

# 华夏睿磐泰荣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：招商银行股份有限公司

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。

基金托管人招商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.....	12
§6 中期报告财务会计报告（未经审计）.....	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	14
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	17
§7 投资组合报告.....	36
7.1 期末基金资产组合情况.....	36
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	37
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.....	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	50
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	51
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.....	52
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.....	52
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.....	52
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.....	52
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	52
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	52
7.12 投资组合报告附注.....	52
§8 基金份额持有人信息.....	53
§9 开放式基金份额变动.....	54
§10 重大事件揭示.....	55
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	57
§12 备查文件目录.....	57

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华夏睿磐泰荣混合型证券投资基金	
基金简称	华夏睿磐泰荣混合	
基金主代码	005140	
交易代码	005140	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 12 月 27 日	
基金管理人	华夏基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	236,390,463.41 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华夏睿磐泰荣混合 A	华夏睿磐泰荣混合 C
下属分级基金的交易代码	005140	005141
报告期末下属分级基金的份额总额	119,726,506.60 份	116,663,956.81 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	通过风险均衡方法进行资产配置，积极管理，力求有效控制风险，实现基金资产长期持续增值。
投资策略	主要投资策略包括资产配置策略、股票投资策略、固定收益品种投资策略、资产支持证券投资策略、权证投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略、股票期权投资策略等。在资产配置策略上，本基金以风险均衡作为主要资产配置策略，通过平衡各资产类别对整个组合风险贡献，合理确定本基金在股票、债券等资产上的投资比例。在股票投资策略上，本基金股票投资策略分为主动量化股票投资策略和基于风险均衡的股票投资策略。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率×20%+上证国债指数收益率×80%。
风险收益特征	本基金属于混合基金，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	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李彬
	联系电话	400-818-6666
	电子邮箱	service@ChinaAMC.com
客户服务电话	400-818-6666	95555
传真	010-63136700	0755-83195201
注册地址	北京市顺义区安庆大街甲3号	深圳市深南大道7088号招商银行大

	院	厦
办公地址	北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座8层	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
邮政编码	100033	518040
法定代表人	杨明辉	缪建民

### 2.5 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.ChinaAMC.com
基金中期报告备置地点	基金管理人和/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）	
	华夏睿磐泰荣混合 A	华夏睿磐泰荣混合 C
本期已实现收益	-1,234,794.56	-1,402,488.44
本期利润	5,956,789.01	5,682,063.52
加权平均基金份额本期利润	0.0302	0.0333
本期加权平均净值利润率	2.39%	2.67%
本期基金份额净值增长率	1.83%	1.67%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)	
	华夏睿磐泰荣混合 A	华夏睿磐泰荣混合 C
期末可供分配利润	28,073,418.37	25,170,958.01
期末可供分配基金份额利润	0.2345	0.2158
期末基金资产净值	151,572,818.53	145,472,790.24
期末基金份额净值	1.2660	1.2469
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)	
	华夏睿磐泰荣混合 A	华夏睿磐泰荣混合 C

基金份额累计净值增长率	38.87%	36.56%
-------------	--------	--------

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

##### 华夏睿磐泰荣混合 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	0.52%	0.21%	0.49%	0.17%	0.03%	0.04%
过去三个月	0.11%	0.20%	0.09%	0.16%	0.02%	0.04%
过去六个月	1.83%	0.19%	1.78%	0.16%	0.05%	0.03%
过去一年	-0.28%	0.18%	0.42%	0.19%	-0.70%	-0.01%
过去三年	15.15%	0.25%	8.46%	0.23%	6.69%	0.02%
自基金合同生效起至今	38.87%	0.27%	21.14%	0.25%	17.73%	0.02%

##### 华夏睿磐泰荣混合 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	0.48%	0.21%	0.49%	0.17%	-0.01%	0.04%
过去三个月	0.03%	0.20%	0.09%	0.16%	-0.06%	0.04%
过去六个月	1.67%	0.19%	1.78%	0.16%	-0.11%	0.03%
过去一年	-0.57%	0.18%	0.42%	0.19%	-0.99%	-0.01%
过去三年	14.11%	0.25%	8.46%	0.23%	5.65%	0.02%
自基金合同生效起至今	36.56%	0.27%	21.14%	0.25%	15.42%	0.02%

#### 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

##### 华夏睿磐泰荣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 27 日至 2023 年 6 月 30 日)

##### 华夏睿磐泰荣混合 A



华夏睿磐泰荣混合 C



## §4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

华夏基金管理有限公司成立于 1998 年 4 月 9 日,是经中国证监会批准成立的首批全国性基金管理公司之一。公司总部设在北京,在北京、上海、深圳、成都、南京、杭州、广州、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		
宋洋	本基金的 基金经理	2018-04-10	-	13 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。
范阳君	本基金的 基金经理 助理	2022-11-21	-	10 年	硕士。2013 年 7 月加入华夏基金管理有限公司。历任固定收益部研究员。

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。

③自 2023 年 7 月 19 日起，范阳君先生不再担任本基金基金经理助理。

## 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

上半年，债券市场走出牛市行情，久期策略优于票息策略。从持有期收益率的排序上看，30Y 国债和 20Y 国开持有期收益率最高，其次是 3-5Y 段的二永、普通信用债。5Y 国债明显跑输 5Y 国开，10Y 国开上半年表现也不及 10Y 国债。一季度市场对今年的经济复苏富有期待，因此即使在疫情影响下 1 月数据表现不佳，债券收益率仍然上行，10Y 国债一度触及 2.93% 附近的位置，3 月后半月后，伴随电煤日耗、螺纹钢表需、房地产销售等高频数据出现转弱苗头，市场对复苏斜率的预期开始调整，进入 4-5 月，伴随资金中枢的下移，债市行情加速，10Y 国债突破了当时的 1Y 期 MLF 2.75% 后继续下行，在 6 月初下行至 2.67% 左右的水平。6 月央行宣布降息，市场对宽货币的预期提前兑现，10Y 国债盘中最低触及 2.59%，接近去年的最低水平。信用债在利率中枢整体下移叠加理财体量恢复的大背景下持续走牛，品种利差和期限利差均有压缩，截至 6 月底，以 AAA 为例，1Y、3Y、5Y 普通信用债分别达到 2.47%、2.78%、3.06%。3Y 接近 6 月降息后低点，1Y 和 5Y 距离 6 月降息后低点约 5-7bp。

权益市场上半年呈现先上后下的走势。一季度，伴随着去年年底疫情管控政策的边际放松，社会经济秩序逐步回归常态，叠加市场预期美联储紧缩货币政策接近尾声等海外金融因素的加持，市场迎来开门红。但在二季度，伴随着经济数据的逐步披露，权益市场经历了从“强预期+弱现实”到“弱现实+弱预期”预期交易的转换，而二季度又正逢领导班子换届以及大兴调研之风的时间窗口期，因此具体政策预期并不明朗，导致二季度回吐了部分一季度的涨幅。整体而言，权益市场上半年呈先上后下之势，继续处于市场存量博弈的环境中。行业与主题的轮动速度仍在历史高位，结构化分化严重。TMT 和国企改革投资主线轮番表现，消费、地产、新能源等行业遭遇一定幅度的回调。

报告期内，本基金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，采用多策略的管理方式，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，力争穿越市场不同风格与投资主线周期，同时积极使用衍生品工具管理产品的波动和回撤水平。二季度相对于一季度，边际增加了权益仓位敞口的暴露水平，在权益细分资产内部配置方面，考虑到全球主要经济体的利率水平、通胀水平、逆全球化进程都处于较高水平，因此增加了避险资产的配置比例，以期增强组合的反脆弱性。报告期内，以产品投资目标为指导，积极调整仓位管理策略为更为积极的偏左侧的仓位管理方式，以期更好地应对股票市场的波动。债券端上半年组合秉承精细择券原则，降低至中性久期以控制回撤，二季度组合提高了组合杠杆及纯债仓位。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2023 年 6 月 30 日，华夏睿磐泰荣混合 A 基金份额净值为 1.2660 元，本报告期份额净值增长率为 1.83%；华夏睿磐泰荣混合 C 基金份额净值为 1.2469 元，本报告期份额净值增长率为 1.67%，同期业绩比较基准增长率为 1.78%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，债券市场方面，10Y 国债已经在 2.62% 附近的位置，低于 MLF 约 3bp。7 月在远洋展期、地产销售疲弱的状态下，资金没有进一步宽松，DR007 仍在 1.8%-1.9% 的水平。我们认为，若要突破前低 2.59%，需要基本面再度转弱或者新增宽货币政策的支持。前者需要密切跟踪高频数据，及时修正投资观点，后者本质上也是从基本面出发，但从经验上看，可以结合相关部门、领导的讲话综合判断。我们认为目前央行的表态偏向友好，全年实现 5% 左右仍需要货币政策配合，因此我们预计在经济数据出现明显拐点之前，宽货币政策仍可期待，利率仍有一定的下行空间。但是具体节奏不好把握，容易受到各类会议、理财申赎的影响。下半年组合会以票息策略为主，择机参与利率债波段增厚收益。

