

华夏智胜先锋股票型
证券投资基金（LOF）
2024 年中期报告
2024 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：华夏银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二四年八月三十日

§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。

基金托管人华夏银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 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 2024 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.....	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 净资产变动表.....	13
6.4 报表附注.....	15
§7 投资组合报告.....	38
7.1 期末基金资产组合情况.....	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	38
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.....	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	52
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	53
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.....	53
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.....	53
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.....	54
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.....	54
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	54
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	54
7.12 投资组合报告附注.....	54
§8 基金份额持有人信息.....	55
§9 开放式基金份额变动.....	56
§10 重大事件揭示.....	57
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	58
§12 备查文件目录.....	58

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华夏智胜先锋股票型证券投资基金（LOF）	
基金简称	华夏智胜先锋股票（LOF）	
场内简称	智胜先锋（扩位证券简称：智胜先锋 LOF）	
基金主代码	501219	
交易代码	501219	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 12 月 15 日	
基金管理人	华夏基金管理有限公司	
基金托管人	华夏银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	3,471,164,625.07 份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所	
上市日期	2022 年 2 月 9 日	
下属分级基金的基金简称	华夏智胜先锋股票（LOF）A	华夏智胜先锋股票 C
下属分级基金的交易代码	501219	014198
报告期末下属分级基金的份额总额	1,338,680,314.84 份	2,132,484,310.23 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在合理控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报，力求实现基金资产的稳健增值。
投资策略	主要投资策略包括资产配置策略、股票投资策略、固定收益品种投资策略、国债期货投资策略、股指期货投资策略、股票期权投资策略等。在股票投资策略上，本基金在股票投资方面主要采用量化模型选股、基本面选股等多种策略构建投资组合，同时运用数量化方法优化组合交易并控制组合风险，实现超额收益。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%。
风险收益特征	本基金为股票型基金，80%-95%的基金资产投资于股票，其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

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	华夏银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李彬	朱绍纲
	联系电话	400-818-6666	010-85238309
	电子邮箱	service@ChinaAMC.com	zhzsg@hxb.com.cn

客户服务电话	400-818-6666	95577
传真	010-63136700	010-85238680
注册地址	北京市顺义区安庆大街甲3号院	北京市东城区建国门内大街22号（100005）
办公地址	北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座8层	北京市东城区建国门内大街22号（100005）
邮政编码	100033	100005
法定代表人	张佑君	李民吉

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

§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（2024年1月1日至2024年6月30日）	
	华夏智胜先锋股票（LOF）A	华夏智胜先锋股票 C
本期已实现收益	-159,299,535.92	-293,909,620.26
本期利润	-173,266,767.86	-364,795,561.66
加权平均基金份额本期利润	-0.1103	-0.1299
本期加权平均净值利润率	-10.32%	-12.26%
本期基金份额净值增长率	-8.34%	-8.52%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024年6月30日)	
	华夏智胜先锋股票（LOF）A	华夏智胜先锋股票 C
期末可供分配利润	14,953,815.52	1,863,064.70
期末可供分配基金份额利润	0.0112	0.0009
期末基金资产净值	1,381,489,869.66	2,178,531,410.60
期末基金份额净值	1.0320	1.0216
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年6月30日)	
	华夏智胜先锋股票（LOF）A	华夏智胜先锋股票 C

基金份额累计净值增长率	3.20%	2.16%
-------------	-------	-------

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

华夏智胜先锋股票（LOF）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	-6.25%	0.95%	-6.55%	0.91%	0.30%	0.04%
过去三个月	-4.17%	1.12%	-6.16%	1.09%	1.99%	0.03%
过去六个月	-8.34%	1.54%	-8.46%	1.53%	0.12%	0.01%
过去一年	-11.29%	1.19%	-16.71%	1.21%	5.42%	-0.02%
自基金合同生效起至今	3.20%	1.18%	-30.99%	1.17%	34.19%	0.01%

华夏智胜先锋股票 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	-6.28%	0.94%	-6.55%	0.91%	0.27%	0.03%
过去三个月	-4.26%	1.12%	-6.16%	1.09%	1.90%	0.03%
过去六个月	-8.52%	1.54%	-8.46%	1.53%	-0.06%	0.01%
过去一年	-11.65%	1.19%	-16.71%	1.21%	5.06%	-0.02%
自基金合同生效起至今	2.16%	1.18%	-30.99%	1.17%	33.15%	0.01%

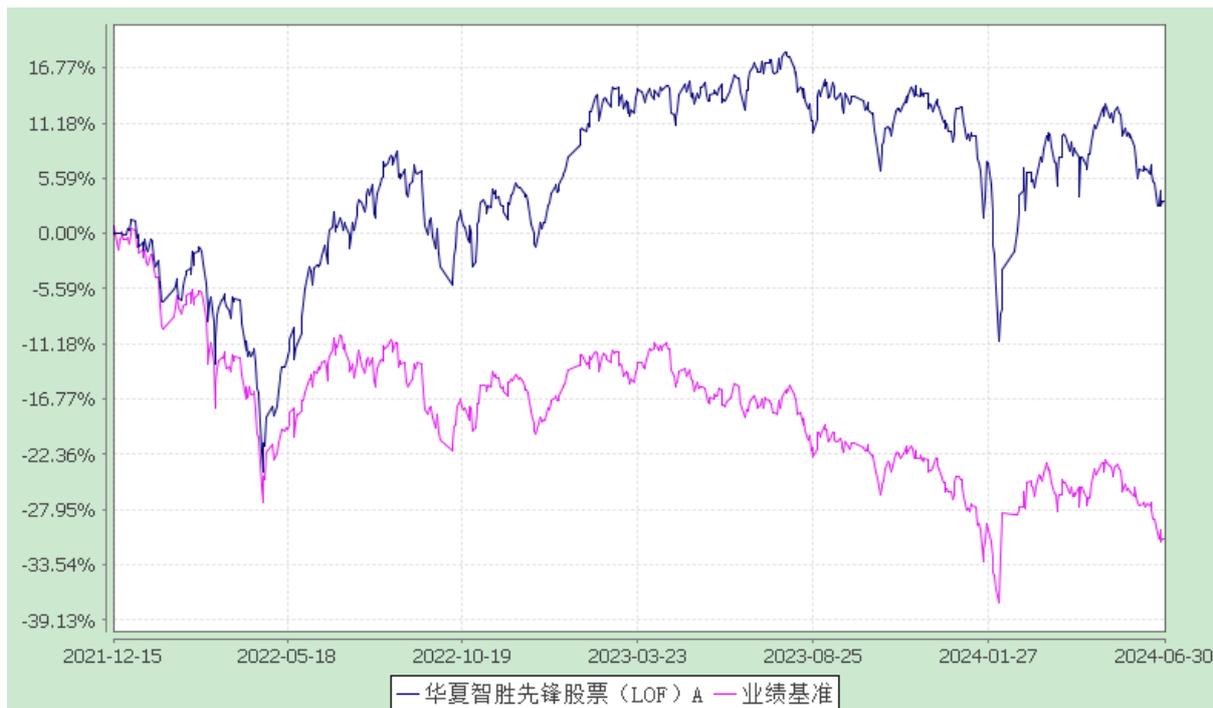
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华夏智胜先锋股票型证券投资基金（LOF）

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

(2021 年 12 月 15 日至 2024 年 6 月 30 日)

华夏智胜先锋股票（LOF）A



华夏智胜先锋股票 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、武汉及沈阳设有分公司，在香港、深圳、上海、北京设有子公司。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 2024 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：在北交所主题偏股型基金(A 类)中华夏北交所创新中小企业精选两年定开混合发起式排名第 1/10；在对冲策略绝对收益目标基金(A 类)华夏安泰对冲策略 3 个月定开混合排名第 1/22；在 QDII 混合基金(A 类)中华夏全球科技先锋混合(QDII)排名第 2/48；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 3/17；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 3/78、华夏消费臻选混合发起式(A 类)排名第 7/78。

固收与固收+产品：在 QDII 债券型基金(A 类)中华夏收益债券（QDII）(A 类)排名第 1/24、华夏大中华信用债券（QDII）(A 类)排名第 2/24；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 2/18；在定开纯债债券型基金(A 类)中华夏鼎华一年定开债券排名第 5/616、华夏鼎成一年定开债券排名第 14/616；在普通债券型基金(可投转债)(A 类)中华夏稳定双利债券(A 类)排名第 12/241；在长期纯债债券型基金(A 类)中华夏鼎航债券(A 类)排名第 7/793、华夏鼎茂债券(A 类)排名第 19/793、华夏鼎英债券(A 类)排名第 25/793、华夏鼎隆债券(A 类)排名第 26/793、华夏鼎信债券(A 类)排名第 52/793；在普通债券型基金(二级)(A 类)中华夏稳享增利 6 个月债券(A 类)排名第 13/416、华夏鼎源债券(A 类)排名第 27/416、华夏希望债券(A 类)排名第 29/416。

在《中国证券报》第二十届中国基金业金牛奖评选中，华夏基金荣获“金牛奖 20 周年特别贡献公司”，连续 8 年荣获“被动投资金牛基金公司”，产品层面华夏创新前沿股票荣获“五年期开放式股票型持续优胜金牛基金”，华夏中证 5G 通信主题 ETF 荣获“开放式指数型金牛基金”。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上，华夏基金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》主办的第二十届“金基金”奖评选活动上，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，华夏创新前沿股票荣获“金基金·股票型基金五年期奖”，华夏行业景气混合荣获“金基金·偏股混合型基金五年期奖”。

