

华夏安泰对冲策略3个月定期开放灵活配置混  
合型发起式  
证券投资基金  
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：中国银行股份有限公司

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。

基金托管人中国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.....	4
§4 管理人报告.....	5
§5 托管人报告.....	9
§6 中期报告财务会计报告（未经审计）.....	10
6.1 资产负债表.....	10
6.2 利润表.....	11
6.3 净资产变动表.....	12
6.4 报表附注.....	14
§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.....	35
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.....	49
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	50
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.....	50
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.....	50
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.....	50
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.....	50
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	50
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	51
7.13 投资组合报告附注.....	51
§8 基金份额持有人信息.....	52
§9 开放式基金份额变动.....	52
§10 重大事件揭示.....	53
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	55
§12 备查文件目录.....	55

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华夏安泰对冲策略3个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金
基金简称	华夏安泰对冲策略3个月定开混合
基金主代码	008856
交易代码	008856
基金运作方式	契约型定期开放式
基金合同生效日	2020年6月5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	1,850,479,705.86份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在有效控制系统性风险的基础上,运用量化模型建立投资组合,通过衍生工具对冲市场风险,力争实现长期稳健的绝对收益。
投资策略	主要投资策略包括资产配置策略、绝对收益策略、债券投资策略、股指期货和股票期权投资策略、国债期货投资策略、融资融券投资策略、存托凭证投资策略等。本基金所指的绝对收益策略包括ALPHA对冲策略、套利策略、衍生品交易策略、融资融券策略等。本基金以基金管理人自主开发的量化多因子模型为基础,灵活运用多种投资策略建立投资组合,在有效控制风险的前提下,通过金融衍生品工具对冲市场风险,力争实现长期稳健的绝对收益。
业绩比较基准	中国人民银行公布的同期一年期定期存款基准利率(税后)+2%。
风险收益特征	本基金为特殊的混合型基金,通过采用多种绝对收益策略剥离市场系统性风险,因此相对股票型基金和一般的混合型基金其预期风险较小。而相对其业绩比较基准,由于绝对收益策略投资结果的不确定性,因此不能保证一定能获得超越业绩比较基准的绝对收益。

### 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	许俊
	联系电话	400-818-6666	010-66596688
	电子邮箱	service@ChinaAMC.com	fxjd_hq@bank-of-china.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	张佑君	葛海蛟
-------	-----	-----

## 2.4 信息披露方式

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

## 2.5 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（2024年1月1日至2024年6月30日）
本期已实现收益	72,958,471.01
本期利润	79,267,144.77
加权平均基金份额本期利润	0.0487
本期加权平均净值利润率	3.96%
本期基金份额净值增长率	4.13%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024年6月30日)
期末可供分配利润	402,347,505.96
期末可供分配基金份额利润	0.2174
期末基金资产净值	2,303,898,895.12
期末基金份额净值	1.2450
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年6月30日)
基金份额累计净值增长率	24.50%

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	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差	①—③	②—④
----	----------	------------	------------	--------------	-----	-----

		②		准差④		
过去一个月	-0.05%	0.33%	0.29%	0.00%	-0.34%	0.33%
过去三个月	0.91%	0.38%	0.87%	0.00%	0.04%	0.38%
过去六个月	4.13%	0.49%	1.74%	0.00%	2.39%	0.49%
过去一年	6.59%	0.37%	3.50%	0.00%	3.09%	0.37%
过去三年	14.92%	0.36%	10.50%	0.00%	4.42%	0.36%
自基金合同生效起至今	24.50%	0.35%	14.25%	0.00%	10.25%	0.35%

### 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

华夏安泰对冲策略3个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金

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

(2020年6月5日至2024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)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)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中，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	2020-06-05	-	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，股票端以多因子量化投资策略为主，对冲端通过股指期货对冲市场风险，力争获取绝对收益表现。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。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2024 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.2450 元，本报告期份额净值增长率为 4.13%，同期业绩比较基准增长率为 1.74%。