权益市场方面，目前股债商汇四类资产对未来经济增长已经较为充分定价了中国增长因子下修的悲观预期，而当前影响增长因子变化最关键的驱动是政策。后续伴随着以提振信心、达成全年经济增速目标为导向的稳增长组合拳的陆续出台，预计权益市场将处于底部水位不断抬升的存量博弈环境。当前依旧维持前期对权益市场的基准假设：“弱经济（经济弱复苏）+弱产业（产业景气度均不高）+较好的宏观流动性环境+产业政策频出”的判断，在这个基准假设下，以追逐具备确定性溢价的资产结构为主，体现在两个方面，一是产业趋势的确定性，如 AI+（长期技术革新和工业革命），二是永续经营、高现金流、高股息的资产。同时从复盘角度来看，在经济增长因子下修背景下，首先由于增长因子偏弱导致市场缺乏动量效应，导致行业轮动的速度仍将处于高位水平，其次，经济

增长因子偏弱叠加当前市场筹码结构，导致自 2021 年春节后以来小盘成长持续跑赢市场，公募基金暴露程度最高的大盘成长方向持续跑输市场。因此在基准假设下，待稳增长政策调控窗口期结束且出现市场风险偏好转向迹象时，小盘成长将是值得关注的投资机会。

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

托管人声明：

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

### 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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本中期报告中利润分配情况真实、准确。

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

本中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，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：华夏睿磐泰荣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
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	27,915,819.33	28,179,008.97
结算备付金		16,022,593.30	14,470,050.92
存出保证金		51,820.87	122,053.73
交易性金融资产	6.4.7.2	307,903,580.96	870,396,829.12
其中：股票投资		69,592,406.54	132,945,213.54
基金投资		-	-
债券投资		238,311,174.42	737,451,615.58
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		1,740,317.59	25,659,325.66
应收股利		-	-
应收申购款		18,734.75	67,817.47
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		353,652,866.80	938,895,085.87
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2022 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-

卖出回购金融资产款		42,977,645.54	-
应付清算款		12,608,216.70	-
应付赎回款		346,706.87	280,972,196.45
应付管理人报酬		217,094.62	680,548.58
应付托管费		54,273.65	170,137.14
应付销售服务费		36,358.70	80,234.57
应付投资顾问费		-	-
应交税费		16,486.26	30,054.31
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	350,475.69	1,156,175.16
负债合计		56,607,258.03	283,089,346.21
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	236,390,463.41	530,838,356.59
未分配利润	6.4.7.8	60,655,145.36	124,967,383.07
净资产合计		297,045,608.77	655,805,739.66
负债和净资产总计		353,652,866.80	938,895,085.87

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，华夏睿磐泰荣混合 A 基金份额净值 1.2660 元，华夏睿磐泰荣混合 C 基金份额净值 1.2469 元；华夏睿磐泰荣混合基金份额总额 236,390,463.41 份（其中 A 类 119,726,506.60 份，C 类 116,663,956.81 份）。

## 6.2 利润表

会计主体：华夏睿磐泰荣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
<b>一、营业总收入</b>		14,616,540.67	-7,213,061.18
1.利息收入		171,558.35	492,685.61
其中：存款利息收入	6.4.7.9	158,971.73	289,259.22
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		12,586.62	203,426.39
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		117,948.38	-12,695,908.96
其中：股票投资收益	6.4.7.10	167,565.64	-36,421,433.23
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-1,130,027.06	22,159,173.20
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	-40,805.85	113,076.14
股利收益	6.4.7.14	1,121,215.65	1,453,274.93
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	14,276,135.53	4,766,053.61
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	50,898.41	224,108.56
<b>减：二、营业总支出</b>		2,977,688.14	7,079,862.99
1.管理人报酬		1,850,872.86	4,888,995.60
2.托管费		462,718.23	1,222,248.88
3.销售服务费		319,358.58	794,973.98
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		204,419.52	-
其中：卖出回购金融资产支出		204,419.52	-
6.信用减值损失	6.4.7.17	-	-
7.税金及附加		15,529.05	41,071.13
8.其他费用	6.4.7.18	124,789.90	132,573.40
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		11,638,852.53	-14,292,924.17
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		11,638,852.53	-14,292,924.17
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		11,638,852.53	-14,292,924.17

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：华夏睿磐泰荣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）	530,838,356.59	-	124,967,383.07	655,805,739.66
二、本期期初净资产（基金净值）	530,838,356.59	-	124,967,383.07	655,805,739.66
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-294,447,893.18	-	-64,312,237.71	-358,760,130.89



(一)、综合收益总额	-	-	11,638,852.53	11,638,852.53
(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)	-294,447,893.18	-	-75,951,090.24	-370,398,983.42
其中: 1.基金申购款	62,416,511.75	-	15,867,166.80	78,283,678.55
2.基金赎回款	-356,864,404.93	-	-91,818,257.04	-448,682,661.97
(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)	236,390,463.41	-	60,655,145.36	297,045,608.77
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)	1,064,036,206.98	-	289,184,945.24	1,353,221,152.22
二、本期期初净资产(基金净值)	1,064,036,206.98	-	289,184,945.24	1,353,221,152.22
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-218,826,643.86	-	-66,932,452.15	-285,759,096.01
(一)、综合收益总额	-	-	-14,292,924.17	-14,292,924.17
(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)	-218,826,643.86	-	-52,639,527.98	-271,466,171.84
其中: 1.基金申购款	349,237,861.47	-	89,038,877.92	438,276,739.39
2.基金赎回款	-568,064,505.33	-	-141,678,405.90	-709,742,911.23
(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)	845,209,563.12	-	222,252,493.09	1,067,462,056.21

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：杨明辉，主管会计工作负责人：朱威，会计机构负责人：朱威

#### 6.4 报表附注

##### 6.4.1 基金基本情况

华夏睿磐泰荣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]1530 号《关于准予华夏睿磐泰荣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》、《华夏睿磐泰荣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 27 日至 2017 年 12 月 22 日共募集 741,167,554.31 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\_A37 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华夏睿磐泰荣混合型证券投资基金基金合同》于 2017 年 12 月 27 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 741,301,008.62 份基金份额，其中认购资金利息折合 133,454.31 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，基金托管人为招商银行股份有限公司。

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、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	27,915,819.33
等于：本金	27,915,266.20

加：应计利息	553.13
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	27,915,819.33

## 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	69,733,277.69	-	69,592,406.54	-140,871.15
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	2,409,324.42	144,881,846.20	148,157.34
	银行间市场	1,705,328.22	93,429,328.22	115,973.56
	合计	4,114,652.64	238,311,174.42	264,130.90
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	303,665,668.57	4,114,652.64	307,903,580.96	123,259.75

## 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	3.86
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	171,292.88
其中：交易所市场	170,767.88
银行间市场	525.00
应付利息	-
预提费用	179,178.95
合计	350,475.69

6.4.7.7 实收基金

华夏睿磐泰荣混合 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	283,189,992.93	283,189,992.93
本期申购	16,395,348.04	16,395,348.04
本期赎回（以“-”号填列）	-179,858,834.37	-179,858,834.37
本期末	119,726,506.60	119,726,506.60

华夏睿磐泰荣混合 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	247,648,363.66	247,648,363.66
本期申购	46,021,163.71	46,021,163.71
本期赎回（以“-”号填列）	-177,005,570.56	-177,005,570.56
本期末	116,663,956.81	116,663,956.81

6.4.7.8 未分配利润

华夏睿磐泰荣混合 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	67,952,209.02	945,964.71	68,898,173.73
本期利润	-1,234,794.56	7,191,583.57	5,956,789.01