在客户服务方面，2024 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）华夏基金直销渠道继续优化页面显示，升级搜索及查询等功能，给客户更方便直观的使用体验；（2）华夏基金管家客户端上线亲子账户，通过亲子账户客户可以为子女创建专属理财账户，管理和储备孩子的零花钱、教育资金，从客户投资需求出发，进一步提升操作体验；（3）与常熟农商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“送你长期主义的花朵”、“领定制户口本”、“打工人又爱又怕的一天要来了”、“希望高考也这么简单”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		
孙蒙	本基金的 基金经理	2021-12-15	-	10 年	硕士。曾任中信建投证券股份有限公司研究员、投资经理等。2017 年 7 月加入华夏基金管理有限公司。历任数量投资部研究员、基金经理助理。
叶津佐	本基金的 基金经理 助理	2023-10-19	-	7 年	博士。2017 年 7 月加入华夏基金管理有限公司。历任数量投资部研究员。

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《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》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 119 次，均为指数量化投资组合因投资策略需要发生的反向交易。

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

2024 年上半年，外部环境变得更为复杂严峻，全球经济增长动力不足，虽然通胀有所回落但仍存在一定的粘性，同时各主要经济体的经济增长和货币政策也呈现一定的分化。国内方面，我国经济运行总体平稳，延续回升向好态势，具体体现在生产稳定增长，需求持续恢复，就业物价总体稳定，居民收入继续增加等方面，但同时可以看到，在外部环境错综复杂的情况下，国内有效需求依然不足，社会预期依旧偏弱，经济回升向好的基础仍需巩固，而宏观政策效应持续释放、外需有所回暖、新质生产力加速发展等因素也形成了新的支撑。

市场方面，行业间表现分化较大：银行、煤炭、公用事业等高股息特征行业表现较好，而计算机、商业贸易、社会服务等成长、消费行业表现较差。市场风格期间保持稳定，低估值、盈利等因子表现较好，而小市值、反转等因子表现较差，量化策略整体表现较好。

基金投资运作方面，本基金以多因子量化投资策略为主，我们在依据量化模型进行股票投资决策之外，还积极参与了科创板、创业板新股申购，获取较为确定性的收益增厚机会。同时，本基金秉承尽职尽责的态度，认真应对投资者日常申购、赎回等工作。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2024 年 6 月 30 日，华夏智胜先锋股票（LOF）A 基金份额净值为 1.0320 元，本报告期份

额净值增长率为-8.34%；华夏智胜先锋股票 C 基金份额净值为 1.0216 元，本报告期份额净值增长率为-8.52%，同期业绩比较基准增长率为-8.46%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2024 年下半年，政府财政支出预计加快，经济增长速度基本实现设定目标，这将带动 A 股上市公司盈利恢复小幅增长，但是 M2 增速处于较低水平，市场难有大幅上涨行情。预计市场继续区间震荡，风格将呈现轮动特征，建议均衡配置。

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

报告期内，本基金托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内，基金管理人在投资运作、基金资产净值计算、利润分配、基金费用开支等方面，能

够遵守有关法律法规，未发现有损害基金份额持有人利益的行为。报告期内，本基金利润分配情况真实、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

托管人认为，由基金管理人编制并经托管人复核的本基金中期报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、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：华夏智胜先锋股票型证券投资基金（LOF）

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	207,589,379.24	311,219,254.07
结算备付金		4,079,697.97	6,186,257.67
存出保证金		2,204,212.80	7,667,073.60
交易性金融资产	6.4.7.2	3,360,328,752.23	5,445,579,755.63
其中：股票投资		3,360,328,752.23	5,444,000,651.81
基金投资		-	-
债券投资		-	1,579,103.82
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		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		3,742,923.85	56,829,063.50
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		3,577,944,966.09	5,827,481,404.47
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 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		13,130,583.13	15,448,221.78
应付管理人报酬		3,134,408.06	4,814,044.06
应付托管费		626,881.59	962,808.82
应付销售服务费		769,152.83	1,290,771.42
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	5.32
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	262,660.22	218,642.69
负债合计		17,923,685.83	22,734,494.09
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	3,471,164,625.07	5,183,603,312.63
未分配利润	6.4.7.8	88,856,655.19	621,143,597.75
净资产合计		3,560,021,280.26	5,804,746,910.38
负债和净资产总计		3,577,944,966.09	5,827,481,404.47

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，华夏智胜先锋股票（LOF）A 基金份额净值 1.0320 元，华夏智胜先锋股票 C 基金份额净值 1.0216 元；华夏智胜先锋股票（LOF）基金份额总额 3,471,164,625.07 份（其中 A 类 1,338,680,314.84 份，C 类 2,132,484,310.23 份）。

6.2 利润表

会计主体：华夏智胜先锋股票型证券投资基金（LOF）

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-504,433,036.65	151,668,803.10
1.利息收入		391,147.11	208,977.32
其中：存款利息收入	6.4.7.9	391,147.11	208,977.32
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		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-423,209,146.02	130,002,872.36
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-470,501,567.91	96,734,935.91
基金投资收益	6.4.7.11	-	-
债券投资收益	6.4.7.12	259,153.35	464,663.88
资产支持证券投资收益	6.4.7.13	-	-

贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-5,087,421.47	-101,409.98
股利收益	6.4.7.16	52,120,690.01	32,904,682.55
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-84,853,173.34	19,813,216.27
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	3,238,135.60	1,643,737.15
减：二、营业总支出		33,629,292.87	13,481,648.71
1.管理人报酬		23,034,137.41	8,948,467.99
2.托管费		4,606,827.48	1,789,693.59
3.销售服务费		5,883,901.05	2,658,946.26
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	6.4.7.20	-	-
7.税金及附加		0.79	238.31
8.其他费用	6.4.7.21	104,426.14	84,302.56
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-538,062,329.52	138,187,154.39
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-538,062,329.52	138,187,154.39
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-538,062,329.52	138,187,154.39

6.3 净资产变动表

会计主体：华夏智胜先锋股票型证券投资基金（LOF）

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	5,183,603,312.63	621,143,597.75	5,804,746,910.38
二、本期期初净资产	5,183,603,312.63	621,143,597.75	5,804,746,910.38
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-1,712,438,687.56	-532,286,942.56	-2,244,725,630.12
（一）、综合收益总额	-	-538,062,329.52	-538,062,329.52

（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-1,712,438,687.56	5,775,386.96	-1,706,663,300.60
其中：1.基金申购款	1,504,179,645.81	77,647,345.71	1,581,826,991.52
2.基金赎回款	-3,216,618,333.37	-71,871,958.75	-3,288,490,292.12
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	3,471,164,625.07	88,856,655.19	3,560,021,280.26
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	421,897,017.32	3,634,021.93	425,531,039.25
二、本期期初净资产	421,897,017.32	3,634,021.93	425,531,039.25
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	2,888,362,240.13	520,122,653.59	3,408,484,893.72
（一）、综合收益总额	-	138,187,154.39	138,187,154.39
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	2,888,362,240.13	381,935,499.20	3,270,297,739.33
其中：1.基金申购款	3,747,779,778.60	493,291,051.85	4,241,070,830.45
2.基金赎回款	-859,417,538.47	-111,355,552.65	-970,773,091.12
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	3,310,259,257.45	523,756,675.52	3,834,015,932.97

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：张佑君，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

华夏智胜先锋股票型证券投资基金（LOF）（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[2021]3192 号文《关于准予华夏智胜先锋股票型证券投资基金（LOF）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》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《华夏智胜先锋股票型证券投资基金（LOF）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 2021 年 11 月 22 日至 2021 年 12 月 10 日共募集 427,963,517.83 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（2021）验字第 60739337_A175 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华夏智胜先锋股票型证券投资基金（LOF）基金合同》于 2021 年 12 月 15 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 428,270,061.70 份基金份额，其中认购资金利息折合 306,543.87 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，基金托管人为华夏银行股份有限公司。

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，包括国内依法发行或上市的股票（包括创业板、存托凭证及其他中国证监会注册或核准上市的股票）、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、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（包括股指期货、国债期货、股票期权）、资产支持证券、货币市场工具（含同业存单）、债券回购、银行存款以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

本基金可根据相关法律法规和《基金合同》的约定，参与融资业务。

本基金的投资组合比例为：股票投资占基金资产的比例为 80%-95%；每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

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(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》、财税[2023]39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》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。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

（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 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	11,915,261.87
等于：本金	11,913,499.36
加：应计利息	1,762.51
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	195,674,117.37
等于：本金	195,663,185.17
加：应计利息	10,932.20
合计	207,589,379.24

注：其他存款为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	3,516,051,058.94	-	3,360,328,752.23	-155,722,306.71
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	3,516,051,058.94	-	3,360,328,752.23	-155,722,306.71

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

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日		
	合同/名义	公允价值	备注

	金额	资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	20,458,075.20	-	-	-
其中：股指期货	20,458,075.20	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	20,458,075.20	-	-	-

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IC2412	中证 500 期货 IC2412 合约	19	18,368,440.00	-2,089,635.20
合计	-	-	-	-2,089,635.20
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	-2,089,635.20
净额	-	-	-	-

