事务所未发生改变。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 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。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信证券	5	228,264,767.65	87.61%	166,930.18	87.17%	-
开源证券	1	27,513,338.88	10.56%	20,120.45	10.51%	-
华泰证券	1	4,782,430.53	1.84%	4,453.92	2.33%	-

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、北京高华证券、财通证券、长城证券、长江证券、川财证券、德邦证券、东方证券、东吴证券、东兴证券、东莞证券、方正证券、高华证券、光大证券、广发证券、国海证券、国盛证券、国泰君安证券、国信证券、海通证券、华创证券、华西证券、汇丰前海证券、江海证券、民生证券、平安证券、申万宏源证券、天风证券、万联证券、西部证券、信达证券、银河证券、招商证券、中国银河证券、中航证券、中金公司、中信建投证券、中邮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，中邮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。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
中信证券	32,297,325.20	79.15%	49,141,000.00	100.00%	-	-	-	-
开源证券	4,601,554.00	11.28%	-	-	-	-	-	-
华泰证券	3,908,481.00	9.58%	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华夏基金管理有限公司公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-01-06
2	华夏基金管理有限公司关于以通讯方式召开华夏新锦汇灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-02-17
3	华夏基金管理有限公司关于以通讯方式召开华夏新锦汇灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-02-18
4	华夏新锦汇灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-03-22
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	2023-03-23
6	华夏基金管理有限公司关于调整华夏新锦汇灵活配置混合型证券投资基金基金经理的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-04-08

	告		
--	---	--	--

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况

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	2023-01-01 至 2023-01-11	2,075,119.32	-	-	2,075,119.32	3.41%

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。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予基金注册的文件；
- 2、《华夏新锦汇灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《华夏新锦汇灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、法律意见书；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照。

12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

12.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的住所免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可

在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

华夏基金管理有限公司

二〇二三年八月三十日