本期基金份额交易产生的变动数	-38,643,996.09	-4,364,654.72	-43,008,650.81
其中：基金申购款	3,839,066.99	500,103.49	4,339,170.48
基金赎回款	-42,483,063.08	-4,864,758.21	-47,347,821.29
本期已分配利润	-	-	-
本期末	28,073,418.37	3,772,893.56	31,846,311.93

华夏睿磐泰荣混合 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	55,215,878.91	853,330.43	56,069,209.34
本期利润	-1,402,488.44	7,084,551.96	5,682,063.52
本期基金份额交易产生的变动数	-28,642,432.46	-4,300,006.97	-32,942,439.43
其中：基金申购款	10,123,590.68	1,404,405.64	11,527,996.32
基金赎回款	-38,766,023.14	-5,704,412.61	-44,470,435.75
本期已分配利润	-	-	-
本期末	25,170,958.01	3,637,875.42	28,808,833.43

#### 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	37,459.92
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	120,822.67
其他	689.14
合计	158,971.73

#### 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	358,447,794.08
减：卖出股票成本总额	357,588,321.97
减：交易费用	691,906.47
买卖股票差价收入	167,565.64

#### 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	5,886,433.60
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-7,016,460.66
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	-1,130,027.06

## 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	534,734,865.77
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	533,574,010.77
减：应计利息总额	8,172,115.66
减：交易费用	5,200.00
买卖债券差价收入	-7,016,460.66

## 6.4.7.12 资产支持证券投资收益

无。

## 6.4.7.13 衍生工具收益

## 6.4.7.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

## 6.4.7.13.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
股指期货投资收益	-40,805.85

## 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	1,121,215.65
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	1,121,215.65



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	14,276,135.53
——股票投资	3,685,163.27
——债券投资	10,590,972.26
——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	14,276,135.53

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	50,898.41
合计	50,898.41

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	39,671.58
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	7,008.95
银行间账户维护费	18,000.00
存托服务费	2.00
其他	600.00
合计	124,789.90

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
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	基金托管人
中信证券股份有限公司（“中信证券”）	基金管理人的股东
上海华夏财富投资管理有限公司（“华夏财富”）	基金管理人的子公司
中信证券(山东)有限责任公司（“中信证券（山东）”）	基金管理人第一大股东的子公司

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	149,364,822.98	23.10%	952,460,786.05	79.72%

###### 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	48,353,390.00	58.04%	386,346,093.46	100.00%

###### 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	336,130,000.00	12.81%	1,689,000,000.00	92.35%

#### 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	64,421.57	22.99%	-	-
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	886,991.60	83.36%	518,761.39	96.51%

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	1,850,872.86
其中：支付销售机构的客户维护费	433,273.77	846,468.64

注：①支付基金管理人的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 0.80%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

②基金管理人报酬计算公式为：日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×0.80%/当年天数。

③客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用按照代销机构所代销基金的份额保有量作为基数进行计算，从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 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	462,718.23	1,222,248.88

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

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

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得 销售 服务 费的 各关 联方 名称	本期 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		
	华夏睿磐泰荣混合 A	华夏睿磐泰荣混合 C	合计
华夏 基金 管理 有限 公司	-	94,629.55	94,629.55
招商 银行	-	7,090.06	7,090.06
华夏 财富	-	971.66	971.66
中信 证券 (山 东)	-	14.48	14.48
中信 证券	-	3.62	3.62
合计	-	102,709.37	102,709.37
获得 销售	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		

服务费的各关联方名称	华夏睿磐泰荣混合 A	华夏睿磐泰荣混合 C	合计
华夏基金管理有限 公司	-	212,913.83	212,913.83
招商银行	-	2,547.57	2,547.57
华夏财富	-	1,183.85	1,183.85
中信证券 (山东)	-	14.58	14.58
中信证券	-	3.62	3.62
合计	-	216,663.45	216,663.45

注：①支付基金销售机构的基金销售服务费按 C 类基金份额前一日基金资产净值 0.30% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给基金管理人，再由基金管理人计算并支付给各基金销售机构。

②基金销售服务费计算公式为：C 类日基金销售服务费 = 前一日 C 类基金资产净值 × 0.30% / 当年天数。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 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
招商银行活期存款	27,915,819.33	37,459.92	46,637,204.31	169,503.50

注：本基金的活期银行存款由基金托管人招商银行保管，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	301439	泓淋电力	新股发行	8,221	164,337.79
中信证券	301157	华塑科技	新股发行	1,498	84,637.00
中信证券	601916	浙商银行	配股发行	33,390	67,447.80
中信证券	603281	江瀚新材	新股发行	863	30,714.17
中信证券	001367	海森药业	新股发行	549	24,419.52
中信证券	603162	海通发展	新股发行	523	19,481.75
中信证券	001286	陕西能源	新股发行	500	4,800.00
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	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	176,222	881,110.00
中信证券	301200	大族数控	新股发行	8,566	655,812.96
中信证券	688326	经纬恒润	新股发行	5,086	615,406.00
中信证券	301109	军信股份	新股发行	12,250	426,422.50
中信证券	301302	华如科技	新股发行	4,651	241,991.53
中信证券	688150	莱特光电	新股发行	5,626	124,053.30
中信证券	688290	景业智能	新股发行	3,040	103,025.60
中信证券	603132	金徽股份	新股发行	1,342	14,493.60
中信证券	603191	望变电气	新股发行	1,149	13,627.14

中信证券	603209	兴通股份	新股发行	595	12,804.40
中信证券	001266	宏英智能	新股发行	247	9,536.67
中信证券	603215	比依股份	新股发行	575	7,187.50
中信证券	603051	鹿山新材	新股发行	272	7,014.88

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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
301358	湖南裕能	2023-02-01	6 个月	新发流通受限	23.77	42.89	920	21,868.40	39,458.80	-
301303	真兰仪表	2023-02-13	6 个月	新发流通受限	26.80	22.32	1,058	28,354.40	23,614.56	-
301317	鑫磊股份	2023-01-12	6 个月	新发流通受限	20.67	26.17	694	14,344.98	18,161.98	-
301246	宏源药业	2023-03-10	6 个月	新发流通受限	50.00	30.71	577	28,850.00	17,719.67	-
301439	泓淋电力	2023-03-10	6 个月	新发流通受限	19.99	16.90	823	16,451.77	13,908.70	-
001287	中电港	2023-03-30	6 个月	新发流通受限	11.88	21.02	661	7,852.68	13,894.22	-
301141	中科磁业	2023-03-27	6 个月	新发流通受限	41.20	42.69	262	10,794.40	11,184.78	-
301386	未来电器	2023-03-21	6 个月	新发流通受限	29.99	23.79	378	11,336.22	8,992.62	-

301345	涛涛车业	2023-03-10	6 个月	新发 流通 受限	73.45	46.64	183	13,441.35	8,535.12	-
301281	科源制药	2023-03-28	6 个月	新发 流通 受限	44.18	25.10	338	10,647.38	8,483.80	含 证 券 送 配
301157	华塑科技	2023-03-01	6 个月	新发 流通 受限	56.50	52.93	150	8,475.00	7,939.50	-
301203	国泰环保	2023-03-28	6 个月	新发 流通 受限	46.13	34.40	225	10,379.25	7,740.00	-
001328	登康口腔	2023-03-29	6 个月	新发 流通 受限	20.68	25.49	145	2,998.60	3,696.05	-
001367	海森药业	2023-03-30	6 个月	新发 流通 受限	44.48	39.48	55	2,446.40	2,171.40	-
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券 代码	证券 名称	成功 认购日	受限期	流通 受限 类型	认购 价格	期末估 值单价	数量(张)	期末 成本总额	期末 估值总额	备注
127086	恒邦转债	2023-06-12	1 个月 内(含)	新发 流通 受限	100.00	100.01	239	23,900.00	23,901.99	期 末 估 值 单 价 为 含 息 价 格

注：①根据中国证监会《上市公司证券发行注册管理办法》，基金参与上市公司向特定对象发行股票所获得的股票，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设定限售期的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 6 月 30 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 42,977,645.54 元，于 2023 年 7 月 3 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