注：衍生金融资产项下的利率/权益/其他衍生工具为国债/股指/商品期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指/商品/国债期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指/商品/国债期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 0。

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 2024 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	7,170.46
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-

银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	194,426.14
其他	61,063.62
合计	262,660.22

6.4.7.7 实收基金

华夏智胜先锋股票（LOF）A

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	1,720,195,994.74	1,720,195,994.74
本期申购	323,907,110.66	323,907,110.66
本期赎回（以“-”号填列）	-705,422,790.56	-705,422,790.56
本期末	1,338,680,314.84	1,338,680,314.84

华夏智胜先锋股票 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	3,463,407,317.89	3,463,407,317.89
本期申购	1,180,272,535.15	1,180,272,535.15
本期赎回（以“-”号填列）	-2,511,195,542.81	-2,511,195,542.81
本期末	2,132,484,310.23	2,132,484,310.23

6.4.7.8 未分配利润

华夏智胜先锋股票（LOF）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	184,826,661.57	31,762,015.13	216,588,676.70
本期期初	184,826,661.57	31,762,015.13	216,588,676.70
本期利润	-159,299,535.92	-13,967,231.94	-173,266,767.86
本期基金份额交易产生的变动数	-10,573,310.13	10,060,956.11	-512,354.02
其中：基金申购款	13,655,642.92	9,033,839.38	22,689,482.30
基金赎回款	-24,228,953.05	1,027,116.73	-23,201,836.32
本期已分配利润	-	-	-
本期末	14,953,815.52	27,855,739.30	42,809,554.82

华夏智胜先锋股票 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	340,967,789.54	63,587,131.51	404,554,921.05
本期期初	340,967,789.54	63,587,131.51	404,554,921.05
本期利润	-293,909,620.26	-70,885,941.40	-364,795,561.66
本期基金份额交易产生的变动数	-45,195,104.58	51,482,845.56	6,287,740.98
其中：基金申购款	21,560,690.27	33,397,173.14	54,957,863.41
基金赎回款	-66,755,794.85	18,085,672.42	-48,670,122.43
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,863,064.70	44,184,035.67	46,047,100.37

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
活期存款利息收入	89,629.35
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	256,497.78
结算备付金利息收入	39,706.11
其他	5,313.87
合计	391,147.11

注：其他存款利息收入为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金产生的利息收入。

6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出股票成交总额	17,433,676,163.79
减：卖出股票成本总额	17,885,780,031.57
减：交易费用	18,397,700.13
买卖股票差价收入	-470,501,567.91

6.4.7.11 基金投资收益

无。

6.4.7.12 债券投资收益

6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
----	----------------------------

债券投资收益——利息收入	221.82
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	258,931.53
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	259,153.35

6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,838,631.51
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,579,000.00
减：应计利息总额	332.24
减：交易费用	367.74
买卖债券差价收入	258,931.53

6.4.7.13 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.14 贵金属投资收益

无。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
股指期货投资收益	-5,087,421.47

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	52,120,690.01
其中：证券出借权益补偿收入	-

基金投资产生的股利收益	-
合计	52,120,690.01

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
1.交易性金融资产	-83,631,468.20
——股票投资	-83,631,468.20
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-1,221,705.14
——权证投资	-
——期货投资	-1,221,705.14
4.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	-84,853,173.34

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
基金赎回费收入	3,238,135.60
合计	3,238,135.60

6.4.7.19 持有基金产生的费用

无。

6.4.7.20 信用减值损失

无。

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
审计费用	44,753.80
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
合计	104,426.14

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

本基金本报告期不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。

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
华夏银行股份有限公司（“华夏银行”）	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
中信期货有限公司（“中信期货”）	基金管理人第一大股东的子公司
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
中信证券华南股份有限公司（“中信证券（华南）”）	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 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023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	33,317,687,339.85	100.00%	11,719,114,217.50	100.00%

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023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

		券成交总 额的比例		成交总额的 比例
中信证券	1,838,631.51	100.00%	2,402,638.79	100.00%

6.4.10.1.4 债券回购交易

无。

6.4.10.1.5 基金交易

无。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024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	7,543,742.48	100.00%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 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	2,659,329.87	100.00%	-	-

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 2024年1月1日至2024年6月 30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30 日
当期发生的基金应支付的管理费	23,034,137.41	8,948,467.99
其中：应支付销售机构的客户维护费	7,310,344.62	2,504,943.58
应支付基金管理人的净管理费	15,723,792.79	6,443,524.41

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 1.00%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×1.00%/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 2024年1月1日至2024年6月 30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30 日
当期发生的基金应支付的托管费	4,606,827.48	1,789,693.59

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 2024年1月1日至2024年6月30日 当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华夏智胜先锋股票 (LOF) A	华夏智胜先锋股票 C	合计
中信 证券	-	1,380,903.41	1,380,903.41
华夏 基金 管理 有限 公司	-	1,024,833.97	1,024,833.97
中信 证券 (华 南)	-	239,923.84	239,923.84
华夏 财富	-	139,151.11	139,151.11
中信 证券 (山 东)	-	14,924.86	14,924.86

中信期货	-	14,380.64	14,380.64
华夏银行	-	4,057.89	4,057.89
合计	-	2,818,175.72	2,818,175.72
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 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		
	华夏智胜先锋股票 (LOF) A	华夏智胜先锋股票 C	合计
华夏基金管理有限公司	-	615,216.83	615,216.83
中信证券	-	376,733.45	376,733.45
中信证券（华南）	-	191,161.01	191,161.01
华夏财富	-	52,765.55	52,765.55
华夏银行	-	2,020.95	2,020.95
中信期货	-	1,546.55	1,546.55
中信证券（山东）	-	943.37	943.37
合计	-	1,240,387.71	1,240,387.71

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 0.40% 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 × 0.40% / 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 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023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
华夏银行活期存款	11,915,261.87	89,629.35	25,821,345.79	18,129.20
中信证券（华南）券商存款	195,674,117.37	256,497.78	-	-

注：本基金的活期银行存款由基金托管人华夏银行保管，按银行同业利率或约定利率计息。

中信证券（华南）券商存款为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金，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 2024年1月1日至2024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	601033	永兴股份	新股发行	12,577	203,747.40
中信证券	688584	上海合晶	新股发行	8,659	196,212.94
中信证券	001359	平安电工	新股发行	1,833	31,875.87

上年度可比期间 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	688343	云天励飞	新股发行	13,146	577,372.32
中信证券	001286	陕西能源	新股发行	37,667	361,603.20
中信证券	688146	中船特气	新股发行	9,186	332,073.90
中信证券	688581	安杰思	新股发行	1,629	204,928.20
中信证券	688539	高华科技	新股发行	5,334	203,865.48
中信证券	688522	纳睿雷达	新股发行	3,638	169,821.84
中信证券	301439	泓淋电力	新股发行	6,925	138,430.75
中信证券	688523	航天环宇	新股发行	4,717	103,113.62
中信证券	301293	三博脑科	新股发行	3,324	98,390.40
中信证券	301323	新莱福	新股发行	2,277	88,939.62
中信证券	688631	莱斯信息	新股发行	3,357	84,864.96
中信证券	301170	锡南科技	新股发行	2,496	84,864.00
中信证券	301157	华塑科技	新股发行	1,498	84,637.00
中信证券	601133	柏诚股份	新股发行	6,632	77,329.12
中信证券	301261	恒工精密	新股发行	1,973	72,803.70
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

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（2024 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

688717	艾罗能源	2023-12-26	6 个月	新发流通受限	55.66	47.02	11,303	629,124.98	531,467.06	-
301589	诺瓦星云	2024-02-01	6 个月	新发流通受限	126.89	188.01	1,244	87,680.99	233,884.44	含 证 券 送 配
688692	达梦数据	2024-06-04	6 个月	新发流通受限	86.96	174.93	175	15,218.00	30,612.75	-
603285	键邦股份	2024-06-28	1 个月内(含)	新发流通受限	18.65	18.65	1,158	21,596.70	21,596.70	-
601033	永兴股份	2024-01-11	6 个月	新发流通受限	16.20	15.96	1,258	20,379.60	20,077.68	-
603350	安乃达	2024-06-26	1 个月内(含)	新发流通受限	20.56	20.56	945	19,429.20	19,429.20	-
301536	星辰科技	2024-03-20	6 个月	新发流通受限	16.16	32.27	481	7,772.96	15,521.87	-
688584	上海合晶	2024-02-01	6 个月	新发	22.66	15.89	866	19,623.56	13,760.74	-

				流通受限						
301538	骏鼎达	2024-03-13	6 个月	新发流通受限	55.82	91.24	149	5,972.74	13,594.76	含证券送配
301565	中仑新材	2024-06-13	6 个月	新发流通受限	11.88	18.98	711	8,446.68	13,494.78	-
603341	龙旗科技	2024-02-23	6 个月	新发流通受限	26.00	37.49	298	7,748.00	11,172.02	-
688691	灿芯股份	2024-04-02	6 个月	新发流通受限	19.86	42.51	247	4,905.42	10,499.97	-
301566	达利凯普	2023-12-22	6 个月	新发流通受限	8.90	16.97	576	5,126.40	9,774.72	-
301392	汇成真空	2024-05-28	6 个月	新发流通受限	12.20	41.66	219	2,671.80	9,123.54	-
301591	肯特股份	2024-02-20	6 个月	新发流通	19.43	36.98	219	4,255.17	8,098.62	-

