

华夏研究精选股票型证券投资基金

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.....	4
§4 管理人报告.....	5
§5 托管人报告.....	10
§6 中期报告财务会计报告（未经审计）.....	11
6.1 资产负债表.....	11
6.2 利润表.....	12
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	13
6.4 报表附注.....	15
§7 投资组合报告.....	35
7.1 期末基金资产组合情况.....	35
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	36
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.....	36
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	39
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	41
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.....	41
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.....	42
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.....	42
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.....	42
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	42
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	42
7.12 投资组合报告附注.....	42
§8 基金份额持有人信息.....	43
§9 开放式基金份额变动.....	43
§10 重大事件揭示.....	44
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	47
§12 备查文件目录.....	47

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华夏研究精选股票型证券投资基金
基金简称	华夏研究精选股票
基金主代码	004686
交易代码	004686
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年9月6日
基金管理人	华夏基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	119,848,742.56 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	依托基金管理人的研究团队，通过深入、系统、科学的研究，挖掘具有投资价值的标的构建投资组合，在严格控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳健增值。
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、权证投资策略、股指期货和期权投资策略、国债期货投资策略等。在股票投资策略上，本基金核心投资策略在于坚持研究驱动投资的理念，采用“自下而上”的精选策略，精选具有投资价值的个股构建投资组合。本基金为突出基本面研究精选个股的能力，在行业配置上基本维持行业中性配置。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×90%+上证国债指数收益率×10%。
风险收益特征	本基金属于股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金，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	95566
传真	010-63136700	010-66594942
注册地址	北京市顺义区安庆大街甲3号院	北京市西城区复兴门内大街1号
办公地址	北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座8层	北京市西城区复兴门内大街1号
邮政编码	100033	100818
法定代表人	杨明辉	葛海蛟

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）
本期已实现收益	-24,562,132.25
本期利润	1,564,179.40
加权平均基金份额本期利润	0.0081
本期加权平均净值利润率	0.57%
本期基金份额净值增长率	0.30%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023年6月30日)
期末可供分配利润	48,233,567.05
期末可供分配基金份额利润	0.4025
期末基金资产净值	168,082,309.61
期末基金份额净值	1.4025
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023年6月30日)
基金份额累计净值增长率	40.25%

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

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	4.41%	0.90%	1.09%	0.78%	3.32%	0.12%

过去三个月	-2.08%	0.79%	-4.49%	0.75%	2.41%	0.04%
过去六个月	0.30%	0.82%	-0.43%	0.76%	0.73%	0.06%
过去一年	-13.11%	0.99%	-12.58%	0.89%	-0.53%	0.10%
过去三年	4.10%	1.28%	-5.54%	1.08%	9.64%	0.20%
自基金合同生效起至今	40.25%	1.28%	3.02%	1.12%	37.23%	0.16%

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

华夏研究精选股票型证券投资基金

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 9 月 6 日至 2023 年 6 月 30 日)



§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	证券从业	说明
----	----	-----------	------	----

		(助理) 期限		年限	
		任职日期	离任日期		
刘文成	本基金的基金经理	2020-12-23	-	8 年	硕士。2015 年 7 月加入华夏基金管理有限公司。历任投资研究部研究员、基金经理助理、华夏成长证券投资基金基金经理(2021 年 9 月 16 日至 2022 年 10 月 27 日期间)等。

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

2023 年上半年，市场关键词是震荡和分化。从宽基指数看，上半年累计收益多数时间在 10% 到 -10% 之间震荡，其中 4 月份科创 50 指数有短暂上冲，但强势表现也很快回落，各宽基指数整体以震荡为主，趋势行情有限；从申万一级子行业来看，市场分化明显，主线比宽基指数彰显得更清晰，

表现好的可以归纳为两个方面，一是泛 AI 方向，以计算机、传媒、通信、电子为代表，二是“中特估”方向，以石油石化、建筑装饰等为代表。

如何理解上半年的泛 AI 方向和“中特估”的行情？站在宏观角度看，年初以来市场对高强度经济刺激政策有所期待，但政策的出台体现了超强的定力，因此强复苏逻辑被暂时“证伪”，市场逐步消化不合理预期的同时，无增量资金进入市场，在存量博弈下，市场选择了有产业增量的 AI 方向；其次，对于部分以保险资金为代表的边际力量，选择了低估值类资产，也就是所谓的“中特估”。我们理解以上两个方向的背后有不同的因素驱动，但本质上都是契合年初以来的宏观特殊背景。

在基金运作层面，我们参与了泛 AI 方向的投资，围绕算力、算法、数据和应用场景挖掘可能未被市场充分定价的机会，从实际配置角度看，基金在数据和应用场景方向配置较多，在算法、算力上配置相对有限，这与管理人的初始研究和投资框架有关；“中特估”方向基本未参与，我们首先并不认可该名称也无法对其进行精准定义，其承载的“特殊使命”被夸大，市场会随着概念的泛化消耗过多的流动性，以至于使得该行情缺乏持续性。我们参与较多的方向还有泛消费，包括供给侧、需求侧都有正向逻辑的纺织服装板块、家电板块、中药板块、消费医疗板块等。在港股的配置上，我们有比较高的仓位，原因有二，一是美国通胀压力边际缓和情况下美债收益率的阶段性的见顶，港股流动性改善，二是港股部分优质资产估值已经进入到极高性价比的阶段，时间换空间，赔率合适。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2023 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.4025 元，本报告期份额净值增长率为 0.30%，同期业绩比较基准增长率为-0.43%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