#### 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	27,915,819.33	-	-	27,915,819.33
结算备付金	16,022,593.30	-	-	16,022,593.30
结算保证金	51,820.87	-	-	51,820.87
债券投资	93,462,119.64	133,724,750.68	11,124,304.10	238,311,174.42
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	42,977,645.54	-	-	42,977,645.54
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	28,179,008.97	-	-	28,179,008.97
结算备付金	14,470,050.92	-	-	14,470,050.92
结算保证金	122,053.73	-	-	122,053.73
债券投资	110,703,222.71	595,986,173.28	30,762,219.59	737,451,615.58
资产支持证券	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-
应收直销申购款	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	利率下降 25 个基点	917,529.97	4,218,724.93
	利率上升 25 个基点	-910,210.67	-4,174,871.80

#### 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	69,592,406.54	23.43	132,945,213.54	20.27
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	342,061.34	0.12	113,529.29	0.02
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	69,934,467.88	23.54	133,058,742.83	20.29

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%	-2,752,263.98	-6,129,568.76
	+5%	2,752,263.98	6,129,568.76

#### 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	69,725,064.69
第二层次	237,993,015.07
第三层次	185,501.20
合计	307,903,580.96

#### 6.4.14.2 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	69,592,406.54	19.68
	其中：股票	69,592,406.54	19.68
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	238,311,174.42	67.39
	其中：债券	238,311,174.42	67.39
	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	43,938,412.63	12.42
8	其他各项资产	1,810,873.21	0.51
9	合计	353,652,866.80	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	1,138,763.00	0.38
B	采矿业	6,193,376.40	2.08
C	制造业	37,502,582.26	12.63
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,801,599.00	0.94
E	建筑业	2,148,623.00	0.72
F	批发和零售业	1,472,372.48	0.50
G	交通运输、仓储和邮政业	1,552,302.80	0.52
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,775,787.80	1.61
J	金融业	5,691,939.40	1.92
K	房地产业	3,094,791.00	1.04
L	租赁和商务服务业	498,545.00	0.17
M	科学研究和技术服务业	1,618,505.40	0.54
N	水利、环境和公共设施管理业	445,756.00	0.15
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	72,428.00	0.02
Q	卫生和社会工作	126,798.00	0.04
R	文化、体育和娱乐业	458,237.00	0.15
S	综合	-	-
	合计	69,592,406.54	23.43

## 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	600547	山东黄金	56,400	1,324,272.00	0.45
2	000975	银泰黄金	94,422	1,104,737.40	0.37
3	600489	中金黄金	105,500	1,089,815.00	0.37
4	600941	中国移动	7,300	681,090.00	0.23
5	601857	中国石油	76,500	571,455.00	0.19
6	600060	海信视像	21,600	534,600.00	0.18
7	600050	中国联通	111,100	533,280.00	0.18
8	600066	宇通客车	35,900	529,166.00	0.18

9	002422	科伦药业	17,500	519,400.00	0.17
10	600938	中国海油	26,700	483,804.00	0.16
11	600674	川投能源	29,700	446,985.00	0.15
12	600028	中国石化	69,900	444,564.00	0.15
13	601336	新华保险	11,300	415,501.00	0.14
14	001914	招商积余	26,700	401,835.00	0.14
15	601390	中国中铁	51,900	393,402.00	0.13
16	001979	招商蛇口	30,100	392,203.00	0.13
17	601186	中国铁建	39,700	391,045.00	0.13
18	601155	新城控股	26,900	387,629.00	0.13
19	601728	中国电信	67,700	381,151.00	0.13
20	603156	养元饮品	15,300	377,910.00	0.13
21	600048	保利发展	28,900	376,567.00	0.13
22	600325	华发股份	38,200	376,270.00	0.13
23	601318	中国平安	8,100	375,840.00	0.13
24	301039	中集车辆	26,500	350,595.00	0.12
25	002367	康力电梯	37,000	337,810.00	0.11
26	600919	江苏银行	44,800	329,280.00	0.11
27	003006	百亚股份	18,800	324,864.00	0.11
28	002772	众兴菌业	28,400	320,920.00	0.11
29	600761	安徽合力	15,800	314,894.00	0.11
30	601163	三角轮胎	19,800	314,226.00	0.11
31	601619	嘉泽新能	68,700	312,585.00	0.11
32	000048	京基智农	16,000	312,320.00	0.11
33	300979	华利集团	6,400	311,936.00	0.11
34	600377	宁沪高速	31,300	307,679.00	0.10
35	603878	武进不锈	36,220	306,059.00	0.10
36	002489	浙江永强	75,300	304,965.00	0.10
37	600251	冠农股份	33,700	304,311.00	0.10
38	000517	荣安地产	98,800	301,340.00	0.10
39	002832	比音勒芬	8,400	297,444.00	0.10
40	002233	塔牌集团	38,300	295,676.00	0.10
41	600639	浦东金桥	23,500	291,635.00	0.10
42	603518	锦泓集团	25,400	288,290.00	0.10
43	000906	浙商中拓	32,300	288,116.00	0.10
44	600035	楚天高速	70,500	287,640.00	0.10
45	603565	中谷物流	26,400	285,120.00	0.10
46	300908	仲景食品	6,100	276,635.00	0.09
47	003011	海象新材	8,400	270,900.00	0.09
48	300888	稳健医疗	6,400	266,688.00	0.09
49	600612	老凤祥	3,800	265,544.00	0.09
50	000937	冀中能源	41,100	262,218.00	0.09
51	600926	杭州银行	22,200	260,850.00	0.09

52	000921	海信家电	9,600	258,720.00	0.09
53	601288	农业银行	72,500	255,925.00	0.09
54	601328	交通银行	44,000	255,200.00	0.09
55	601668	中国建筑	44,200	253,708.00	0.09
56	002448	中原内配	36,200	253,400.00	0.09
57	300146	汤臣倍健	10,500	251,790.00	0.08
58	603105	芯能科技	14,900	251,661.00	0.08
59	600642	申能股份	36,000	251,640.00	0.08
60	601169	北京银行	54,100	250,483.00	0.08
61	600863	内蒙华电	60,000	249,000.00	0.08
62	002966	苏州银行	38,000	248,900.00	0.08
63	600583	海油工程	42,300	247,455.00	0.08
64	600016	民生银行	65,800	246,750.00	0.08
65	000001	平安银行	21,900	245,937.00	0.08
66	002404	嘉欣丝绸	36,400	245,336.00	0.08
67	002714	牧原股份	5,800	244,470.00	0.08
68	601117	中国化学	29,500	244,260.00	0.08
69	605077	华康股份	9,200	243,616.00	0.08
70	601658	邮储银行	49,800	243,522.00	0.08
71	600089	特变电工	10,900	242,961.00	0.08
72	600729	重庆百货	7,700	242,088.00	0.08
73	300433	蓝思科技	20,500	241,080.00	0.08
74	600580	卧龙电驱	16,500	241,065.00	0.08
75	600531	豫光金铅	38,000	239,400.00	0.08
76	603693	江苏新能	17,000	238,000.00	0.08
77	600598	北大荒	17,800	237,274.00	0.08
78	600803	新奥股份	12,500	237,250.00	0.08
79	000538	云南白药	4,500	236,160.00	0.08
80	002959	小熊电器	2,800	233,800.00	0.08
81	000728	国元证券	35,800	233,416.00	0.08
82	000739	普洛药业	13,000	230,620.00	0.08
83	000783	长江证券	39,700	230,260.00	0.08
84	600909	华安证券	49,300	230,231.00	0.08
85	601916	浙商银行	86,790	229,125.60	0.08
86	601555	东吴证券	32,900	228,326.00	0.08
87	002154	报喜鸟	41,300	227,976.00	0.08
88	000623	吉林敖东	14,100	226,164.00	0.08
89	605009	豪悦护理	4,700	225,600.00	0.08
90	600266	城建发展	44,200	224,536.00	0.08
91	600483	福能股份	19,300	222,915.00	0.08
92	601319	中国人保	38,100	222,504.00	0.07
93	002345	潮宏基	28,300	222,438.00	0.07
94	600248	陕建股份	46,200	220,374.00	0.07