				受限						
301587	中瑞股份	2024-03-27	6 个月	新发流通受限	21.73	25.26	306	6,649.38	7,729.56	-
001389	广合科技	2024-03-26	6 个月	新发流通受限	17.43	34.56	222	3,869.46	7,672.32	-
301539	宏鑫科技	2024-04-03	6 个月	新发流通受限	10.64	19.82	361	3,841.04	7,155.02	-
688695	中创股份	2024-03-06	6 个月	新发流通受限	22.43	31.55	186	4,171.98	5,868.30	-
688530	欧莱新材	2024-04-29	6 个月	新发流通受限	9.60	16.10	344	3,302.40	5,538.40	-
301588	美新科技	2024-03-06	6 个月	新发流通受限	14.50	21.25	257	3,726.50	5,461.25	-
301502	华阳智能	2024-01-26	6 个月	新发流通受限	28.01	37.83	138	3,865.38	5,220.54	-

603325	博隆技术	2024-01-03	6 个月	新发流通受限	72.46	68.06	66	4,782.36	4,491.96	-
603381	永臻股份	2024-06-19	6 个月	新发流通受限	23.35	25.13	178	4,156.30	4,473.14	-
001359	平安电工	2024-03-19	6 个月	新发流通受限	17.39	20.60	184	3,199.76	3,790.40	-
603312	西典新能	2024-01-04	6 个月	新发流通受限	29.02	25.36	130	3,772.60	3,296.80	-
603082	北自科技	2024-01-23	6 个月	新发流通受限	21.28	29.49	107	2,276.96	3,155.43	-
001379	腾达科技	2024-01-11	6 个月	新发流通受限	16.98	13.48	213	3,616.74	2,871.24	-
603375	盛景微	2024-01-17	6 个月	新发流通受限	38.18	38.90	72	2,748.96	2,800.80	-
603285	键邦股份	2024-06-28	6 个月	新发	18.65	18.65	129	2,405.85	2,405.85	-

				流通受限						
603350	安乃达	2024-06-26	6 个月	新发流通受限	20.56	20.56	106	2,179.36	2,179.36	-

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 2024年6月30日		上年度末 2023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	3,360,328,752.23	94.39	5,444,000,651.81	93.79
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	1,579,103.82	0.03
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	3,360,328,752.23	94.39	5,445,579,755.63	93.81

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	除中证 500 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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
	-5%	-135,655,764.38	-242,937,432.12
	+5%	135,655,764.38	242,937,432.12

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 2024 年 6 月 30 日
第一层次	3,359,302,307.73
第二层次	45,611.11
第三层次	980,833.39
合计	3,360,328,752.23

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 2024 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	3,360,328,752.23	93.92
	其中：股票	3,360,328,752.23	93.92
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	211,669,077.21	5.92
8	其他各项资产	5,947,136.65	0.17
9	合计	3,577,944,966.09	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	11,154,347.00	0.31
B	采矿业	176,741,313.07	4.96
C	制造业	2,202,601,365.86	61.87
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	150,766,671.42	4.23
E	建筑业	44,630,723.00	1.25
F	批发和零售业	90,486,358.70	2.54
G	交通运输、仓储和邮政业	117,402,785.34	3.30
H	住宿和餐饮业	1,665,300.00	0.05

I	信息传输、软件和信息技术服务业	133,419,713.22	3.75
J	金融业	280,395,872.94	7.88
K	房地产业	23,601,239.12	0.66
L	租赁和商务服务业	30,113,534.62	0.85
M	科学研究和技术服务业	11,742,824.52	0.33
N	水利、环境和公共设施管理业	38,286,328.42	1.08
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	9,951,770.00	0.28
Q	卫生和社会工作	20,017,804.00	0.56
R	文化、体育和娱乐业	17,350,801.00	0.49
S	综合	-	-
	合计	3,360,328,752.23	94.39

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	300502	新易盛	322,600	34,050,430.00	0.96
2	600066	宇通客车	1,296,250	33,443,250.00	0.94
3	601128	常熟银行	4,386,340	33,204,593.80	0.93
4	002128	电投能源	1,553,900	32,787,290.00	0.92
5	000423	东阿阿胶	477,000	29,860,200.00	0.84
6	688188	柏楚电子	152,359	28,117,853.45	0.79
7	688169	石头科技	59,903	23,517,917.80	0.66
8	603568	伟明环保	1,099,436	22,626,392.88	0.64
9	002595	豪迈科技	549,300	20,966,781.00	0.59
10	002318	久立特材	857,900	20,014,807.00	0.56
11	002371	北方华创	62,400	19,961,136.00	0.56
12	603408	建霖家居	1,508,300	19,894,477.00	0.56
13	002978	安宁股份	709,000	19,752,740.00	0.55
14	603699	纽威股份	1,148,300	19,658,896.00	0.55
15	000786	北新建材	658,700	19,537,042.00	0.55
16	001236	弘业期货	2,715,124	19,304,531.64	0.54
17	688510	航亚科技	1,023,847	18,849,023.27	0.53
18	600886	国投电力	1,018,200	18,571,968.00	0.52
19	601058	赛轮轮胎	1,320,600	18,488,400.00	0.52
20	605333	沪光股份	660,500	18,394,925.00	0.52
21	002563	森马服饰	3,117,500	18,112,675.00	0.51
22	300218	安利股份	1,188,400	17,921,072.00	0.50
23	600566	济川药业	563,371	17,864,494.41	0.50
24	603489	八方股份	654,154	17,649,074.92	0.50
25	002961	瑞达期货	1,564,000	17,125,800.00	0.48
26	688516	奥特维	405,400	16,949,774.00	0.48

27	000598	兴蓉环境	2,244,810	16,880,971.20	0.47
28	002532	天山铝业	2,049,600	16,622,256.00	0.47
29	600926	杭州银行	1,273,100	16,613,955.00	0.47
30	603871	嘉友国际	936,920	16,574,114.80	0.47
31	601717	郑煤机	1,073,101	15,881,894.80	0.45
32	600582	天地科技	2,276,400	15,684,396.00	0.44
33	600177	雅戈尔	2,192,778	15,612,579.36	0.44
34	300394	天孚通信	176,512	15,607,191.04	0.44
35	000725	京东方 A	3,815,900	15,607,031.00	0.44
36	002035	华帝股份	2,489,545	15,509,865.35	0.44
37	002028	思源电气	230,202	15,400,513.80	0.43
38	603979	金诚信	304,430	15,382,847.90	0.43
39	301239	普瑞眼科	428,300	15,131,839.00	0.43
40	603501	韦尔股份	149,000	14,806,130.00	0.42
41	300453	三鑫医疗	2,294,820	14,663,899.80	0.41
42	601000	唐山港	3,062,818	14,395,244.60	0.40
43	300866	安克创新	199,592	14,212,946.32	0.40
44	601555	东吴证券	2,391,770	14,111,443.00	0.40
45	600038	中直股份	342,300	14,071,953.00	0.40
46	003019	宸展光电	554,415	14,043,331.95	0.39
47	601899	紫金矿业	780,300	13,709,871.00	0.39
48	600282	南钢股份	2,723,250	13,561,785.00	0.38
49	688556	高测股份	1,134,800	13,492,772.00	0.38
50	600348	华阳股份	1,351,341	13,459,356.36	0.38
51	002138	顺络电子	488,000	13,400,480.00	0.38
52	600941	中国移动	122,700	13,190,250.00	0.37
53	603535	嘉诚国际	812,301	13,110,538.14	0.37
54	000999	华润三九	304,960	12,985,196.80	0.36
55	300389	艾比森	1,054,530	12,949,628.40	0.36
56	603379	三美股份	330,300	12,927,942.00	0.36
57	300679	电连技术	319,200	12,841,416.00	0.36
58	002267	陕天然气	1,696,200	12,823,272.00	0.36
59	601969	海南矿业	2,017,000	12,787,780.00	0.36
60	600901	江苏金租	2,511,886	12,685,024.30	0.36
61	603939	益丰药房	516,172	12,672,022.60	0.36
62	600618	氯碱化工	1,441,003	12,652,006.34	0.36
63	601169	北京银行	2,130,500	12,442,120.00	0.35
64	600801	华新水泥	904,400	12,435,500.00	0.35
65	603681	永冠新材	971,700	12,389,175.00	0.35
66	603277	银都股份	412,200	12,382,488.00	0.35
67	002837	英维克	569,938	12,190,973.82	0.34
68	002372	伟星新材	777,900	11,995,218.00	0.34
69	603883	老百姓	644,410	11,831,367.60	0.33