站在现在的位置展望下半年，国内外有几个重要宏观因素需要考虑。国内方向，地产是所有问题的重中之重，从居民资产负债表的角度讲，改革开放以来居民积累的财富，多数以房地产的形式被承载，这与美国居民资产多数以金融资产配置不同，地产行业无论在居民的财富效应的体现上，还是在社会信用创造的媒介上都起着短期无可替代的作用。所以下半年我们仍然要继续关注地产行业的变化，包括需求侧和供给侧政策的变化，这不仅关乎经济大盘增速能否企稳问题，也关乎如何选择内部结构性机会的问题。海外方面，最关注的仍然是美国韧性较强的通胀二次探顶能否如期回落的问题，美债收益率不仅对港股影响较大，对 A 股部分“长久期”资产的定价也很关键，其次是美国对我国科技限制的问题，我们自己的判断是在核心技术（例如芯片等）方面会继续趋严，但非核心技术层面（包括新能源、消费品出口）可能会有边际缓和。

本基金策略是在维持大行业基本中性的条件下，通过自下而上的选股及子行业配置，获取相对于沪深 300 的超额收益。下半年我们仍然会高仓位运作，在大行业基本中性前提下，选择看好的

子行业方向重点配置。一是以“新”为主，包括 AI 等新技术方向，制造业中的新产业，也包括传统行业中的新变化，例如消费品种的新品类的爆发、新药品研发突破等；二是以顺周期的复苏为主，下半年在地产企稳，经济自然修复的背景下，包括家居、建材、汽车等大宗消费存在阶段性机会；三是以港股低估值方向为主，在上半年不正常的货币条件下，港股出现了低估值、高成长类资产，这也是我们会重点配置的方向。

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合规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在华夏研究精选股票型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的

规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§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：华夏研究精选股票型证券投资基金

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	9,083,356.85	17,734,212.21
结算备付金		-	109,093.93
存出保证金		87,986.46	75,130.68
交易性金融资产	6.4.7.2	160,051,039.75	319,205,337.52
其中：股票投资		157,116,857.38	316,475,199.77
基金投资		-	-
债券投资		2,934,182.37	2,730,137.75
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		88,815.19	74,139.77
应收股利		-	-
应收申购款		8,601.81	23,129.99
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		169,319,800.06	337,221,044.10
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		-	-
应付赎回款		151,465.53	194,692.35
应付管理人报酬		206,453.17	446,660.00
应付托管费		34,408.88	74,443.31
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		30.69	20.14
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	845,132.18	470,358.98
负债合计		1,237,490.45	1,186,174.78
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	119,848,742.56	240,315,649.46
未分配利润	6.4.7.8	48,233,567.05	95,719,219.86
净资产合计		168,082,309.61	336,034,869.32
负债和净资产总计		169,319,800.06	337,221,044.10

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.4025 元，基金份额总额 119,848,742.56 份。

6.2 利润表

会计主体：华夏研究精选股票型证券投资基金

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		4,078,211.44	-55,711,298.24
1.利息收入		39,328.78	74,489.72
其中：存款利息收入	6.4.7.9	39,328.78	74,489.72
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		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-22,158,871.47	-15,534,329.86
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-23,900,381.76	-18,878,674.07
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	5,455.98	2,031.16

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	1,736,054.31	3,342,313.05
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	26,126,311.65	-40,406,617.02
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	71,442.48	155,158.92
减：二、营业总支出		2,514,032.04	4,362,281.96
1.管理人报酬		2,073,515.05	3,648,234.50
2.托管费		345,585.83	608,039.05
3.销售服务费		-	-
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.信用减值损失	6.4.7.17	-	-
7.税金及附加		19.75	7.38
8.其他费用	6.4.7.18	94,911.41	106,001.03
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,564,179.40	-60,073,580.20
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,564,179.40	-60,073,580.20
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		1,564,179.40	-60,073,580.20

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：华夏研究精选股票型证券投资基金

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）	240,315,649.46	-	95,719,219.86	336,034,869.32
二、本期期初净资产（基金净值）	240,315,649.46	-	95,719,219.86	336,034,869.32
三、本期增减变动额（减少以“-”	-120,466,906.90	-	-47,485,652.81	-167,952,559.71

号填列)				
(一)、综合收益总额	-	-	1,564,179.40	1,564,179.40
(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)	-120,466,906.90	-	-49,049,832.21	-169,516,739.11
其中: 1.基金申购款	13,106,308.26	-	5,110,031.39	18,216,339.65
2.基金赎回款	-133,573,215.16	-	-54,159,863.60	-187,733,078.76
(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)	119,848,742.56	-	48,233,567.05	168,082,309.61
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)	308,219,042.04	-	243,957,225.17	552,176,267.21
二、本期期初净资产(基金净值)	308,219,042.04	-	243,957,225.17	552,176,267.21
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-12,794,854.65	-	-62,547,321.36	-75,342,176.01
(一)、综合收益总额	-	-	-60,073,580.20	-60,073,580.20
(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)	-12,794,854.65	-	-2,473,741.16	-15,268,595.81
其中: 1.基金申购款	56,205,425.45	-	35,687,333.45	91,892,758.90
2.基金赎回款	-69,000,280.10	-	-38,161,074.61	-107,161,354.71
(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）	295,424,187.39	-	181,409,903.81	476,834,091.20