95	002275	桂林三金	12,100	217,921.00	0.07
96	600211	西藏药业	3,600	213,840.00	0.07
97	300203	聚光科技	10,500	212,835.00	0.07
98	300012	华测检测	10,900	212,550.00	0.07
99	603757	大元泵业	7,100	211,864.00	0.07
100	601138	工业富联	8,400	211,680.00	0.07
101	000338	潍柴动力	16,900	210,574.00	0.07
102	603129	春风动力	1,300	210,470.00	0.07
103	600438	通威股份	6,100	209,291.00	0.07
104	002847	盐津铺子	2,450	208,372.50	0.07
105	000651	格力电器	5,664	206,792.64	0.07
106	300002	神州泰岳	14,700	205,800.00	0.07
107	000065	北方国际	13,700	205,774.00	0.07
108	000543	皖能电力	31,100	205,260.00	0.07
109	301046	能辉科技	6,200	202,740.00	0.07
110	600971	恒源煤电	25,700	200,203.00	0.07
111	002429	兆驰股份	36,100	198,550.00	0.07
112	300009	安科生物	19,700	197,000.00	0.07
113	688357	建龙微纳	3,020	195,363.80	0.07
114	601766	中国中车	30,000	195,000.00	0.07
115	000333	美的集团	3,300	194,436.00	0.07
116	605167	利柏特	19,900	192,632.00	0.06
117	002419	天虹股份	32,000	187,200.00	0.06
118	600461	洪城环境	22,900	187,093.00	0.06
119	002415	海康威视	5,600	185,416.00	0.06
120	002536	飞龙股份	12,300	184,500.00	0.06
121	688223	晶科能源	13,100	184,186.00	0.06
122	002335	科华数据	5,100	183,345.00	0.06
123	430418	苏轴股份	11,200	182,448.00	0.06
124	603136	天目湖	6,900	178,020.00	0.06
125	000625	长安汽车	13,000	168,090.00	0.06
126	688315	诺禾致源	6,300	167,265.00	0.06
127	002518	科士达	4,100	164,041.00	0.06
128	601601	中国太保	6,300	163,674.00	0.06
129	603345	安井食品	1,100	161,480.00	0.05
130	001322	箭牌家居	9,600	160,704.00	0.05
131	300515	三德科技	9,900	159,588.00	0.05
132	002027	分众传媒	23,400	159,354.00	0.05
133	002371	北方华创	500	158,825.00	0.05
134	300532	今天国际	7,600	156,256.00	0.05
135	601137	博威合金	10,000	155,600.00	0.05
136	300842	帝科股份	1,700	155,448.00	0.05
137	300990	同飞股份	3,060	153,918.00	0.05

138	603298	杭叉集团	6,500	153,075.00	0.05
139	002056	横店东磁	8,400	152,964.00	0.05
140	688569	铁科轨道	3,600	151,452.00	0.05
141	300795	米奥会展	3,600	150,156.00	0.05
142	002402	和而泰	8,700	147,726.00	0.05
143	600600	青岛啤酒	1,400	145,082.00	0.05
144	600312	平高电气	11,400	141,246.00	0.05
145	603050	科林电气	8,660	139,512.60	0.05
146	300750	宁德时代	600	137,274.00	0.05
147	002050	三花智控	4,500	136,170.00	0.05
148	300349	金卡智能	9,800	136,024.00	0.05
149	603529	爱玛科技	4,200	135,324.00	0.05
150	300855	图南股份	3,810	134,569.20	0.05
151	002737	葵花药业	5,500	133,870.00	0.05
152	688186	广大特材	4,100	133,373.00	0.04
153	600570	恒生电子	3,000	132,870.00	0.04
154	002033	丽江股份	11,900	129,472.00	0.04
155	832419	路斯股份	18,400	126,960.00	0.04
156	605599	菜百股份	9,600	126,816.00	0.04
157	300396	迪瑞医疗	3,900	126,711.00	0.04
158	603901	永创智能	8,600	125,216.00	0.04
159	300314	戴维医疗	5,900	124,726.00	0.04
160	000425	徐工机械	18,100	122,537.00	0.04
161	002283	天润工业	19,000	121,980.00	0.04
162	600415	小商品城	14,300	121,979.00	0.04
163	603368	柳药集团	4,900	121,079.00	0.04
164	600757	长江传媒	13,900	119,540.00	0.04
165	838171	邦德股份	13,100	118,293.00	0.04
166	600690	海尔智家	5,000	117,400.00	0.04
167	600879	航天电子	13,800	117,162.00	0.04
168	835174	五新隧装	14,000	115,220.00	0.04
169	600419	天润乳业	7,100	115,162.00	0.04
170	300582	英飞特	8,400	113,988.00	0.04
171	605336	帅丰电器	6,600	113,520.00	0.04
172	000923	河钢资源	8,400	113,400.00	0.04
173	601877	正泰电器	4,100	113,365.00	0.04
174	002929	润建股份	2,600	112,866.00	0.04
175	872925	锦好医疗	11,900	112,812.00	0.04
176	600888	新疆众和	14,200	112,464.00	0.04
177	300511	雪榕生物	14,500	110,200.00	0.04
178	600487	亨通光电	7,500	109,950.00	0.04
179	001223	欧克科技	1,200	109,188.00	0.04
180	301096	百诚医药	1,800	109,098.00	0.04

181	000636	风华高科	7,100	108,914.00	0.04
182	000630	铜陵有色	37,600	108,664.00	0.04
183	600219	南山铝业	35,900	108,418.00	0.04
184	601006	大秦铁路	14,500	107,735.00	0.04
185	600129	太极集团	1,800	107,082.00	0.04
186	603230	内蒙新华	8,300	107,070.00	0.04
187	600548	深高速	11,900	106,862.00	0.04
188	300911	亿田智能	2,800	106,316.00	0.04
189	300258	精锻科技	7,300	105,777.00	0.04
190	600073	上海梅林	14,400	105,120.00	0.04
191	601066	中信建投	4,300	104,060.00	0.04
192	000400	许继电气	4,500	103,725.00	0.03
193	688248	南网科技	2,700	103,653.00	0.03
194	600998	九州通	9,977	103,561.26	0.03
195	002594	比亚迪	400	103,308.00	0.03
196	002865	钧达股份	676	103,110.28	0.03
197	603688	石英股份	900	102,456.00	0.03
198	601881	中国银河	8,800	102,168.00	0.03
199	603198	迎驾贡酒	1,600	102,080.00	0.03
200	600332	白云山	3,200	102,016.00	0.03
201	601688	华泰证券	7,400	101,898.00	0.03
202	601377	兴业证券	16,600	101,592.00	0.03
203	603027	千禾味业	4,800	101,376.00	0.03
204	002945	华林证券	7,400	101,232.00	0.03
205	600958	东方证券	10,400	100,880.00	0.03
206	601788	光大证券	6,300	100,107.00	0.03
207	300206	理邦仪器	6,600	99,528.00	0.03
208	300059	东方财富	7,000	99,400.00	0.03
209	000596	古井贡酒	400	98,952.00	0.03
210	601919	中远海控	10,500	98,700.00	0.03
211	000776	广发证券	6,700	98,557.00	0.03
212	688318	财富趋势	980	97,970.60	0.03
213	002727	一心堂	3,700	97,680.00	0.03
214	601689	拓普集团	1,200	96,840.00	0.03
215	000807	云铝股份	7,500	95,475.00	0.03
216	002403	爱仕达	9,400	94,752.00	0.03
217	600373	中文传媒	7,100	94,572.00	0.03
218	688111	金山办公	200	94,444.00	0.03
219	000913	钱江摩托	5,100	92,973.00	0.03
220	601567	三星医疗	7,300	92,199.00	0.03
221	605289	罗曼股份	2,400	91,944.00	0.03
222	300467	迅游科技	4,500	91,935.00	0.03
223	002786	银宝山新	14,200	91,590.00	0.03