70	002152	广电运通	1,130,369	11,823,659.74	0.33
71	603688	石英股份	396,050	11,727,040.50	0.33
72	000651	格力电器	298,752	11,717,053.44	0.33
73	603298	杭叉集团	595,940	11,704,261.60	0.33
74	600458	时代新材	1,142,500	11,539,250.00	0.32
75	603515	欧普照明	658,800	11,423,592.00	0.32
76	000913	钱江摩托	719,600	11,340,896.00	0.32
77	002088	鲁阳节能	933,600	11,287,224.00	0.32
78	603629	利通电子	607,900	11,221,834.00	0.32
79	000513	丽珠集团	300,400	11,177,884.00	0.31
80	002988	豪美新材	723,300	11,102,655.00	0.31
81	600970	中材国际	920,100	11,096,406.00	0.31
82	002773	康弘药业	510,900	11,060,985.00	0.31
83	000551	创元科技	1,265,035	11,043,755.55	0.31
84	000830	鲁西化工	938,100	10,872,579.00	0.31
85	002106	莱宝高科	973,200	10,607,880.00	0.30
86	000550	江铃汽车	487,100	10,574,941.00	0.30
87	603983	丸美股份	382,900	10,541,237.00	0.30
88	601989	中国重工	2,133,500	10,518,155.00	0.30
89	601857	中国石油	1,018,600	10,511,952.00	0.30
90	603569	长久物流	1,526,700	10,473,162.00	0.29
91	600183	生益科技	493,300	10,388,898.00	0.29
92	600674	川投能源	552,300	10,355,625.00	0.29
93	601288	农业银行	2,370,300	10,334,508.00	0.29
94	600795	国电电力	1,723,200	10,321,968.00	0.29
95	601988	中国银行	2,230,300	10,303,986.00	0.29
96	600025	华能水电	951,200	10,253,936.00	0.29
97	600820	隧道股份	1,569,900	10,251,447.00	0.29
98	600761	安徽合力	473,700	10,250,868.00	0.29
99	603978	深圳新星	1,145,100	10,248,645.00	0.29
100	601939	建设银行	1,383,933	10,241,104.20	0.29
101	600521	华海药业	599,600	10,223,180.00	0.29
102	300840	酷特智能	1,105,000	10,221,250.00	0.29
103	688208	道通科技	422,955	10,210,133.70	0.29
104	002713	东易日盛	4,634,800	10,196,560.00	0.29
105	600900	长江电力	351,731	10,172,060.52	0.29
106	603985	恒润股份	854,600	10,169,740.00	0.29
107	300850	新强联	674,600	10,132,492.00	0.28
108	603516	淳中科技	320,500	10,118,185.00	0.28
109	002645	华宏科技	1,589,900	10,111,764.00	0.28
110	601916	浙商银行	3,659,300	10,099,668.00	0.28
111	002803	吉宏股份	904,100	10,062,633.00	0.28
112	600285	羚锐制药	415,500	10,059,255.00	0.28

113	601628	中国人寿	323,800	10,053,990.00	0.28
114	300415	伊之密	483,500	10,047,130.00	0.28
115	605136	丽人丽妆	1,822,400	10,041,424.00	0.28
116	601318	中国平安	242,300	10,021,528.00	0.28
117	605499	东鹏饮料	46,400	10,010,800.00	0.28
118	002142	宁波银行	453,100	9,995,386.00	0.28
119	601838	成都银行	656,400	9,970,716.00	0.28
120	000975	银泰黄金	611,900	9,967,851.00	0.28
121	603556	海兴电力	212,800	9,965,424.00	0.28
122	605098	行动教育	233,500	9,951,770.00	0.28
123	688598	金博股份	351,300	9,941,790.00	0.28
124	000923	河钢资源	577,200	9,939,384.00	0.28
125	601601	中国太保	356,400	9,929,304.00	0.28
126	601336	新华保险	330,400	9,921,912.00	0.28
127	601919	中远海控	640,220	9,917,007.80	0.28
128	603558	健盛集团	993,900	9,889,305.00	0.28
129	300130	新国都	594,300	9,889,152.00	0.28
130	000166	申万宏源	2,291,170	9,874,942.70	0.28
131	605186	健麾信息	439,200	9,864,432.00	0.28
132	601101	昊华能源	1,068,903	9,823,218.57	0.28
133	002053	云南能投	812,400	9,821,916.00	0.28
134	603195	公牛集团	126,655	9,767,633.60	0.27
135	002034	旺能环境	749,100	9,745,791.00	0.27
136	600019	宝钢股份	1,465,148	9,743,234.20	0.27
137	002003	伟星股份	773,400	9,706,170.00	0.27
138	600690	海尔智家	341,376	9,688,250.88	0.27
139	601636	旗滨集团	1,497,880	9,661,326.00	0.27
140	600660	福耀玻璃	201,600	9,656,640.00	0.27
141	688036	传音控股	125,980	9,642,509.20	0.27
142	600007	中国国贸	438,825	9,636,597.00	0.27
143	300529	健帆生物	354,000	9,632,340.00	0.27
144	603949	雪龙集团	849,600	9,566,496.00	0.27
145	605016	百龙创园	467,680	9,526,641.60	0.27
146	603712	七一二	522,300	9,500,637.00	0.27
147	000600	建投能源	1,502,500	9,465,750.00	0.27
148	600219	南山铝业	2,437,730	9,287,751.30	0.26
149	002315	焦点科技	344,088	9,276,612.48	0.26
150	002729	好利科技	995,600	9,239,168.00	0.26
151	688018	乐鑫科技	88,500	8,733,180.00	0.25
152	300783	三只松鼠	395,400	8,647,398.00	0.24
153	003006	百亚股份	361,600	8,569,920.00	0.24
154	603355	莱克电气	396,200	8,557,920.00	0.24
155	688236	春立医疗	601,802	8,533,552.36	0.24

156	601369	陕鼓动力	1,061,100	8,510,022.00	0.24
157	600050	中国联通	1,807,500	8,495,250.00	0.24
158	300662	科锐国际	523,900	8,450,507.00	0.24
159	002001	新和成	438,500	8,419,200.00	0.24
160	300750	宁德时代	46,200	8,317,386.00	0.23
161	688475	萤石网络	240,895	8,216,928.45	0.23
162	000933	神火股份	405,600	8,205,288.00	0.23
163	002273	水晶光电	472,400	8,021,352.00	0.23
164	600366	宁波韵升	1,519,700	7,932,834.00	0.22
165	603583	捷昌驱动	389,100	7,929,858.00	0.22
166	605033	美邦股份	635,200	7,889,184.00	0.22
167	600018	上港集团	1,363,600	7,881,608.00	0.22
168	002790	瑞尔特	869,000	7,847,070.00	0.22
169	000921	海信家电	242,500	7,818,200.00	0.22
170	600557	康缘药业	493,600	7,749,520.00	0.22
171	601985	中国核电	724,500	7,723,170.00	0.22
172	002635	安洁科技	497,900	7,687,576.00	0.22
173	000972	中基健康	3,430,900	7,650,907.00	0.21
174	688551	科威尔	241,600	7,610,400.00	0.21
175	603053	成都燃气	786,600	7,598,556.00	0.21
176	300973	立高食品	269,700	7,575,873.00	0.21
177	002833	弘亚数控	415,171	7,572,719.04	0.21
178	600548	深高速	712,000	7,568,560.00	0.21
179	002140	东华科技	972,700	7,538,425.00	0.21
180	605296	神农集团	214,000	7,522,100.00	0.21
181	603093	南华期货	867,600	7,513,416.00	0.21
182	603333	尚纬股份	2,405,000	7,479,550.00	0.21
183	688388	嘉元科技	764,986	7,458,613.50	0.21
184	002354	天娱数科	2,487,900	7,438,821.00	0.21
185	603618	杭电股份	1,697,300	7,434,174.00	0.21
186	300673	佩蒂股份	566,400	7,431,168.00	0.21
187	002229	鸿博股份	673,000	7,429,920.00	0.21
188	002884	凌霄泵业	385,715	7,405,728.00	0.21
189	002422	科伦药业	243,500	7,385,355.00	0.21
190	601512	中新集团	968,100	7,376,922.00	0.21
191	603380	易德龙	366,200	7,353,296.00	0.21
192	603729	龙韵股份	553,700	7,342,062.00	0.21
193	601702	华峰铝业	401,700	7,335,042.00	0.21
194	002948	青岛银行	2,175,900	7,332,783.00	0.21
195	605099	共创草坪	385,800	7,295,478.00	0.20
196	603369	今世缘	157,500	7,276,500.00	0.20
197	688231	隆达股份	508,401	7,249,798.26	0.20
198	002111	威海广泰	695,500	7,247,110.00	0.20