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

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

## §5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在华夏安泰对冲策略 3 个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金（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遵规守信、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：华夏安泰对冲策略3个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金

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
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	6,801,247.31	6,059,476.75
结算备付金		169,684,968.86	213,071,920.46
存出保证金		212,469,138.23	150,328,847.78
交易性金融资产	6.4.7.2	1,918,219,067.22	1,336,364,171.48
其中：股票投资		1,918,219,067.22	1,335,831,136.43
基金投资		-	-
债券投资		-	533,035.05
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		240,663.97	157,413.58
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		2,307,415,085.59	1,705,981,830.05

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
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		123,692.11	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		2,254,875.85	1,740,774.61
应付托管费		375,812.65	290,129.12
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	435,011.02
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	761,809.86	325,230.25
负债合计		3,516,190.47	2,791,145.00
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	1,850,479,705.86	1,424,591,416.46
未分配利润	6.4.7.8	453,419,189.26	278,599,268.59
净资产合计		2,303,898,895.12	1,703,190,685.05
负债和净资产总计		2,307,415,085.59	1,705,981,830.05

注：报告截止日2024年6月30日，基金份额净值1.2450元，基金份额总额1,850,479,705.86份。

## 6.2 利润表

会计主体：华夏安泰对冲策略3个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金

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
<b>一、营业总收入</b>		93,384,976.48	18,923,908.90
1.利息收入		1,905,096.78	275,221.97
其中：存款利息收入	6.4.7.9	1,905,096.78	275,221.97
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）		83,705,422.44	21,414,814.09

其中：股票投资收益	6.4.7.10	62,999,028.65	12,726,715.10
基金投资收益	6.4.7.11	-	-
债券投资收益	6.4.7.12	87,536.55	13,152.35
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	-2,439,659.57	1,160,074.27
股利收益	6.4.7.16	23,058,516.81	7,514,872.37
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	6,308,673.76	-2,780,849.20
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	1,465,783.50	14,722.04
<b>减：二、营业总支出</b>		14,117,831.71	2,004,539.39
1.管理人报酬		11,852,957.45	1,596,429.60
2.托管费		1,975,492.88	332,589.52
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	6.4.7.20	-	-
7.税金及附加		184,906.59	4,287.88
8.其他费用	6.4.7.21	104,474.79	71,232.39
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		79,267,144.77	16,919,369.51
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		79,267,144.77	16,919,369.51
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		79,267,144.77	16,919,369.51

### 6.3 净资产变动表

会计主体：华夏安泰对冲策略3个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金

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	1,424,591,416.46	278,599,268.59	1,703,190,685.05
二、本期期初净资产	1,424,591,416.46	278,599,268.59	1,703,190,685.05
三、本期增减变动	425,888,289.40	174,819,920.67	600,708,210.07

额（减少以“-”号填列）			
（一）、综合收益总额	-	79,267,144.77	79,267,144.77
（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）	425,888,289.40	95,552,775.90	521,441,065.30
其中：1.基金申购款	1,130,088,010.91	249,548,367.44	1,379,636,378.35
2.基金赎回款	-704,199,721.51	-153,995,591.54	-858,195,313.05
（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	1,850,479,705.86	453,419,189.26	2,303,898,895.12
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	81,388,980.02	6,484,509.75	87,873,489.77
二、本期期初净资产	81,388,980.02	6,484,509.75	87,873,489.77
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	908,510,244.94	159,853,325.86	1,068,363,570.80
（一）、综合收益总额	-	16,919,369.51	16,919,369.51
（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）	908,510,244.94	142,933,956.35	1,051,444,201.29
其中：1.基金申购款	934,517,964.26	146,108,945.12	1,080,626,909.38
2.基金赎回款	-26,007,719.32	-3,174,988.77	-29,182,708.09
（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	989,899,224.96	166,337,835.61	1,156,237,060.57