224	002158	汉钟精机	3,600	89,856.00	0.03
225	002439	启明星辰	3,000	89,280.00	0.03
226	300051	三五互联	7,100	89,105.00	0.03
227	002697	红旗连锁	15,200	88,768.00	0.03
228	603357	设计总院	8,420	88,410.00	0.03
229	002624	完美世界	5,200	87,828.00	0.03
230	600469	风神股份	13,600	87,584.00	0.03
231	601369	陕鼓动力	9,600	87,456.00	0.03
232	300951	博硕科技	1,600	87,408.00	0.03
233	603596	伯特利	1,100	87,186.00	0.03
234	603803	瑞斯康达	9,200	86,664.00	0.03
235	301079	邵阳液压	4,060	86,559.20	0.03
236	600031	三一重工	5,200	86,476.00	0.03
237	605499	东鹏饮料	500	86,450.00	0.03
238	600933	爱柯迪	3,700	86,173.00	0.03
239	688131	皓元医药	1,500	85,470.00	0.03
240	603786	科博达	1,300	85,410.00	0.03
240	000719	中原传媒	7,300	85,410.00	0.03
242	002444	巨星科技	3,900	85,332.00	0.03
243	000725	京东方 A	20,800	85,072.00	0.03
244	603369	今世缘	1,600	84,480.00	0.03
245	600860	京城股份	6,500	84,370.00	0.03
246	300360	炬华科技	4,700	84,036.00	0.03
247	002747	埃斯顿	3,000	84,000.00	0.03
248	600892	大晟文化	12,700	83,947.00	0.03
249	601126	四方股份	5,500	83,545.00	0.03
250	002965	祥鑫科技	1,500	83,520.00	0.03
251	003816	中国广核	26,800	83,348.00	0.03
252	000521	长虹美菱	10,900	83,276.00	0.03
253	002997	瑞鹄模具	2,800	83,244.00	0.03
254	600525	长园集团	14,100	82,908.00	0.03
255	002940	昂利康	4,300	82,603.00	0.03
256	300885	海昌新材	7,925	82,499.25	0.03
257	600353	旭光电子	10,060	82,492.00	0.03
258	000599	青岛双星	19,300	82,411.00	0.03
259	002299	圣农发展	4,300	82,345.00	0.03
260	000858	五粮液	500	81,785.00	0.03
261	301051	信濠光电	1,350	81,661.50	0.03
262	300132	青松股份	14,400	81,648.00	0.03
263	603279	景津装备	2,600	81,536.00	0.03
263	002334	英威腾	6,400	81,536.00	0.03
265	600498	烽火通信	4,000	81,480.00	0.03
266	002244	滨江集团	9,200	81,144.00	0.03

267	600375	汉马科技	10,700	81,106.00	0.03
268	301168	通灵股份	1,300	80,990.00	0.03
269	002162	悦心健康	18,000	80,820.00	0.03
270	603289	泰瑞机器	7,200	80,784.00	0.03
271	002893	京能热力	7,500	80,775.00	0.03
272	300490	华自科技	4,700	80,652.00	0.03
273	600665	天地源	19,900	80,595.00	0.03
274	600686	金龙汽车	9,900	80,586.00	0.03
275	601633	长城汽车	3,200	80,544.00	0.03
276	688296	和达科技	4,500	80,325.00	0.03
277	002938	鹏鼎控股	3,300	80,157.00	0.03
278	603499	翔港科技	8,400	80,136.00	0.03
279	603063	禾望电气	2,600	79,950.00	0.03
280	002129	TCL 中环	2,400	79,680.00	0.03
281	000404	长虹华意	11,500	79,580.00	0.03
282	300390	天华新能	2,220	79,476.00	0.03
283	603990	麦迪科技	3,600	79,380.00	0.03
284	300464	星徽股份	11,900	79,373.00	0.03
285	300530	领湃科技	3,500	79,240.00	0.03
286	002947	恒铭达	3,800	79,192.00	0.03
287	300157	恒泰艾普	24,500	78,890.00	0.03
288	603639	海利尔	4,400	78,848.00	0.03
289	002775	文科园林	21,000	78,750.00	0.03
290	605507	国邦医药	3,700	78,699.00	0.03
291	603161	科华控股	5,400	78,678.00	0.03
292	001266	宏英智能	2,700	78,435.00	0.03
293	002840	华统股份	5,000	78,200.00	0.03
294	600097	开创国际	8,200	78,146.00	0.03
295	603536	惠发食品	12,100	77,924.00	0.03
296	002920	德赛西威	500	77,905.00	0.03
297	002209	达意隆	7,600	77,900.00	0.03
298	002471	中超控股	29,100	77,697.00	0.03
299	300407	凯发电气	8,500	77,605.00	0.03
300	300462	华铭智能	6,600	77,484.00	0.03
301	603378	亚士创能	8,500	77,435.00	0.03
302	600198	大唐电信	11,300	77,405.00	0.03
303	002512	达华智能	19,300	77,393.00	0.03
304	002652	扬子新材	29,300	77,352.00	0.03
305	002583	海能达	13,300	77,273.00	0.03
306	300112	万讯自控	7,000	77,140.00	0.03
307	600797	浙大网新	10,800	77,112.00	0.03
308	000933	神火股份	5,900	76,700.00	0.03
309	600513	联环药业	7,900	76,314.00	0.03

310	688175	高凌信息	2,300	76,176.00	0.03
311	600119	长江投资	12,900	75,981.00	0.03
312	002718	友邦吊顶	5,000	75,800.00	0.03
313	600967	内蒙一机	7,500	75,750.00	0.03
314	603556	海兴电力	3,000	75,720.00	0.03
315	300863	卡倍亿	1,200	75,492.00	0.03
316	002532	天山铝业	12,600	75,474.00	0.03
317	600929	雪天盐业	9,500	75,430.00	0.03
318	603689	皖天然气	8,600	75,422.00	0.03
319	002269	美邦服饰	48,000	75,360.00	0.03
320	603115	海星股份	4,900	75,313.00	0.03
321	300835	龙磁科技	2,400	75,312.00	0.03
322	002237	恒邦股份	6,900	75,141.00	0.03
323	002384	东山精密	2,900	75,110.00	0.03
324	301070	开勒股份	2,000	74,800.00	0.03
324	600188	兖矿能源	2,500	74,800.00	0.03
326	000852	石化机械	10,400	74,776.00	0.03
327	603086	先达股份	10,900	74,665.00	0.03
328	300419	浩丰科技	11,900	74,494.00	0.03
329	600012	皖通高速	7,100	74,408.00	0.03
330	601113	华鼎股份	22,900	74,196.00	0.02
331	601799	星宇股份	600	74,160.00	0.02
332	603858	步长制药	3,600	74,124.00	0.02
333	605155	西大门	5,100	74,001.00	0.02
334	600502	安徽建工	14,000	73,920.00	0.02
335	000534	万泽股份	4,400	73,788.00	0.02
336	688190	云路股份	1,000	73,000.00	0.02
337	603969	银龙股份	15,800	72,996.00	0.02
338	300876	蒙泰高新	2,800	72,940.00	0.02
339	300554	三超新材	3,500	72,905.00	0.02
340	301077	星华新材	3,400	72,862.00	0.02
341	300609	汇纳科技	2,600	72,800.00	0.02
342	000862	银星能源	9,500	72,770.00	0.02
343	300405	科隆股份	13,300	72,751.00	0.02
344	000498	山东路桥	11,300	72,546.00	0.02
345	002581	未名医药	3,800	72,542.00	0.02
346	688009	中国通号	12,500	72,500.00	0.02
347	600661	昂立教育	7,600	72,428.00	0.02
348	000908	景峰医药	28,600	72,358.00	0.02
349	300242	佳云科技	20,900	72,105.00	0.02
350	300449	汉邦高科	10,800	72,036.00	0.02
351	002105	信隆健康	12,100	71,995.00	0.02
352	600741	华域汽车	3,900	71,994.00	0.02