199	603198	迎驾贡酒	125,800	7,233,500.00	0.20
200	603181	皇马科技	803,749	7,225,703.51	0.20
201	000601	韶能股份	1,957,600	7,223,544.00	0.20
202	603666	亿嘉和	456,000	7,195,680.00	0.20
203	601865	福莱特	357,066	7,177,026.60	0.20
204	002801	微光股份	375,800	7,125,168.00	0.20
205	688315	诺禾致源	649,956	7,097,519.52	0.20
206	605183	确成股份	458,774	7,092,646.04	0.20
207	605155	西大门	771,028	7,054,906.20	0.20
208	600233	圆通速递	435,000	6,807,750.00	0.19
209	603786	科博达	105,800	6,787,070.00	0.19
210	600662	外服控股	1,690,662	6,779,554.62	0.19
211	688055	龙腾光电	2,131,086	6,755,542.62	0.19
212	300693	盛弘股份	319,748	6,695,523.12	0.19
213	301109	军信股份	446,462	6,674,606.90	0.19
214	688138	清溢光电	310,220	6,669,730.00	0.19
215	300049	福瑞股份	132,000	6,644,880.00	0.19
216	688033	天宜上佳	1,091,500	6,549,000.00	0.18
217	688616	西力科技	575,900	6,530,706.00	0.18
218	600269	赣粤高速	1,247,100	6,447,507.00	0.18
219	300251	光线传媒	766,500	6,446,265.00	0.18
220	002855	捷荣技术	303,500	6,379,570.00	0.18
221	601077	渝农商行	1,264,600	6,348,292.00	0.18
222	600028	中国石化	998,392	6,309,837.44	0.18
223	605599	菜百股份	484,900	6,172,777.00	0.17
224	300328	宜安科技	1,415,500	6,058,340.00	0.17
225	603727	博迈科	459,400	6,045,704.00	0.17
226	002823	凯中精密	490,700	5,986,540.00	0.17
227	688100	威胜信息	156,600	5,974,290.00	0.17
228	605166	聚合顺	566,500	5,942,585.00	0.17
229	000510	新金路	2,143,000	5,936,110.00	0.17
230	000589	贵州轮胎	1,152,620	5,843,783.40	0.16
231	603337	杰克股份	221,300	5,824,616.00	0.16
232	002777	久远银海	383,200	5,744,168.00	0.16
233	600480	凌云股份	582,900	5,729,907.00	0.16
234	603025	大豪科技	414,100	5,722,862.00	0.16
235	603338	浙江鼎力	94,500	5,709,690.00	0.16
236	600873	梅花生物	566,700	5,678,334.00	0.16
237	600126	杭钢股份	1,380,300	5,673,033.00	0.16
238	600299	安迪苏	575,400	5,581,380.00	0.16
239	300386	飞天诚信	533,100	5,549,571.00	0.16
240	603579	荣泰健康	356,660	5,513,963.60	0.15
241	688375	国博电子	77,901	5,502,926.64	0.15

242	600612	老凤祥	93,420	5,436,109.80	0.15
243	688586	江航装备	576,303	5,359,617.90	0.15
244	300760	迈瑞医疗	18,200	5,294,562.00	0.15
245	688617	惠泰医疗	11,600	5,290,760.00	0.15
246	002615	哈尔斯	851,275	5,277,905.00	0.15
247	002270	华明装备	237,000	5,270,880.00	0.15
248	002139	拓邦股份	494,200	5,248,404.00	0.15
249	300428	立中集团	279,100	5,188,469.00	0.15
250	301078	孩子王	1,021,300	5,167,778.00	0.15
251	300767	震安科技	608,500	5,160,080.00	0.14
252	000576	甘化科工	857,600	5,145,600.00	0.14
253	002550	千红制药	946,600	5,102,174.00	0.14
254	002697	红旗连锁	1,095,800	5,073,554.00	0.14
255	688077	大地熊	320,439	5,072,549.37	0.14
256	600938	中国海油	153,700	5,072,100.00	0.14
257	300408	三环集团	173,400	5,061,546.00	0.14
258	688127	蓝特光学	273,600	5,031,504.00	0.14
259	000100	TCL 科技	1,160,600	5,013,792.00	0.14
260	300908	仲景食品	179,531	4,987,371.18	0.14
261	002919	名臣健康	429,200	4,983,012.00	0.14
262	600770	综艺股份	2,169,000	4,967,010.00	0.14
263	300080	易成新能	1,719,100	4,951,008.00	0.14
264	002996	顺博合金	845,498	4,946,163.30	0.14
265	688468	科美诊断	780,821	4,942,596.93	0.14
266	300226	上海钢联	291,400	4,936,316.00	0.14
267	603039	泛微网络	155,000	4,922,800.00	0.14
268	300308	中际旭创	35,660	4,916,800.80	0.14
269	600461	洪城环境	424,100	4,911,078.00	0.14
270	600036	招商银行	143,500	4,906,265.00	0.14
271	601728	中国电信	796,565	4,898,874.75	0.14
272	002524	光正眼科	1,551,100	4,885,965.00	0.14
273	603711	香飘飘	351,000	4,861,350.00	0.14
274	603897	长城科技	272,400	4,780,620.00	0.13
275	603110	东方材料	429,300	4,778,109.00	0.13
276	601886	江河集团	978,900	4,777,032.00	0.13
277	000738	航发控制	234,900	4,714,443.00	0.13
278	002311	海大集团	97,400	4,582,670.00	0.13
279	688767	博拓生物	180,202	4,517,664.14	0.13
280	688021	奥福环保	485,858	4,469,893.60	0.13
281	000596	古井贡酒	21,000	4,432,470.00	0.12
282	688116	天奈科技	190,600	4,399,048.00	0.12
283	300628	亿联网络	118,800	4,368,276.00	0.12
284	603197	保隆科技	137,600	4,334,400.00	0.12

285	601696	中银证券	476,900	4,330,252.00	0.12
286	000758	中色股份	836,100	4,247,388.00	0.12
287	000626	远大控股	1,016,700	4,219,305.00	0.12
288	002441	众业达	549,700	4,166,726.00	0.12
289	601500	通用股份	779,500	4,162,530.00	0.12
290	002463	沪电股份	113,500	4,142,750.00	0.12
291	688177	百奥泰	194,800	4,114,176.00	0.12
292	688590	新致软件	318,700	4,111,230.00	0.12
293	600519	贵州茅台	2,800	4,108,692.00	0.12
294	002223	鱼跃医疗	108,700	4,087,120.00	0.11
295	601319	中国人保	790,500	4,071,075.00	0.11
296	600989	宝丰能源	233,000	4,037,890.00	0.11
297	688098	申联生物	964,246	4,020,905.82	0.11
298	688323	瑞华泰	397,079	3,998,585.53	0.11
299	688111	金山办公	17,300	3,935,750.00	0.11
300	002519	银河电子	792,700	3,892,157.00	0.11
301	002705	新宝股份	274,300	3,859,401.00	0.11
302	300832	新产业	57,200	3,857,568.00	0.11
303	002068	黑猫股份	541,500	3,844,650.00	0.11
304	600642	申能股份	429,290	3,790,630.70	0.11
305	300451	创业慧康	1,076,500	3,724,690.00	0.10
306	601231	环旭电子	231,100	3,709,155.00	0.10
307	603855	华荣股份	167,700	3,707,847.00	0.10
308	605566	福莱茵特	243,200	3,703,936.00	0.10
309	000848	承德露露	468,200	3,680,052.00	0.10
310	000728	国元证券	602,100	3,648,726.00	0.10
311	300972	万辰集团	171,900	3,632,247.00	0.10
312	001296	长江材料	254,840	3,631,470.00	0.10
313	002449	国星光电	504,800	3,594,176.00	0.10
314	688571	杭华股份	679,316	3,593,581.64	0.10
315	001286	陕西能源	308,200	3,553,546.00	0.10
316	300724	捷佳伟创	64,700	3,494,447.00	0.10
317	300940	南极光	268,800	3,424,512.00	0.10
318	600026	中远海能	218,600	3,412,346.00	0.10
319	000521	长虹美菱	448,400	3,398,872.00	0.10
320	300286	安科瑞	156,300	3,382,332.00	0.10
321	002549	凯美特气	660,936	3,377,382.96	0.09
322	688237	超卓航科	159,607	3,200,120.35	0.09
323	300369	绿盟科技	602,000	3,076,220.00	0.09
324	000887	中鼎股份	250,700	3,068,568.00	0.09
325	002300	太阳电缆	580,300	3,063,984.00	0.09
326	688776	国光电气	53,800	2,980,520.00	0.08
327	600818	中路股份	212,900	2,976,342.00	0.08

328	000020	深华发 A	300,200	2,971,980.00	0.08
329	603893	瑞芯微	50,000	2,958,500.00	0.08
330	300559	佳发教育	308,800	2,955,216.00	0.08
331	000333	美的集团	45,500	2,934,750.00	0.08
332	002380	科远智慧	160,300	2,933,490.00	0.08
333	002343	慈文传媒	561,160	2,918,032.00	0.08
334	002867	周大生	221,500	2,892,790.00	0.08
335	600750	江中药业	123,961	2,864,738.71	0.08
336	603728	鸣志电器	71,000	2,856,330.00	0.08
337	601966	玲珑轮胎	155,400	2,854,698.00	0.08
338	601019	山东出版	235,300	2,781,246.00	0.08
339	300743	天地数码	204,800	2,772,992.00	0.08
340	600184	光电股份	324,956	2,765,375.56	0.08
341	600650	锦江在线	389,900	2,760,492.00	0.08
342	688023	安恒信息	68,749	2,750,647.49	0.08
343	603297	永新光学	45,100	2,728,099.00	0.08
344	301011	华立科技	176,400	2,718,324.00	0.08
345	603239	浙江仙通	196,700	2,696,757.00	0.08
346	300818	耐普矿机	105,480	2,689,740.00	0.08
347	000795	英洛华	485,500	2,689,670.00	0.08
348	300034	钢研高纳	168,500	2,677,465.00	0.08
349	000757	浩物股份	1,056,000	2,650,560.00	0.07
350	002993	奥海科技	71,160	2,647,152.00	0.07
351	603995	甬金股份	150,900	2,643,768.00	0.07
352	688153	唯捷创芯	71,400	2,641,800.00	0.07
353	300978	东箭科技	286,000	2,639,780.00	0.07
354	300626	华瑞股份	352,300	2,638,727.00	0.07
355	002583	海能达	648,300	2,638,581.00	0.07
356	600965	福成股份	722,700	2,630,628.00	0.07
357	601607	上海医药	137,400	2,625,714.00	0.07
358	300873	海晨股份	179,900	2,622,942.00	0.07
359	300071	福石控股	1,258,500	2,605,095.00	0.07
360	603112	华翔股份	246,900	2,594,919.00	0.07
361	600831	广电网络	967,500	2,592,900.00	0.07
362	002691	冀凯股份	590,100	2,590,539.00	0.07
363	002928	华夏航空	407,700	2,584,818.00	0.07
364	601018	宁波港	759,400	2,581,960.00	0.07
365	300955	嘉亨家化	202,900	2,570,743.00	0.07
366	600552	凯盛科技	271,900	2,564,017.00	0.07
367	605018	长华集团	282,800	2,562,168.00	0.07
368	600562	国睿科技	187,500	2,561,250.00	0.07
369	601163	三角轮胎	168,200	2,560,004.00	0.07
370	603505	金石资源	91,560	2,557,270.80	0.07