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

华夏研究精选股票型证券投资基金（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]657号《关于准予华夏研究精选股票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》、《华夏研究精选股票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 8 月 7 日至 2017 年 9 月 1 日共募集 1,547,842,801.31 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_A26 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华夏研究精选股票型证券投资基金基金合同》于 2017 年 9 月 6 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,548,662,077.64 份基金份额，其中认购资金利息折合 819,276.33 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《华夏研究精选股票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(包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、中小企业私募债券、可转换债券、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、衍生品（包括权证、股指期货、国债期货、期权等）、货币市场工具（含同业存单）以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布和修订的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《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	9,083,356.85
等于：本金	9,082,422.73
加：应计利息	934.12
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	9,083,356.85

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	164,100,497.65	-	157,116,857.38	-6,983,640.27	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	2,266,300.00	2,711.56	2,934,182.37	665,170.81
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	2,266,300.00	2,711.56	2,934,182.37	665,170.81
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	166,366,797.65	2,711.56	160,051,039.75	-6,318,469.46	

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	49.05
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	695,822.98
其中：交易所市场	695,822.98
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	149,260.15
合计	845,132.18

6.4.7.7 实收基金

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（份）	账面金额
上年度末	240,315,649.46	240,315,649.46
本期申购	13,106,308.26	13,106,308.26
本期赎回（以“-”号填列）	-133,573,215.16	-133,573,215.16
本期末	119,848,742.56	119,848,742.56

6.4.7.8 未分配利润

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	130,148,396.90	-34,429,177.04	95,719,219.86
本期利润	-24,562,132.25	26,126,311.65	1,564,179.40
本期基金份额交易产生的变动数	-54,327,670.26	5,277,838.05	-49,049,832.21
其中：基金申购款	5,817,600.43	-707,569.04	5,110,031.39
基金赎回款	-60,145,270.69	5,985,407.09	-54,159,863.60
本期已分配利润	-	-	-
本期末	51,258,594.39	-3,025,027.34	48,233,567.05

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	35,564.64
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	3,242.86
其他	521.28
合计	39,328.78

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	439,934,227.07
减：卖出股票成本总额	462,744,322.87
减：交易费用	1,090,285.96
买卖股票差价收入	-23,900,381.76

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	5,455.98
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-
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	5,455.98

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

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	1,736,054.31
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	1,736,054.31

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	26,126,311.65
——股票投资	25,920,487.53
——债券投资	205,824.12
——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	26,126,311.65

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	71,442.48
合计	71,442.48

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	29,752.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	5,651.26
合计	94,911.41

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
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	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

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	-	-	2,103,553.89	0.40%

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

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
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	1,959.12	0.48%	1,959.12	0.50%

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	2,073,515.05	3,648,234.50
其中：支付销售机构的客户维护费	377,450.48	558,274.65

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 1.50%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×1.50%/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	345,585.83	608,039.05

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 0.25%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×0.25%/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		上年度可比期间	
	2023年1月1日至2023年6月30日		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
中国银行活期存款	9,083,356.85	35,564.64	33,343,845.83	69,525.30

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国银行保管，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	001286	陕西能源	新股发行	37,667	361,603.20
中信证券	688343	云天励飞	新股发行	4,243	186,352.56
中信证券	688539	高华科技	新股发行	3,947	150,854.34
中信证券	688522	纳睿雷达	新股发行	2,282	106,523.76
中信证券	688146	中船特气	新股发行	2,903	104,943.45
中信证券	688581	安杰思	新股发行	708	89,066.40