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

华夏安泰对冲策略 3 个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金（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[2019]2892 号《关于准予华夏安泰对冲策略 3 个月定期开放灵活配置混合型发起式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》、《华夏安泰对冲策略 3 个月定期开放灵活配置混合型发起式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。本基金为契约型定期开放式，存续期限为不定期。本基金于 2020 年 5 月 13 日至 2020 年 6 月 2 日募集 1,153,584,795.34 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（2020）验字第 60739337\_A30 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华夏安泰对冲策略 3 个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》于 2020 年 6 月 5 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,154,005,597.33 份基金份额，其中认购资金利息折合 420,801.99 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》和本基金基金合同的有关规定：本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括创业板、中小板、存托凭证及其他经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、可转换公司债券、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、货币市场工具（含同业存单）、资产支持证券、股指期货、国债期货、股票期权以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。

##### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布和修订的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则(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	6,801,247.31
等于：本金	6,797,198.12
加：应计利息	4,049.19
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	6,801,247.31

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	1,982,998,223.96	-	1,918,219,067.22	-64,779,156.74
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	1,982,998,223.96	-	1,918,219,067.22	-64,779,156.74

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			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	

利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-1,835,270,180.00	-	-	-
其中：股指期货	-1,835,270,180.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-1,835,270,180.00	-	-	-

## 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
IC2409	中证 500 期货 IC2409 合约	-100	-97,504,000.00	6,897,280.00
IM2409	中证 1000 期货 IM2409 合约	-125	-119,505,000.00	7,187,080.00
IM2407	中证 1000 期货 IM2407 合约	-163	-158,370,800.00	6,685,040.00
IF2409	沪深 300 期货 IF2409 合约	-229	-235,201,320.00	4,447,200.00
IM2412	中证 1000 期货 IM2412 合约	-259	-242,890,200.00	13,832,720.00
IC2407	中证 500 期货 IC2407 合约	-431	-423,897,120.00	22,671,320.00
IF2407	沪深 300 期货 IF2407 合约	-474	-488,741,400.00	7,439,700.00
合计	-	-	-	69,160,340.00
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	69,160,340.00
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	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	597,328.20
其中：交易所市场	597,328.20
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	164,481.66
合计	761,809.86

6.4.7.7 实收基金

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（份）	账面金额
上年度末	1,424,591,416.46	1,424,591,416.46
本期申购	1,130,088,010.91	1,130,088,010.91
本期赎回（以“-”号填列）	-704,199,721.51	-704,199,721.51
本期末	1,850,479,705.86	1,850,479,705.86

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	243,860,670.95	34,738,597.64	278,599,268.59
本期期初	243,860,670.95	34,738,597.64	278,599,268.59
本期利润	72,958,471.01	6,308,673.76	79,267,144.77
本期基金份额交易产生的变动数	85,528,364.00	10,024,411.90	95,552,775.90

其中：基金申购款	216,847,162.80	32,701,204.64	249,548,367.44
基金赎回款	-131,318,798.80	-22,676,792.74	-153,995,591.54
本期已分配利润	-	-	-
本期末	402,347,505.96	51,071,683.30	453,419,189.26

#### 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	71,847.04
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	1,829,316.24
其他	3,933.50
合计	1,905,096.78

#### 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	5,546,628,956.61
减：卖出股票成本总额	5,478,992,811.36
减：交易费用	4,637,116.60
买卖股票差价收入	62,999,028.65

#### 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	74.90
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	87,461.65
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	87,536.55

##### 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	620,598.76
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	533,000.00
减：应计利息总额	112.15
减：交易费用	24.96
买卖债券差价收入	87,461.65

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	-2,439,659.57

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	23,058,516.81
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	23,058,516.81

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	-38,339,746.24
——股票投资	-38,339,746.24

——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	44,648,420.00
——权证投资	-
——期货投资	44,648,420.00
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	6,308,673.76