371	002249	大洋电机	539,100	2,549,943.00	0.07
372	688509	正元地信	880,500	2,544,645.00	0.07
373	000949	新乡化纤	748,300	2,544,220.00	0.07
374	300113	顺网科技	247,900	2,538,496.00	0.07
375	600610	中毅达	636,300	2,532,474.00	0.07
376	600559	老白干酒	138,800	2,523,384.00	0.07
377	000892	欢瑞世纪	1,008,200	2,520,500.00	0.07
378	300652	雷迪克	127,000	2,518,410.00	0.07
379	605208	永茂泰	403,170	2,511,749.10	0.07
380	603279	景津装备	115,800	2,511,702.00	0.07
381	300515	三德科技	253,900	2,505,993.00	0.07
382	601038	一拖股份	158,200	2,501,142.00	0.07
383	000065	北方国际	240,600	2,495,022.00	0.07
384	000951	中国重汽	173,500	2,484,520.00	0.07
385	605305	中际联合	96,240	2,482,029.60	0.07
386	002048	宁波华翔	191,800	2,481,892.00	0.07
387	600623	华谊集团	427,200	2,469,216.00	0.07
388	603713	密尔克卫	46,000	2,461,920.00	0.07
389	688186	广大特材	251,900	2,450,987.00	0.07
390	603806	福斯特	166,120	2,441,964.00	0.07
391	688278	特宝生物	45,400	2,431,170.00	0.07
392	000657	中钨高新	265,800	2,429,412.00	0.07
393	600809	山西汾酒	11,500	2,425,120.00	0.07
394	601827	三峰环境	285,500	2,423,895.00	0.07
395	000619	海螺新材	599,000	2,419,960.00	0.07
396	002276	万马股份	337,400	2,419,158.00	0.07
397	300856	科思股份	75,500	2,416,755.00	0.07
398	300379	东方通	297,700	2,405,416.00	0.07
399	002453	华软科技	559,800	2,401,542.00	0.07
400	300639	凯普生物	521,750	2,400,050.00	0.07
401	603056	德邦股份	183,000	2,397,300.00	0.07
402	002192	融捷股份	79,800	2,395,596.00	0.07
403	300382	斯莱克	404,981	2,393,437.71	0.07
404	603676	卫信康	298,500	2,390,985.00	0.07
405	300476	胜宏科技	74,100	2,390,466.00	0.07
406	002749	国光股份	158,600	2,385,344.00	0.07
407	600391	航发科技	156,400	2,385,100.00	0.07
408	603008	喜临门	137,000	2,374,210.00	0.07
409	002909	集泰股份	575,500	2,359,550.00	0.07
410	600999	招商证券	169,230	2,353,989.30	0.07
411	000045	深纺织 A	293,500	2,353,870.00	0.07
412	000955	欣龙控股	802,300	2,350,739.00	0.07
413	002585	双星新材	467,300	2,317,808.00	0.07

414	301219	腾远钴业	60,200	2,303,252.00	0.06
415	002653	海思科	74,362	2,282,913.40	0.06
416	001914	招商积余	227,200	2,276,544.00	0.06
417	688371	菲沃泰	223,800	2,246,952.00	0.06
418	600398	海澜之家	242,200	2,237,928.00	0.06
419	002545	东方铁塔	324,100	2,207,121.00	0.06
420	000599	青岛双星	625,000	2,206,250.00	0.06
421	002026	山东威达	262,400	2,177,920.00	0.06
422	300820	英杰电气	55,000	2,163,700.00	0.06
423	002265	建设工业	248,400	2,143,692.00	0.06
424	300492	华图山鼎	22,300	2,100,660.00	0.06
425	002947	恒铭达	59,600	2,097,920.00	0.06
426	600800	渤海化学	1,046,400	2,082,336.00	0.06
427	300687	赛意信息	146,100	2,033,712.00	0.06
428	002132	恒星科技	957,300	2,029,476.00	0.06
429	600185	格力地产	471,400	2,003,450.00	0.06
430	002706	良信股份	280,100	1,921,486.00	0.05
431	601595	上海电影	97,100	1,920,638.00	0.05
432	603993	洛阳钼业	224,600	1,909,100.00	0.05
433	000035	中国天楹	420,100	1,903,053.00	0.05
434	000720	新能泰山	783,300	1,887,753.00	0.05
435	000708	中信特钢	138,200	1,875,374.00	0.05
436	688091	上海谊众	80,500	1,818,495.00	0.05
437	600794	保税科技	562,500	1,783,125.00	0.05
438	600787	中储股份	370,600	1,782,586.00	0.05
439	301028	东亚机械	196,400	1,722,428.00	0.05
440	601156	东航物流	82,400	1,676,840.00	0.05
441	301073	君亭酒店	91,500	1,665,300.00	0.05
442	002920	德赛西威	18,900	1,646,001.00	0.05
443	688435	英方软件	64,700	1,614,912.00	0.05
444	603192	汇得科技	119,700	1,607,571.00	0.05
445	688010	福光股份	101,400	1,578,798.00	0.04
446	688151	华强科技	125,982	1,568,475.90	0.04
447	603917	合力科技	136,600	1,478,012.00	0.04
448	688210	统联精密	63,700	1,410,955.00	0.04
449	600887	伊利股份	54,400	1,405,696.00	0.04
450	000678	襄阳轴承	371,200	1,395,712.00	0.04
451	600819	耀皮玻璃	325,600	1,374,032.00	0.04
452	301309	万得凯	51,100	1,306,116.00	0.04
453	603303	得邦照明	113,200	1,299,536.00	0.04
454	603393	新天然气	36,800	1,278,432.00	0.04
455	600760	中航沈飞	31,100	1,247,110.00	0.04
456	002100	天康生物	169,200	1,172,556.00	0.03

457	300323	华灿光电	267,000	1,161,450.00	0.03
458	300001	特锐德	56,800	1,142,816.00	0.03
459	000997	新大陆	79,900	1,111,409.00	0.03
460	600406	国电南瑞	44,300	1,105,728.00	0.03
461	688683	莱尔科技	67,900	1,087,079.00	0.03
462	600828	茂业商业	433,700	1,027,869.00	0.03
463	605365	立达信	59,900	950,613.00	0.03
464	002916	深南电路	8,800	930,776.00	0.03
465	002056	横店东磁	73,300	914,051.00	0.03
466	300867	圣元环保	81,800	867,898.00	0.02
467	002475	立讯精密	22,000	864,820.00	0.02
468	300122	智飞生物	29,500	826,885.00	0.02
469	600741	华域汽车	49,800	815,724.00	0.02
470	600039	四川路桥	97,700	770,853.00	0.02
471	000883	湖北能源	124,300	747,043.00	0.02
472	601963	重庆银行	96,200	745,550.00	0.02
473	300296	利亚德	161,000	724,500.00	0.02
474	300790	宇瞳光学	52,200	704,700.00	0.02
475	002295	精艺股份	132,200	703,304.00	0.02
476	002500	山西证券	143,100	672,570.00	0.02
477	002189	中光学	47,900	667,726.00	0.02
478	601577	长沙银行	72,800	595,504.00	0.02
479	002782	可立克	50,900	563,972.00	0.02
480	300969	恒帅股份	8,100	559,953.00	0.02
481	002591	恒大高新	149,900	548,634.00	0.02
482	601187	厦门银行	100,900	537,797.00	0.02
483	688717	艾罗能源	11,303	531,467.06	0.01
484	002252	上海莱士	65,000	508,300.00	0.01
485	002824	和胜股份	36,900	470,844.00	0.01
486	002444	巨星科技	18,000	444,600.00	0.01
487	601398	工商银行	77,700	442,890.00	0.01
488	002858	力盛体育	42,200	438,880.00	0.01
489	002955	鸿合科技	18,600	434,868.00	0.01
490	600663	陆家嘴	47,616	419,973.12	0.01
491	002282	博深股份	65,000	415,350.00	0.01
492	605007	五洲特纸	31,400	396,582.00	0.01
493	603368	柳药集团	22,579	395,132.50	0.01
494	300187	永清环保	93,800	393,022.00	0.01
495	603878	武进不锈	58,700	383,898.00	0.01
496	000543	皖能电力	43,200	382,320.00	0.01
497	000633	合金投资	95,500	376,270.00	0.01
498	600386	北巴传媒	123,400	344,286.00	0.01
499	603160	汇顶科技	4,900	336,875.00	0.01