中信证券	301439	泓淋电力	新股发行	4,205	84,057.95
中信证券	688523	航天环宇	新股发行	3,843	84,007.98
中信证券	301293	三博脑科	新股发行	2,759	81,666.40
中信证券	301323	新莱福	新股发行	1,736	67,808.16
中信证券	301170	锡南科技	新股发行	1,154	39,236.00
中信证券	301261	恒工精密	新股发行	1,014	37,416.60
中信证券	688631	莱斯信息	新股发行	1,420	35,897.60
中信证券	601133	柏诚股份	新股发行	2,977	34,711.82
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	001324	长青科技	新股发行	1,131	21,353.28
中信证券	603162	海通发展	新股发行	523	19,481.75
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	688302	海创药业	新股发行	11,629	499,116.68
中信证券	688223	晶科能源	新股发行	74,479	372,395.00
中信证券	301200	大族数控	新股发行	3,540	271,022.40
中信证券	301302	华如科技	新股发行	4,439	230,961.17
中信证券	688326	经纬恒润	新股发行	1,898	229,658.00
中信证券	301109	军信股份	新股发行	6,064	211,087.84
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	600938	中国海油	新股发行	3,000	32,400.00
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
688502	茂莱光学	2023-02-28	6 个月	新发流通受限	69.72	178.59	1,269	88,474.68	226,630.71	-
301486	致尚科技	2023-06-30	1 个月内(含)	新发流通受限	57.66	57.66	1,025	59,101.50	59,101.50	-
301395	仁信新材	2023-06-21	1 个月内(含)	新发流通受限	26.68	26.68	2,064	55,067.52	55,067.52	-
301292	海科新源	2023-06-29	1 个月内(含)	新发流通受限	19.99	19.99	2,690	53,773.10	53,773.10	-
301488	豪恩汽电	2023-06-26	1 个月内(含)	新发流通受限	39.78	39.78	1,244	49,486.32	49,486.32	-
688603	天承科技	2023-06-30	1 个月内(含)	新发流通受限	55.00	55.00	782	43,010.00	43,010.00	-
301202	朗威股份	2023-06-28	1 个月内(含)	新发流通受限	25.82	25.82	1,413	36,483.66	36,483.66	-
001286	陕西能源	2023-03-31	6 个月	新发流通受限	9.60	9.41	3,767	36,163.20	35,447.47	-
301261	恒工精密	2023-06-29	1 个月内(含)	新发流通受限	36.90	36.90	912	33,652.80	33,652.80	-
688249	晶合集成	2023-04-24	6 个月	新发流通受限	19.86	18.06	1,716	34,079.76	30,990.96	-
301358	湖南裕能	2023-02-01	6 个月	新发流通受限	23.77	42.89	493	11,718.61	21,144.77	-
688361	中科飞测	2023-05-12	6 个月	新发流通受限	23.60	64.67	313	7,386.80	20,241.71	-
688472	阿特斯	2023-06-02	6 个月	新发流通受限	11.10	17.04	1,169	12,975.90	19,919.76	-
301293	三博	2023-04-25	6 个月	新发	29.60	71.42	276	8,169.60	19,711.92	-

	脑科			流通受限						
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	-
301325	曼恩斯特	2023-05-04	6 个月	新发流通受限	76.80	107.95	155	11,904.00	16,732.25	-
301303	真兰仪表	2023-02-13	6 个月	新发流通受限	26.80	22.32	635	17,018.00	14,173.20	-
688562	航天软件	2023-05-15	6 个月	新发流通受限	12.68	22.31	604	7,658.72	13,475.24	-
688531	日联科技	2023-03-24	6 个月	新发流通受限	152.38	135.97	93	14,171.34	12,645.21	-
301310	鑫宏业	2023-05-26	6 个月	新发流通受限	67.28	65.43	192	12,917.76	12,562.56	-
301307	美利信	2023-04-14	6 个月	新发流通受限	32.34	31.86	385	12,450.90	12,266.10	-
301360	荣旗科技	2023-04-17	6 个月	新发流通受限	71.88	92.60	128	9,200.64	11,852.80	-
301399	英特科技	2023-05-16	6 个月	新发流通受限	43.99	51.57	225	9,897.75	11,603.25	-
301382	蜂助手	2023-05-09	6 个月	新发流通受限	23.80	32.84	343	8,163.40	11,264.12	-
301387	光大同创	2023-04-10	6 个月	新发流通受限	58.32	45.36	247	14,405.04	11,203.92	-
688146	中船特气	2023-04-13	6 个月	新发流通受限	36.15	38.13	291	10,519.65	11,095.83	-
688352	颀中科技	2023-04-11	6 个月	新发流通受限	12.10	12.07	913	11,047.30	11,019.91	-
301141	中科磁业	2023-03-27	6 个月	新发流通受限	41.20	42.69	250	10,300.00	10,672.50	-

301429	森泰股份	2023-04-10	6 个月	新发 流通 受限	28.75	21.02	499	14,346.25	10,488.98	-
688484	南芯科技	2023-03-28	6 个月	新发 流通 受限	39.99	36.71	280	11,197.20	10,278.80	-
688458	美芯晟	2023-05-15	6 个月	新发 流通 受限	75.00	90.76	111	8,325.00	10,074.36	-
688552	航天南湖	2023-05-08	6 个月	新发 流通 受限	21.17	23.50	410	8,679.70	9,635.00	-
001287	中电港	2023-03-30	6 个月	新发 流通 受限	11.88	21.02	444	5,274.72	9,332.88	-
301383	天键股份	2023-05-31	6 个月	新发 流通 受限	46.16	35.72	261	12,047.76	9,322.92	-
688523	航天环宇	2023-05-26	6 个月	新发 流通 受限	21.86	23.85	385	8,416.10	9,182.25	-
688507	索辰科技	2023-04-10	6 个月	新发 流通 受限	245.56	122.11	73	12,032.44	8,914.03	含 证 券 送 配
301225	恒勃股份	2023-06-08	6 个月	新发 流通 受限	35.66	33.26	262	9,342.92	8,714.12	-
301332	德尔玛	2023-05-09	6 个月	新发 流通 受限	14.81	13.73	631	9,345.11	8,663.63	-
301355	南王科技	2023-06-02	6 个月	新发 流通 受限	17.55	16.75	507	8,897.85	8,492.25	-
688581	安杰思	2023-05-12	6 个月	新发 流通 受限	125.80	118.03	71	8,931.80	8,380.13	-
301357	北方长龙	2023-04-11	6 个月	新发 流通 受限	50.00	48.39	171	8,550.00	8,274.69	-
688535	华海诚科	2023-03-28	6 个月	新发 流通 受限	35.00	51.23	161	5,635.00	8,248.03	-