#### 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	1,465,783.50
合计	1,465,783.50

#### 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	34,809.32
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行费用	9,993.13
合计	104,474.79

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

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

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
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
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

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	11,644,621,020.87	100.00%	254,979,031.88	14.22%

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
中信证券	620,598.76	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	1,116,652.89	100.00%	597,328.20	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	20,726.85	3.03%	20,726.85	3.28%

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	11,852,957.45	1,596,429.60
其中：应支付销售机构的客户维护费	3,832,892.64	629,518.07
应支付基金管理人的净管理费	8,020,064.81	966,911.53

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 1.20%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×1.20%/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	1,975,492.88	332,589.52

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

无。

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自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

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
期初持有的基金份额	10,000,900.09	10,000,900.09
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	10,000,900.09	10,000,900.09
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	0.54%	1.01%

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

中国银行活期存款	6,801,247.31	71,847.04	7,981,784.84	17,618.33
----------	--------------	-----------	--------------	-----------

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 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	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	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	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

本基金本报告期通过中信期货买卖期货成交额为 696,421,600.00 元（上年度可比期间：658,164,000.00 元），支付给中信期货的佣金为 16,498.27 元（上年度可比期间：15,591.90 元）。

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	150	5,972.74	13,686.00	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	1,918,219,067.22	83.26	1,335,831,136.43	78.43
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	533,035.05	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	1,918,219,067.22	83.26	1,336,364,171.48	78.46

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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
	-5%	-108,694,567.55	-54,965,492.53
	+5%	108,694,567.55	54,965,492.53

#### 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	1,917,192,531.48
第二层次	45,611.11
第三层次	980,924.63
合计	1,918,219,067.22

###### 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	1,918,219,067.22	83.13
	其中：股票	1,918,219,067.22	83.13
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	176,486,216.17	7.65
8	其他各项资产	212,709,802.20	9.22
9	合计	2,307,415,085.59	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	5,656,599.00	0.25
B	采矿业	106,580,314.20	4.63
C	制造业	1,159,199,950.72	50.31
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	97,066,610.94	4.21
E	建筑业	34,515,652.00	1.50
F	批发和零售业	31,242,685.60	1.36
G	交通运输、仓储和邮政业	81,421,895.98	3.53
H	住宿和餐饮业	-	-

I	信息传输、软件和信息技术服务业	91,966,018.24	3.99
J	金融业	242,172,493.10	10.51
K	房地产业	6,667,502.76	0.29
L	租赁和商务服务业	14,659,095.00	0.64
M	科学研究和技术服务业	6,781,226.00	0.29
N	水利、环境和公共设施管理业	17,866,361.68	0.78
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	8,571,173.00	0.37
R	文化、体育和娱乐业	13,851,489.00	0.60
S	综合	-	-
	合计	1,918,219,067.22	83.26

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	26,090	38,284,205.10	1.66
2	300750	宁德时代	147,100	26,482,413.00	1.15
3	600900	长江电力	786,600	22,748,472.00	0.99
4	601318	中国平安	522,722	21,619,781.92	0.94
5	601899	紫金矿业	1,212,100	21,296,597.00	0.92
6	000333	美的集团	285,000	18,382,500.00	0.80
7	002371	北方华创	56,300	18,009,807.00	0.78
8	600036	招商银行	524,935	17,947,527.65	0.78
9	000651	格力电器	454,400	17,821,568.00	0.77
10	600066	宇通客车	683,300	17,629,140.00	0.77
11	000725	京东方A	4,259,600	17,421,764.00	0.76
12	603501	韦尔股份	171,000	16,992,270.00	0.74
13	300760	迈瑞医疗	55,600	16,174,596.00	0.70
14	601398	工商银行	2,753,000	15,692,100.00	0.68
15	600941	中国移动	139,400	14,985,500.00	0.65
16	688188	柏楚电子	79,440	14,660,652.00	0.64
17	601169	北京银行	2,494,600	14,568,464.00	0.63
18	600886	国投电力	797,900	14,553,696.00	0.63
19	601058	赛轮轮胎	1,001,400	14,019,600.00	0.61
20	002128	电投能源	617,700	13,033,470.00	0.57
21	603408	建霖家居	979,800	12,923,562.00	0.56
22	601166	兴业银行	732,400	12,904,888.00	0.56
23	601128	常熟银行	1,704,330	12,901,778.10	0.56
24	688169	石头科技	32,665	12,824,279.00	0.56
25	300502	新易盛	121,100	12,782,105.00	0.55
26	002595	豪迈科技	326,100	12,447,237.00	0.54