500	603103	横店影视	23,500	325,240.00	0.01
501	600908	无锡银行	60,100	319,732.00	0.01
502	600643	爱建集团	75,600	285,012.00	0.01
503	000768	中航西飞	11,800	283,554.00	0.01
504	002319	乐通股份	31,201	268,952.62	0.01
505	002992	宝明科技	4,700	268,135.00	0.01
506	002901	大博医疗	10,000	258,300.00	0.01
507	002498	汉缆股份	75,116	247,131.64	0.01
508	605555	德昌股份	13,200	245,652.00	0.01
509	603605	珀莱雅	2,200	244,178.00	0.01
510	688766	普冉股份	2,500	242,925.00	0.01
511	688310	迈得医疗	18,400	241,776.00	0.01
512	301589	诺瓦星云	1,244	233,884.44	0.01
513	688819	天能股份	9,400	224,284.00	0.01
514	002516	旷达科技	30,800	112,112.00	0.00
515	002933	新兴装备	4,600	105,386.00	0.00
516	601975	招商南油	26,800	96,212.00	0.00
517	688619	罗普特	12,001	84,367.03	0.00
518	600985	淮北矿业	4,900	82,026.00	0.00
519	300953	震裕科技	1,400	75,880.00	0.00
520	002032	苏泊尔	1,500	75,150.00	0.00
521	605066	天正电气	10,375	57,788.75	0.00
522	601108	财通证券	8,700	57,507.00	0.00
523	600423	柳化股份	19,000	43,890.00	0.00
524	300303	聚飞光电	7,800	37,908.00	0.00
525	601298	青岛港	3,600	34,416.00	0.00
526	000557	西部创业	8,600	32,336.00	0.00
527	002212	天融信	6,400	31,168.00	0.00
528	688692	达梦数据	175	30,612.75	0.00
529	002991	甘源食品	500	30,325.00	0.00
530	603285	键邦股份	1,287	24,002.55	0.00
531	688718	唯赛勃	2,689	22,990.95	0.00
532	603350	安乃达	1,051	21,608.56	0.00
533	601033	永兴股份	1,258	20,077.68	0.00
534	301536	星辰科技	481	15,521.87	0.00
535	688584	上海合晶	866	13,760.74	0.00
536	301538	骏鼎达	149	13,594.76	0.00
537	301565	中仑新材	711	13,494.78	0.00
538	603341	龙旗科技	298	11,172.02	0.00
539	688691	灿芯股份	247	10,499.97	0.00
540	301566	达利凯普	576	9,774.72	0.00
541	301392	汇成真空	219	9,123.54	0.00
542	301591	肯特股份	219	8,098.62	0.00

543	301587	中瑞股份	306	7,729.56	0.00
544	001389	广合科技	222	7,672.32	0.00
545	301539	宏鑫科技	361	7,155.02	0.00
546	301578	辰奕智能	153	6,054.21	0.00
547	688695	中创股份	186	5,868.30	0.00
548	688530	欧莱新材	344	5,538.40	0.00
549	301588	美新科技	257	5,461.25	0.00
550	301502	华阳智能	138	5,220.54	0.00
551	603325	博隆技术	66	4,491.96	0.00
552	603381	永臻股份	178	4,473.14	0.00
553	001359	平安电工	184	3,790.40	0.00
554	603312	西典新能	130	3,296.80	0.00
555	603082	北自科技	107	3,155.43	0.00
556	001379	腾达科技	213	2,871.24	0.00
557	603375	盛景微	72	2,800.80	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	688169	石头科技	63,402,449.21	1.09
2	601128	常熟银行	51,851,211.38	0.89
3	000423	东阿阿胶	50,765,460.00	0.87
4	600066	宇通客车	46,968,617.00	0.81
5	688516	奥特维	44,709,971.13	0.77
6	600873	梅花生物	44,366,747.00	0.76
7	603699	纽威股份	43,996,823.00	0.76
8	603939	益丰药房	43,061,282.20	0.74
9	300130	新国都	42,341,472.00	0.73
10	603338	浙江鼎力	41,029,615.80	0.71
11	301239	普瑞眼科	40,194,554.00	0.69
12	001236	弘业期货	40,179,100.92	0.69
13	688252	天德钰	39,349,672.84	0.68
14	300394	天孚通信	38,829,053.90	0.67
15	688188	柏楚电子	38,589,480.77	0.66
16	301015	百洋医药	38,063,455.00	0.66
17	300502	新易盛	37,943,411.00	0.65
18	600997	开滦股份	37,538,469.21	0.65
19	600489	中金黄金	37,421,459.00	0.64
20	002563	森马服饰	35,943,342.00	0.62

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	000333	美的集团	55,765,271.00	0.96
2	603259	药明康德	54,561,229.60	0.94
3	000338	潍柴动力	53,699,062.00	0.93
4	688169	石头科技	51,890,623.12	0.89
5	000932	华菱钢铁	50,858,526.00	0.88
6	600997	开滦股份	50,765,767.35	0.87
7	600161	天坛生物	50,199,444.20	0.86
8	601138	工业富联	48,758,288.00	0.84
9	600489	中金黄金	48,290,448.58	0.83
10	000933	神火股份	48,182,861.57	0.83
11	603993	洛阳钼业	47,215,786.04	0.81
12	600901	江苏金租	46,477,136.00	0.80
13	601728	中国电信	44,550,963.00	0.77
14	002128	电投能源	43,720,048.86	0.75
15	601318	中国平安	42,243,432.92	0.73
16	601398	工商银行	42,158,453.00	0.73
17	000625	长安汽车	41,539,753.20	0.72
18	601857	中国石油	41,301,447.00	0.71
19	600535	天士力	41,132,423.00	0.71
20	300323	华灿光电	40,970,507.45	0.71

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	15,885,739,600.19
卖出股票收入（成交）总额	17,433,676,163.79

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金在风险可控的前提下，根据基金合同规定投资股指期货旨在配合基金日常投资管理需要，更有效地进行流动性管理，实现投资目标。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末无国债期货投资。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货投资。

7.12 投资组合报告附注

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

7.12.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	2,204,212.80
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	3,742,923.85
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,947,136.65

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
华夏智胜先锋股票 (LOF) A	86,837	15,416.01	280,450,615.83	20.95%	1,058,229,699.01	79.05%
华夏智胜先锋股票 C	93,958	22,696.14	614,950,311.32	28.84%	1,517,533,998.91	71.16%
合计	180,795	19,199.45	895,400,927.15	25.80%	2,575,763,697.92	74.20%

8.2 期末上市基金前十名持有人

华夏智胜先锋股票（LOF）A

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	国信证券—工商银行—国信证券工银安盈优享 6 号集合资产管理计划	12,604,275.00	5.39%
2	徐向明	9,965,000.00	4.26%
3	华泰证券资管—工商银行—华泰鹏泰 1 号集合资产管理计划	7,698,100.00	3.29%
4	广东粤财信托有限公司—粤财信托·工信策略 2 号集合资金信托计划	6,542,800.00	2.80%
5	朱群英	5,075,571.00	2.17%
6	谢西就	4,618,113.00	1.98%

7	申万宏源证券—招商银行—申万宏源宏胜大类资产配置 4 号 FOF 集合资产管理计划	4,220,647.00	1.81%
8	朱群江	4,206,123.00	1.80%
9	东莞市嘉荣实业投资有限公司	3,982,618.00	1.70%
10	余子贵	2,867,681.00	1.23%

8.3 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	华夏智胜先锋股票（LOF）A	2,490,251.57	0.19%
	华夏智胜先锋股票 C	802,116.33	0.04%
	合计	3,292,367.90	0.09%

8.4 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	华夏智胜先锋股票（LOF）A	0~10
	华夏智胜先锋股票 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	华夏智胜先锋股票（LOF）A	0~10
	华夏智胜先锋股票 C	0
	合计	0~10

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华夏智胜先锋股票（LOF）A	华夏智胜先锋股票 C
基金合同生效日（2021 年 12 月 15 日）基金份额总额	266,047,009.99	162,223,051.71
本报告期期初基金份额总额	1,720,195,994.74	3,463,407,317.89
本报告期基金总申购份额	323,907,110.66	1,180,272,535.15
减：本报告期基金总赎回份额	705,422,790.56	2,511,195,542.81
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,338,680,314.84	2,132,484,310.23

§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。

本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金所聘用的会计师事务所未发生改变。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人及其高级管理人员在本报告期内无受稽查或处罚等情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信证券	2	33,317,687,339.85	100.00%	7,543,742.48	100.00%	-

注：①为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择券商的标准，即：

i 经营行为规范。

ii 公司财务状况良好。

iii 有良好的内控制度，在业内有良好的声誉。

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

v 建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯和服务。

② 券商专用交易单元选择程序：

i 本基金管理人根据上述标准进行评估并确定选用的券商。

ii 本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议/证券经纪服务协议。

③ 除本表列示外，本基金本报告期未选择其他交易单元作为本基金交易单元。

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
中信证券	1,838,631.51	100.00%	-	-	-	-	-	-

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	2024-02-03
2	华夏智胜先锋股票型证券投资基金（LOF）调整申购及定期定额申购业务上限的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024-02-08
3	华夏智胜先锋股票型证券投资基金（LOF）调整申购及定期定额申购业务上限的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024-03-01
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	2024-03-21

§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、《华夏智胜先锋股票型证券投资基金（LOF）基金合同》；
- 3、《华夏智胜先锋股票型证券投资基金（LOF）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

二〇二四年八月三十日