688582	芯动联科	2023-06-21	6 个月	新发流通受限	26.74	40.68	195	5,214.30	7,932.60	-
301305	朗坤环境	2023-05-15	6 个月	新发流通受限	25.25	19.69	402	10,150.50	7,915.38	-
688433	华曙高科	2023-04-07	6 个月	新发流通受限	26.66	31.50	251	6,691.66	7,906.50	-
688570	天玛智控	2023-05-29	6 个月	新发流通受限	30.26	25.33	296	8,956.96	7,497.68	-
301203	国泰环保	2023-03-28	6 个月	新发流通受限	46.13	34.40	214	9,871.82	7,361.60	-
301386	未来电器	2023-03-21	6 个月	新发流通受限	29.99	23.79	309	9,266.91	7,351.11	-
301439	泓淋电力	2023-03-10	6 个月	新发流通受限	19.99	16.90	421	8,415.79	7,114.90	-
301428	世纪恒通	2023-05-10	6 个月	新发流通受限	26.35	30.60	229	6,034.15	7,007.40	-
688512	慧智微	2023-05-08	6 个月	新发流通受限	20.92	19.16	364	7,614.88	6,974.24	-
301323	新莱福	2023-05-29	6 个月	新发流通受限	39.06	39.36	174	6,796.44	6,848.64	-
688543	国科军工	2023-06-14	6 个月	新发流通受限	43.67	53.05	127	5,546.09	6,737.35	-
301232	飞沃科技	2023-06-08	6 个月	新发流通受限	72.50	58.42	115	8,337.50	6,718.30	-
301295	美硕科技	2023-06-19	6 个月	新发流通受限	37.40	36.07	185	6,919.00	6,672.95	-
301486	致尚科技	2023-06-30	6 个月	新发流通受限	57.66	57.66	114	6,573.24	6,573.24	-
301337	亚华电子	2023-05-16	6 个月	新发流通	32.60	30.37	215	7,009.00	6,529.55	-

				受限						
301291	明阳电气	2023-06-21	6 个月	新发 流通 受限	38.13	31.03	205	7,816.65	6,361.15	-
688479	友车科技	2023-05-04	6 个月	新发 流通 受限	33.99	29.49	211	7,171.89	6,222.39	-
301395	仁信新材	2023-06-21	6 个月	新发 流通 受限	26.68	26.68	230	6,136.40	6,136.40	-
301262	海看股份	2023-06-13	6 个月	新发 流通 受限	30.22	25.50	236	7,131.92	6,018.00	-
301292	海科新源	2023-06-29	6 个月	新发 流通 受限	19.99	19.99	299	5,977.01	5,977.01	-
603135	中重科技	2023-03-29	6 个月	新发 流通 受限	17.80	17.89	325	5,785.00	5,814.25	-
301488	豪恩汽电	2023-06-26	6 个月	新发 流通 受限	39.78	39.78	139	5,529.42	5,529.42	-
688429	时创能源	2023-06-20	6 个月	新发 流通 受限	19.20	25.53	213	4,089.60	5,437.89	-
301210	金杨股份	2023-06-21	6 个月	新发 流通 受限	57.88	49.17	108	6,251.04	5,310.36	-
001380	华纬科技	2023-05-09	6 个月	新发 流通 受限	28.84	30.78	160	4,614.40	4,924.80	-
688603	天承科技	2023-06-30	6 个月	新发 流通 受限	55.00	55.00	87	4,785.00	4,785.00	-
300804	广康生化	2023-06-15	6 个月	新发 流通 受限	42.45	32.97	144	6,112.80	4,747.68	-
301376	致欧科技	2023-06-14	6 个月	新发 流通 受限	24.66	22.51	207	5,104.62	4,659.57	-
301397	溯联股份	2023-06-15	6 个月	新发 流通 受限	53.27	40.20	114	6,072.78	4,582.80	-
688631	莱斯	2023-06-19	6 个月	新发	25.28	29.87	142	3,589.76	4,241.54	-