353	605368	蓝天燃气	7,500	71,775.00	0.02
354	688777	中控技术	1,140	71,569.20	0.02
355	300894	火星人	2,800	71,512.00	0.02
356	300729	乐歌股份	4,000	71,360.00	0.02
357	300119	瑞普生物	4,000	71,200.00	0.02
358	301327	华宝新能	900	71,199.00	0.02
359	001313	粤海饲料	9,000	71,100.00	0.02
360	300787	海能实业	3,600	70,920.00	0.02
361	300777	中简科技	1,500	70,890.00	0.02
362	002597	金禾实业	3,000	70,800.00	0.02
363	300674	宇信科技	4,000	70,720.00	0.02
364	300642	透景生命	3,500	70,595.00	0.02
365	603511	爱慕股份	4,100	70,520.00	0.02
366	600512	腾达建设	26,300	70,484.00	0.02
367	002980	华盛昌	2,100	70,266.00	0.02
368	600784	鲁银投资	9,700	70,228.00	0.02
369	688305	科德数控	700	70,182.00	0.02
370	301228	实朴检测	4,500	70,110.00	0.02
371	688533	上声电子	1,500	70,095.00	0.02
372	600481	双良节能	5,000	69,900.00	0.02
373	002688	金河生物	14,800	69,856.00	0.02
374	301195	北路智控	1,500	69,840.00	0.02
375	603551	奥普家居	5,400	69,822.00	0.02
376	300773	拉卡拉	4,000	69,760.00	0.02
377	002970	锐明技术	2,200	69,278.00	0.02
378	603633	徕木股份	5,300	69,271.00	0.02
379	002459	晶澳科技	1,660	69,222.00	0.02
380	002600	领益智造	10,000	69,100.00	0.02
381	000555	神州信息	5,600	68,880.00	0.02
382	688658	悦康药业	3,300	68,673.00	0.02
383	300440	运达科技	9,700	68,579.00	0.02
384	300614	百川畅银	2,500	68,475.00	0.02
385	300772	运达股份	5,300	68,264.00	0.02
386	601899	紫金矿业	6,000	68,220.00	0.02
387	600180	瑞茂通	11,400	68,172.00	0.02
388	000778	新兴铸管	16,700	68,136.00	0.02
389	603882	金域医学	900	67,950.00	0.02
390	688408	中信博	800	67,464.00	0.02
391	603322	超讯通信	2,300	67,344.00	0.02
392	301013	利和兴	4,700	67,210.00	0.02
393	000785	居然之家	17,600	67,056.00	0.02
394	301221	光庭信息	1,200	66,996.00	0.02
395	600566	济川药业	2,300	66,792.00	0.02

396	600681	百川能源	14,300	66,781.00	0.02
397	300259	新天科技	16,600	66,566.00	0.02
398	301196	唯科科技	1,957	66,440.15	0.02
399	603920	世运电路	3,400	66,402.00	0.02
400	601000	唐山港	18,800	66,364.00	0.02
401	688365	光云科技	4,600	66,332.00	0.02
402	002478	常宝股份	8,900	66,305.00	0.02
403	603516	淳中科技	3,000	66,150.00	0.02
404	833533	骏创科技	4,500	66,015.00	0.02
405	603619	中曼石油	3,900	65,988.00	0.02
406	600901	江苏金租	15,960	65,914.80	0.02
407	688621	阳光诺和	1,120	65,878.40	0.02
408	605399	晨光新材	3,700	65,860.00	0.02
409	301121	紫建电子	1,300	65,832.00	0.02
410	002304	洋河股份	500	65,675.00	0.02
411	600584	长电科技	2,100	65,457.00	0.02
412	300970	华绿生物	2,800	65,408.00	0.02
413	301236	软通动力	2,400	65,304.00	0.02
414	603507	振江股份	1,800	65,268.00	0.02
414	300872	天阳科技	4,200	65,268.00	0.02
416	600887	伊利股份	2,300	65,136.00	0.02
417	001308	康冠科技	2,370	65,080.20	0.02
418	002381	双箭股份	8,400	64,848.00	0.02
419	832000	安徽凤凰	12,300	64,821.00	0.02
420	603222	济民医疗	6,200	64,666.00	0.02
421	002638	勤上股份	19,300	64,269.00	0.02
422	600285	羚锐制药	4,000	64,240.00	0.02
423	605158	华达新材	8,400	63,840.00	0.02
424	002952	亚世光电	3,600	63,828.00	0.02
425	300766	每日互动	3,800	63,688.00	0.02
426	833427	华维设计	11,800	63,602.00	0.02
427	601958	金钼股份	5,700	63,555.00	0.02
428	836260	中寰股份	12,500	63,500.00	0.02
429	834415	恒拓开源	16,100	63,434.00	0.02
430	001218	丽臣实业	2,800	63,308.00	0.02
431	603328	依顿电子	7,626	63,143.28	0.02
432	838924	广脉科技	10,200	63,036.00	0.02
433	836263	中航泰达	12,900	62,049.00	0.02
434	830839	万通液压	8,800	61,688.00	0.02
435	300996	普联软件	2,000	61,400.00	0.02
436	832735	德源药业	2,600	61,308.00	0.02
437	000885	城发环境	4,600	61,226.00	0.02
438	688670	金迪克	1,300	61,204.00	0.02



439	831039	国义招标	12,000	61,080.00	0.02
440	688338	赛科希德	1,100	60,995.00	0.02
441	603367	辰欣药业	4,000	60,720.00	0.02
442	300579	数字认证	2,100	60,690.00	0.02
443	002133	广宇集团	17,900	60,681.00	0.02
444	000014	沙河股份	5,300	60,632.00	0.02
445	688266	泽璟制药	1,300	60,515.00	0.02
446	834475	三友科技	8,400	60,480.00	0.02
447	001269	欧晶科技	820	60,294.60	0.02
448	603171	税友股份	1,500	59,970.00	0.02
449	600658	电子城	10,800	59,724.00	0.02
450	603667	五洲新春	4,000	59,520.00	0.02
451	002131	利欧股份	25,800	59,340.00	0.02
452	301367	怡和嘉业	400	59,336.00	0.02
453	688378	奥来德	1,200	59,280.00	0.02
453	603519	立霸股份	4,000	59,280.00	0.02
455	002821	凯莱英	500	58,930.00	0.02
456	301239	普瑞眼科	600	58,848.00	0.02
457	832225	利通科技	6,200	58,342.00	0.02
458	002746	仙坛股份	7,400	58,312.00	0.02
459	600728	佳都科技	8,400	58,212.00	0.02
460	002728	特一药业	3,780	57,645.00	0.02
461	688722	同益中	3,100	57,474.00	0.02
462	301330	熵基科技	1,600	57,248.00	0.02
463	301026	浩通科技	1,600	57,152.00	0.02
464	688711	宏微科技	978	57,056.52	0.02
465	832876	慧为智能	6,734	56,834.96	0.02
466	688516	奥特维	300	56,520.00	0.02
467	002185	华天科技	6,100	56,120.00	0.02
468	600150	中国船舶	1,700	55,947.00	0.02
469	601086	国芳集团	12,500	55,625.00	0.02
470	603191	望变电气	2,800	54,460.00	0.02
471	836270	天铭科技	3,800	54,416.00	0.02
472	688132	邦彦技术	2,000	54,360.00	0.02
473	605259	绿田机械	1,400	54,348.00	0.02
474	301256	华融化学	6,100	54,046.00	0.02
475	603215	比依股份	3,000	53,820.00	0.02
476	301029	怡合达	1,200	53,616.00	0.02
477	688033	天宜上佳	2,800	53,536.00	0.02
478	300161	华中数控	1,000	53,520.00	0.02
479	301080	百普赛斯	850	53,397.00	0.02
480	834639	晨光电缆	14,000	53,200.00	0.02
481	301363	美好医疗	1,200	52,788.00	0.02

482	833943	优机股份	7,440	52,526.40	0.02
483	601868	中国能建	22,400	52,416.00	0.02
484	301116	益客食品	3,400	52,360.00	0.02
485	601801	皖新传媒	5,500	51,645.00	0.02
486	603856	东宏股份	3,900	51,441.00	0.02
487	872374	云里物里	6,300	51,219.00	0.02
488	688737	中自科技	1,300	50,687.00	0.02
489	002529	海源复材	3,300	50,655.00	0.02
490	603966	法兰泰克	4,000	50,520.00	0.02
491	603209	兴通股份	2,380	50,479.80	0.02
492	600927	永安期货	3,100	50,406.00	0.02
493	301286	侨源股份	1,700	50,150.00	0.02
494	603187	海容冷链	2,500	49,975.00	0.02
495	603259	药明康德	800	49,848.00	0.02
496	301006	迈拓股份	1,900	49,685.00	0.02
497	300997	欢乐家	3,400	49,538.00	0.02
498	688425	铁建重工	10,200	49,062.00	0.02
499	601058	赛轮轮胎	4,300	48,977.00	0.02
500	603283	赛腾股份	1,100	48,950.00	0.02
501	834062	科润智控	9,600	48,672.00	0.02
502	688253	英诺特	2,000	48,600.00	0.02
503	601717	郑煤机	3,900	48,555.00	0.02
504	301043	绿岛风	1,500	47,955.00	0.02
505	300092	科新机电	2,900	47,560.00	0.02
506	603102	百合股份	1,100	47,509.00	0.02
507	300887	谱尼测试	1,200	47,496.00	0.02
508	300416	苏试试验	2,100	45,276.00	0.02
509	002332	仙琚制药	3,400	45,050.00	0.02
510	002837	英维克	1,500	44,910.00	0.02
511	688121	卓然股份	1,200	44,880.00	0.02
512	688100	威胜信息	1,500	44,715.00	0.02
513	688799	华纳药厂	1,100	44,682.00	0.02
514	301087	可孚医疗	900	44,370.00	0.01
515	301358	湖南裕能	920	39,458.80	0.01
516	688419	耐科装备	900	38,322.00	0.01
517	301089	拓新药业	600	37,164.00	0.01
518	688078	龙软科技	700	36,085.00	0.01
519	688661	和林微纳	500	35,150.00	0.01
520	601872	招商轮船	5,200	30,108.00	0.01
521	301303	真兰仪表	1,058	23,614.56	0.01
522	301317	鑫磊股份	694	18,161.98	0.01
523	301246	宏源药业	577	17,719.67	0.01
524	300757	罗博特科	200	17,602.00	0.01