27	601857	中国石油	1,167,500	12,048,600.00	0.52
28	002311	海大集团	252,400	11,875,420.00	0.52
29	603871	嘉友国际	666,560	11,791,446.40	0.51
30	600926	杭州银行	889,500	11,607,975.00	0.50
31	601717	郑煤机	773,900	11,453,720.00	0.50
32	603568	伟明环保	541,400	11,142,012.00	0.48
33	002837	英维克	516,380	11,045,368.20	0.48
34	600566	济川药业	345,600	10,958,976.00	0.48
35	601728	中国电信	1,758,600	10,815,390.00	0.47
36	002318	久立特材	450,000	10,498,500.00	0.46
37	603699	纽威股份	599,800	10,268,576.00	0.45
38	600690	海尔智家	357,600	10,148,688.00	0.44
39	300679	电连技术	243,900	9,812,097.00	0.43
40	600018	上港集团	1,673,500	9,672,830.00	0.42
41	000786	北新建材	324,500	9,624,670.00	0.42
42	002138	顺络电子	341,700	9,383,082.00	0.41
43	600820	隧道股份	1,397,900	9,128,287.00	0.40
44	601919	中远海控	575,240	8,910,467.60	0.39
45	000598	兴蓉环境	1,182,200	8,890,144.00	0.39
46	601601	中国太保	318,400	8,870,624.00	0.39
47	605333	沪光股份	316,541	8,815,666.85	0.38
48	600887	伊利股份	334,900	8,653,816.00	0.38
49	000100	TCL 科技	1,982,200	8,563,104.00	0.37
50	600660	福耀玻璃	177,800	8,516,620.00	0.37
51	688208	道通科技	347,500	8,388,650.00	0.36
52	601288	农业银行	1,918,800	8,365,968.00	0.36
53	603195	公牛集团	108,169	8,341,993.28	0.36
54	000423	东阿阿胶	132,613	8,301,573.80	0.36
55	002142	宁波银行	376,200	8,298,972.00	0.36
56	603979	金诚信	162,900	8,231,337.00	0.36
57	600674	川投能源	417,718	7,832,212.50	0.34
58	601658	邮储银行	1,519,200	7,702,344.00	0.33
59	601916	浙商银行	2,786,000	7,689,360.00	0.33
60	600970	中材国际	632,200	7,624,332.00	0.33
61	600177	雅戈尔	1,067,500	7,600,600.00	0.33
62	600026	中远海能	472,878	7,381,625.58	0.32
63	603379	三美股份	184,400	7,217,416.00	0.31
64	600019	宝钢股份	1,072,800	7,134,120.00	0.31
65	000550	江铃汽车	326,600	7,090,486.00	0.31
66	002773	康弘药业	325,400	7,044,910.00	0.31
67	688007	光峰科技	432,900	6,969,690.00	0.30
68	603985	恒润股份	584,600	6,956,740.00	0.30
69	601088	中国神华	156,600	6,948,342.00	0.30