	信息			流通受限						
601065	江盐集团	2023-03-31	6 个月	新发流通受限	10.36	11.84	346	3,584.56	4,096.64	-
301202	朗威股份	2023-06-28	6 个月	新发流通受限	25.82	25.82	157	4,053.74	4,053.74	-
301170	锡南科技	2023-06-16	6 个月	新发流通受限	34.00	34.93	116	3,944.00	4,051.88	-
301261	恒工精密	2023-06-29	6 个月	新发流通受限	36.90	36.90	102	3,763.80	3,763.80	-
601133	柏诚股份	2023-03-31	6 个月	新发流通受限	11.66	12.26	298	3,474.68	3,653.48	-
001328	登康口腔	2023-03-29	6 个月	新发流通受限	20.68	25.49	130	2,688.40	3,313.70	-
001282	三联锻造	2023-05-15	6 个月	新发流通受限	27.93	33.03	97	2,709.21	3,203.91	-
001360	南矿集团	2023-03-31	6 个月	新发流通受限	15.38	14.87	177	2,722.26	2,631.99	-
603125	常青科技	2023-03-30	6 个月	新发流通受限	25.98	24.53	105	2,727.90	2,575.65	-
001324	长青科技	2023-05-12	6 个月	新发流通受限	18.88	19.60	114	2,152.32	2,234.40	-
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	-
603172	万丰股份	2023-04-28	6 个月	新发流通受限	14.58	16.13	122	1,778.76	1,967.86	-

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

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。

截至本期末，综合考虑利率债、信用债、同业存单、资产支持证券等资产占基金资产净值的比例，利率变动对于本基金资产净值无重大影响。

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	157,116,857.38	93.48	316,475,199.77	94.18
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	2,934,182.37	1.75	2,730,137.75	0.81
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	160,051,039.75	95.22	319,205,337.52	94.99

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%	-7,400,394.17	-16,677,277.15
	+5%	7,400,394.17	16,677,277.15

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	158,814,038.46
第二层次	367,393.51
第三层次	869,607.78
合计	160,051,039.75

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	157,116,857.38	92.79
	其中：股票	157,116,857.38	92.79

2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,934,182.37	1.73
	其中：债券	2,934,182.37	1.73
	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	9,083,356.85	5.36
8	其他各项资产	185,403.46	0.11
9	合计	169,319,800.06	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	6,376,000.87	3.79
C	制造业	105,310,102.96	62.65
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	35,447.47	0.02
E	建筑业	4,054,536.48	2.41
F	批发和零售业	1,163,297.45	0.69
G	交通运输、仓储和邮政业	2,419,424.00	1.44
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,321,586.67	3.17
J	金融业	25,200,489.00	14.99
K	房地产业	4,865,402.00	2.89
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	1,189,061.73	0.71
N	水利、环境和公共设施管理业	15,276.98	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,166,231.77	0.69
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	157,116,857.38	93.48

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	002920	德赛西威	43,800	6,824,478.00	4.06
2	300274	阳光电源	51,200	5,971,456.00	3.55
3	601318	中国平安	123,900	5,748,960.00	3.42
4	300750	宁德时代	24,260	5,550,445.40	3.30
5	000423	东阿阿胶	102,700	5,489,315.00	3.27
6	600036	招商银行	161,100	5,277,636.00	3.14
7	000568	泸州老窖	25,100	5,260,207.00	3.13
8	600048	保利发展	373,400	4,865,402.00	2.89
9	002142	宁波银行	190,200	4,812,060.00	2.86
10	600919	江苏银行	648,600	4,767,210.00	2.84
11	002154	报喜鸟	863,000	4,763,760.00	2.83
12	601838	成都银行	376,300	4,594,623.00	2.73
13	601899	紫金矿业	380,951	4,331,412.87	2.58
14	600309	万华化学	48,591	4,268,233.44	2.54
15	600522	中天科技	264,600	4,209,786.00	2.50
16	601800	中国交建	371,300	4,050,883.00	2.41
17	000933	神火股份	295,100	3,836,300.00	2.28
18	300990	同飞股份	72,180	3,630,654.00	2.16
19	601689	拓普集团	44,700	3,607,290.00	2.15
20	002415	海康威视	107,650	3,564,291.50	2.12
21	603986	兆易创新	32,500	3,453,125.00	2.05
22	600160	巨化股份	238,400	3,285,152.00	1.95
23	600276	恒瑞医药	68,200	3,266,780.00	1.94
24	603518	锦泓集团	281,400	3,193,890.00	1.90
25	603799	华友钴业	69,210	3,177,431.10	1.89
26	605398	新炬网络	80,000	3,116,800.00	1.85
27	600201	生物股份	327,280	3,112,432.80	1.85
28	300124	汇川技术	44,600	2,863,766.00	1.70
29	601633	长城汽车	105,200	2,647,884.00	1.58
30	603659	璞泰来	65,952	2,520,685.44	1.50
31	002541	鸿路钢构	86,500	2,492,065.00	1.48
32	002475	立讯精密	75,921	2,463,636.45	1.47
33	002965	祥鑫科技	44,100	2,455,488.00	1.46
34	603885	吉祥航空	156,800	2,419,424.00	1.44
35	002837	英维克	77,090	2,308,074.60	1.37
36	002594	比亚迪	8,300	2,143,641.00	1.28
37	002410	广联达	65,460	2,126,795.40	1.27
38	603993	洛阳钼业	383,600	2,044,588.00	1.22
39	688114	华大智造	23,433	2,028,360.48	1.21
40	688212	澳华内镜	29,083	1,974,735.70	1.17
41	300395	菲利华	34,700	1,707,240.00	1.02
42	002737	葵花药业	57,800	1,406,852.00	0.84
43	603259	药明康德	19,083	1,189,061.73	0.71