525	603338	浙江鼎力	300	16,803.00	0.01
526	600038	中直股份	400	15,928.00	0.01
527	603589	口子窖	300	14,805.00	0.00
528	301439	泓淋电力	823	13,908.70	0.00
529	001287	中电港	661	13,894.22	0.00
530	301141	中科磁业	262	11,184.78	0.00
531	301386	未来电器	378	8,992.62	0.00
532	301345	涛涛车业	183	8,535.12	0.00
533	301281	科源制药	338	8,483.80	0.00
534	301157	华塑科技	150	7,939.50	0.00
535	301203	国泰环保	225	7,740.00	0.00
536	601222	林洋能源	800	6,552.00	0.00
537	603237	五芳斋	140	4,246.20	0.00
538	001328	登康口腔	145	3,696.05	0.00
539	002085	万丰奥威	500	3,465.00	0.00
540	001367	海森药业	55	2,171.40	0.00
541	002895	川恒股份	100	1,970.00	0.00

#### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600547	山东黄金	4,222,150.00	0.64
2	600489	中金黄金	3,962,373.00	0.60
3	000975	银泰黄金	3,943,723.86	0.60
4	300750	宁德时代	2,737,520.00	0.42
5	601155	新城控股	2,489,607.00	0.38
6	600988	赤峰黄金	1,828,738.00	0.28
7	300059	东方财富	1,810,701.00	0.28
8	300760	迈瑞医疗	1,461,068.00	0.22
9	300003	乐普医疗	1,411,331.00	0.22
10	300203	聚光科技	1,301,393.00	0.20
11	300009	安科生物	1,250,640.00	0.19
12	600050	中国联通	1,221,851.00	0.19
13	600938	中国海油	1,214,226.00	0.19
14	600028	中国石化	1,183,400.00	0.18
15	601857	中国石油	1,112,811.00	0.17
16	600941	中国移动	1,098,940.94	0.17
17	601658	邮储银行	1,092,847.00	0.17
18	300124	汇川技术	1,090,562.00	0.17
19	601328	交通银行	1,074,104.00	0.16
20	300450	先导智能	1,055,849.00	0.16

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	300750	宁德时代	8,573,260.00	1.31
2	600519	贵州茅台	5,175,498.00	0.79
3	601166	兴业银行	4,063,630.00	0.62
4	300760	迈瑞医疗	3,414,452.00	0.52
5	300009	安科生物	3,110,599.00	0.47
6	600489	中金黄金	2,856,385.00	0.44
7	600547	山东黄金	2,777,744.00	0.42
8	000001	平安银行	2,674,368.00	0.41
9	000975	银泰黄金	2,624,933.00	0.40
10	601318	中国平安	2,444,900.00	0.37
11	600048	保利发展	2,312,070.00	0.35
12	300059	东方财富	2,174,991.00	0.33
13	001914	招商积余	2,058,951.00	0.31
14	001979	招商蛇口	2,031,136.00	0.31
15	600325	华发股份	1,998,768.00	0.30
16	002142	宁波银行	1,980,650.00	0.30
17	000002	万科 A	1,960,852.00	0.30
18	601012	隆基绿能	1,888,377.00	0.29
19	601155	新城控股	1,851,697.65	0.28
20	300450	先导智能	1,795,007.00	0.27

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	290,550,351.70
卖出股票收入（成交）总额	358,447,794.08

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	20,223,852.05	6.81
2	央行票据	-	-
3	金融债券	42,079,514.51	14.17

	其中：政策性金融债	212,958.89	0.07
4	企业债券	124,102,973.92	41.78
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	51,562,772.60	17.36
7	可转债（可交换债）	342,061.34	0.12
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	238,311,174.42	80.23

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	175687	21 广晟 Y1	250,000	25,625,493.15	8.63
2	2120105	21 厦门银行 二级 02	200,000	20,766,785.75	6.99
3	149184	20 鞍钢 Y4	200,000	20,648,391.23	6.95
4	149671	21 厦港 01	200,000	20,570,401.10	6.92
5	184130	21 日港 01	200,000	20,475,332.60	6.89

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 本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国银行股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责、处罚的情况。本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关

法律法规及基金合同的要求。

7.12.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	51,820.87
2	应收清算款	1,740,317.59
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	18,734.75
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,810,873.21

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	110091	合力转债	78,003.84	0.03
2	127070	大中转债	35,337.34	0.01
3	123169	正海转债	22,841.56	0.01
4	118014	高测转债	3,739.28	0.00
5	127061	美锦转债	580.88	0.00

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	持有份额	占总份	

				额比例		额比例
华夏睿磐泰荣混合 A	1,609	74,410.51	101,117,033.53	84.46%	18,609,473.07	15.54%
华夏睿磐泰荣混合 C	49,596	2,352.29	60,420,792.74	51.79%	56,243,164.07	48.21%
合计	51,205	4,616.55	161,537,826.27	68.34%	74,852,637.14	31.66%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	华夏睿磐泰荣混合 A	20,546.57	0.02%
	华夏睿磐泰荣混合 C	3,000.12	0.00%
	合计	23,546.69	0.01%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华夏睿磐泰荣混合 A	华夏睿磐泰荣混合 C
基金合同生效日（2017 年 12 月 27 日）基金份额总额	58,490,793.38	682,810,215.24
本报告期期初基金份额总额	283,189,992.93	247,648,363.66
本报告期基金总申购份额	16,395,348.04	46,021,163.71
减：本报告期基金总赎回份额	179,858,834.37	177,005,570.56
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	119,726,506.60	116,663,956.81

## §10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，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没有受到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	
招商证券	6	184,680,720.61	28.56%	79,653.50	28.43%	-
中信证券	11	149,364,822.98	23.10%	64,421.57	22.99%	-
兴业证券	1	105,257,541.67	16.28%	45,399.50	16.20%	-
中信建投证券	4	96,735,081.20	14.96%	41,722.63	14.89%	-
西部证券	1	81,356,144.30	12.58%	35,088.46	12.52%	-
中金公司	4	18,207,405.05	2.82%	7,853.05	2.80%	-



长江证券	2	11,056,129.49	1.71%	6,081.74	2.17%	-
------	---	---------------	-------	----------	-------	---

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，本基金还选择了财通证券、东方证券、东吴证券、方正证券、光大证券、广发证券、国联证券、国泰君安证券、海通证券、华泰证券、华西证券、江海证券、金元证券、联储证券、平安证券、上海证券、申万宏源证券、中泰证券、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，国泰君安证券的部分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
招商证券	19,963,200.00	23.96%	1,746,656,000.00	66.59%	-	-	-	-
中信证券	48,353,390.00	58.04%	336,130,000.00	12.81%	-	-	-	-
兴业证券	-	-	4,000,000.00	0.15%	-	-	-	-
中信建投	14,999,400.00	18.00%	536,370,000.00	20.45%	-	-	-	-

证券								
西部 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金 公司	-	-	-	-	-	-	-	-
长江 证券	-	-	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华夏基金管理有限公司公告	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	2023-01-19
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	2023-03-03
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	2023-03-11
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	2023-04-01
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	2023-04-06

**§11 影响投资者决策的其他重要信息**

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况

本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况。

**§12 备查文件目录**

12.1 备查文件目录

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