44	000963	华东医药	26,500	1,149,305.00	0.68
45	300015	爱尔眼科	61,807	1,146,519.85	0.68
46	688502	茂莱光学	1,269	226,630.71	0.13
47	688192	迪哲医药	5,076	176,137.20	0.10
48	301360	荣旗科技	1,273	131,253.40	0.08
49	600801	华新水泥	9,500	117,325.00	0.07
50	688257	新锐股份	3,779	100,181.29	0.06
51	301291	明阳电气	2,046	66,377.75	0.04
52	301486	致尚科技	1,139	65,674.74	0.04
53	301395	仁信新材	2,294	61,203.92	0.04
54	301292	海科新源	2,989	59,750.11	0.04
55	301488	豪恩汽电	1,383	55,015.74	0.03
56	301210	金杨股份	1,073	54,843.81	0.03
57	300804	广康生化	1,436	49,076.20	0.03
58	688603	天承科技	869	47,795.00	0.03
59	301397	溯联股份	1,133	47,788.40	0.03
60	301202	朗威股份	1,570	40,537.40	0.02
61	301261	恒工精密	1,014	37,416.60	0.02
62	001311	多利科技	649	37,272.07	0.02
63	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.02
64	688249	晶合集成	1,716	30,990.96	0.02
65	301358	湖南裕能	493	21,144.77	0.01
66	301262	海看股份	752	20,337.00	0.01
67	688361	中科飞测	313	20,241.71	0.01
68	688472	阿特斯	1,169	19,919.76	0.01
69	301293	三博脑科	276	19,711.92	0.01
70	301317	鑫磊股份	694	18,161.98	0.01
71	301325	曼恩斯特	155	16,732.25	0.01
72	301303	真兰仪表	635	14,173.20	0.01
73	688562	航天软件	604	13,475.24	0.01
74	688531	日联科技	93	12,645.21	0.01
75	301310	鑫宏业	192	12,562.56	0.01
76	301307	美利信	385	12,266.10	0.01
77	301399	英特科技	225	11,603.25	0.01
78	301382	蜂助手	343	11,264.12	0.01
79	301387	光大同创	247	11,203.92	0.01
80	688146	中船特气	291	11,095.83	0.01
81	688352	颀中科技	913	11,019.91	0.01
82	301141	中科磁业	250	10,672.50	0.01
83	301429	森泰股份	499	10,488.98	0.01
84	688484	南芯科技	280	10,278.80	0.01
85	688458	美芯晟	111	10,074.36	0.01
86	688552	航天南湖	410	9,635.00	0.01

87	001287	中电港	444	9,332.88	0.01
88	301383	天键股份	261	9,322.92	0.01
89	688523	航天环宇	385	9,182.25	0.01
90	688507	索辰科技	73	8,914.03	0.01
91	301225	恒勃股份	262	8,714.12	0.01
92	301332	德尔玛	631	8,663.63	0.01
93	301355	南王科技	507	8,492.25	0.01
94	688581	安杰思	71	8,380.13	0.00
95	301357	北方长龙	171	8,274.69	0.00
96	688535	华海诚科	161	8,248.03	0.00
97	688582	芯动联科	195	7,932.60	0.00
98	301305	朗坤环境	402	7,915.38	0.00
99	688433	华曙高科	251	7,906.50	0.00
100	688570	天玛智控	296	7,497.68	0.00
101	301203	国泰环保	214	7,361.60	0.00
102	301386	未来电器	309	7,351.11	0.00
103	301439	泓淋电力	421	7,114.90	0.00
104	301428	世纪恒通	229	7,007.40	0.00
105	688512	慧智微	364	6,974.24	0.00
106	301323	新莱福	174	6,848.64	0.00
107	688543	国科军工	127	6,737.35	0.00
108	301232	飞沃科技	115	6,718.30	0.00
109	301295	美硕科技	185	6,672.95	0.00
110	301337	亚华电子	215	6,529.55	0.00
111	688479	友车科技	211	6,222.39	0.00
112	603135	中重科技	325	5,814.25	0.00
113	688429	时创能源	213	5,437.89	0.00
114	001380	华纬科技	160	4,924.80	0.00
115	301376	致欧科技	207	4,659.57	0.00
116	688631	莱斯信息	142	4,241.54	0.00
117	601065	江盐集团	346	4,096.64	0.00
118	301170	锡南科技	116	4,051.88	0.00
119	601133	柏诚股份	298	3,653.48	0.00
120	001328	登康口腔	130	3,313.70	0.00
121	001282	三联锻造	97	3,203.91	0.00
122	001360	南矿集团	177	2,631.99	0.00
123	603125	常青科技	105	2,575.65	0.00
124	001324	长青科技	114	2,234.40	0.00
125	001367	海森药业	55	2,171.40	0.00
126	603172	万丰股份	122	1,967.86	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	000858	五粮液	19,842,381.30	5.90
2	000423	东阿阿胶	13,423,518.00	3.99
3	600919	江苏银行	10,273,346.00	3.06
4	000568	泸州老窖	10,126,018.60	3.01
5	601838	成都银行	9,150,881.00	2.72
6	002920	德赛西威	8,768,321.13	2.61
7	600036	招商银行	8,600,455.00	2.56
8	300274	阳光电源	8,539,802.00	2.54
9	002154	报喜鸟	7,444,644.00	2.22
10	600522	中天科技	7,174,263.00	2.13
11	300059	东方财富	6,182,090.00	1.84
12	601318	中国平安	6,108,402.00	1.82
13	603899	晨光股份	5,810,619.47	1.73
14	688261	东微半导	5,718,821.94	1.70
15	000729	燕京啤酒	5,711,801.00	1.70
16	605377	华旺科技	5,694,337.00	1.69
17	688120	华海清科	5,545,056.05	1.65
18	603986	兆易创新	5,505,981.00	1.64
19	600201	生物股份	5,395,894.04	1.61
20	601800	中国交建	5,368,913.00	1.60

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	000935	四川双马	26,462,293.32	7.87
2	000858	五粮液	20,929,491.00	6.23
3	600519	贵州茅台	14,424,438.00	4.29
4	601601	中国太保	11,113,916.00	3.31
5	601166	兴业银行	10,553,836.68	3.14
6	000423	东阿阿胶	9,403,279.34	2.80
7	300750	宁德时代	9,356,687.00	2.78
8	603816	顾家家居	8,399,513.80	2.50
9	002475	立讯精密	7,978,782.00	2.37
10	601899	紫金矿业	7,739,884.18	2.30
11	601012	隆基绿能	7,256,526.64	2.16
12	603659	璞泰来	7,185,214.98	2.14
13	000729	燕京啤酒	7,148,032.25	2.13

14	688120	华海清科	6,809,635.38	2.03
15	688169	石头科技	6,748,212.86	2.01
16	300059	东方财富	6,736,633.14	2.00
17	001201	东瑞股份	6,538,978.24	1.95
18	600153	建发股份	6,179,238.00	1.84
19	688261	东微半导	6,149,336.46	1.83
20	603039	泛微网络	6,141,384.00	1.83

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	277,465,492.95
卖出股票收入（成交）总额	439,934,227.07

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	-	-
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）	2,934,182.37	1.75
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,934,182.37	1.75

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	113648	巨星转债	11,000	1,526,999.21	0.91
2	113047	旗滨转债	6,220	757,404.12	0.45
3	113061	拓普转债	1,530	206,587.18	0.12
4	113633	科沃转债	1,460	161,816.80	0.10
5	113049	长汽转债	1,280	145,712.15	0.09

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，招商银行股份有限公司、江苏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	87,986.46
2	应收清算款	88,815.19
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	8,601.81
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	185,403.46

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	113648	巨星转债	1,526,999.21	0.91
2	113047	旗滨转债	757,404.12	0.45
3	113061	拓普转债	206,587.18	0.12
4	113633	科沃转债	161,816.80	0.10
5	113049	长汽转债	145,712.15	0.09
6	123119	康泰转 2	135,662.91	0.08

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

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
24,503	4,891.19	14,937,797.46	12.46%	104,910,945.10	87.54%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	244,359.30	0.20%

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	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2017 年 9 月 6 日）基金份额总额	1,548,662,077.64
本报告期期初基金份额总额	240,315,649.46
本报告期基金总申购份额	13,106,308.26
减：本报告期基金总赎回份额	133,573,215.16
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	119,848,742.56

§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

本报告期末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	佣金	占当期佣金总量的比	

			的比例		例	
广发证券	2	191,280,509.19	26.94%	178,138.76	30.03%	-
恒泰证券	1	179,743,538.26	25.31%	131,447.97	22.16%	-
海通证券	2	160,307,912.54	22.58%	149,294.23	25.17%	-
国都证券	1	103,377,124.64	14.56%	75,600.98	12.75%	-
兴业证券	2	56,610,101.40	7.97%	41,398.67	6.98%	-
西南证券	2	14,809,811.34	2.09%	13,792.34	2.33%	-
长江证券	2	3,009,584.48	0.42%	2,802.88	0.47%	-
中天证券	1	959,415.72	0.14%	701.62	0.12%	-

注：①为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择券商的标准，即：

i 经营行为规范。

ii 公司财务状况良好。

iii有良好的内控制度，在业内有良好的声誉。

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

v 建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯和服务。

②券商专用交易单元选择程序：

i 本基金管理人根据上述标准进行评估并确定选用的券商。

ii 本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议/证券经纪服务协议。

③除本表列示外，本基金还选择了安信证券、财通证券、川财证券、德邦证券、东方证券、国泰君安证券、瑞银证券、申万宏源证券、西部证券、信达证券、银河证券、招商证券、中国银河证券、中泰证券、中信建投证券、中信证券、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本报告期内，本基金租用的券商交易单元未发生变更。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	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
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-

恒泰 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国都 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西南 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中天 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	2023-02-24
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	2023-03-30
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	2023-04-01
8	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-04-13
9	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-04-15
10	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-04-27
11	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-05-13
12	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-05-27
13	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	2023-05-31

§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 2023-05-28	79,015,033.60	-	79,015,033.60	-	-
产品特有风险							
<p>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。</p> <p>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。</p>							

§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、《华夏研究精选股票型证券投资基金基金合同》；
- 3、《华夏研究精选股票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