70	601865	福莱特	342,400	6,882,240.00	0.30
71	688516	奥特维	163,000	6,815,030.00	0.30
72	603883	老百姓	369,900	6,791,364.00	0.29
73	600795	国电电力	1,130,300	6,770,497.00	0.29
74	688551	科威尔	212,950	6,707,925.00	0.29
75	601668	中国建筑	1,252,100	6,648,651.00	0.29
76	002267	陕天然气	877,200	6,631,632.00	0.29
77	600801	华新水泥	481,400	6,619,250.00	0.29
78	688586	江航装备	709,500	6,598,350.00	0.29
79	601628	中国人寿	212,500	6,598,125.00	0.29
80	000999	华润三九	154,040	6,559,023.20	0.28
81	688556	高测股份	550,900	6,550,201.00	0.28
82	002782	可立克	588,300	6,518,364.00	0.28
83	601939	建设银行	875,231	6,476,709.40	0.28
84	002978	安宁股份	231,900	6,460,734.00	0.28
85	600183	生益科技	305,800	6,440,148.00	0.28
86	688018	乐鑫科技	65,200	6,433,936.00	0.28
87	603489	八方股份	237,000	6,394,260.00	0.28
88	688236	春立医疗	450,300	6,385,254.00	0.28
89	002713	东易日盛	2,898,600	6,376,920.00	0.28
90	002152	广电运通	608,450	6,364,387.00	0.28
91	600028	中国石化	1,001,700	6,330,744.00	0.27
92	002961	瑞达期货	574,300	6,288,585.00	0.27
93	603949	雪龙集团	556,400	6,265,064.00	0.27
94	601838	成都银行	411,300	6,247,647.00	0.27
95	600458	时代新材	614,410	6,205,541.00	0.27
96	000166	申万宏源	1,436,500	6,191,315.00	0.27
97	300866	安克创新	86,850	6,184,588.50	0.27
98	002646	天佑德酒	593,200	6,068,436.00	0.26
99	002088	鲁阳节能	500,709	6,053,571.81	0.26
100	600901	江苏金租	1,181,680	5,967,484.00	0.26
101	688510	航亚科技	320,800	5,905,928.00	0.26
102	002916	深南电路	55,800	5,901,966.00	0.26
103	300767	震安科技	692,900	5,875,792.00	0.26
104	688116	天奈科技	254,200	5,866,936.00	0.25
105	603056	德邦股份	441,600	5,784,960.00	0.25
106	002068	黑猫股份	812,300	5,767,330.00	0.25
107	601319	中国人保	1,118,950	5,762,592.50	0.25
108	600809	山西汾酒	26,900	5,672,672.00	0.25
109	301239	普瑞眼科	159,500	5,635,135.00	0.24
110	000921	海信家电	172,800	5,571,072.00	0.24
111	688111	金山办公	24,200	5,505,500.00	0.24
112	300955	嘉亨家化	430,600	5,455,702.00	0.24

113	603688	石英股份	184,250	5,455,642.50	0.24
114	605296	神农集团	154,100	5,416,615.00	0.24
115	000913	钱江摩托	343,400	5,411,984.00	0.23
116	603197	保隆科技	170,200	5,361,300.00	0.23
117	000975	银泰黄金	327,300	5,331,717.00	0.23
118	605186	健麾信息	236,300	5,307,298.00	0.23
119	601000	唐山港	1,128,400	5,303,480.00	0.23
120	300693	盛弘股份	248,650	5,206,731.00	0.23
121	601818	光大银行	1,633,400	5,177,878.00	0.22
122	603978	深圳新星	574,600	5,142,670.00	0.22
123	300226	上海钢联	302,000	5,115,880.00	0.22
124	300628	亿联网络	138,040	5,075,730.80	0.22
125	688598	金博股份	178,000	5,037,400.00	0.22
126	605155	西大门	546,060	4,996,449.00	0.22
127	688021	奥福环保	537,800	4,947,760.00	0.21
128	002634	棒杰股份	1,369,000	4,914,710.00	0.21
129	001236	弘业期货	688,700	4,896,657.00	0.21
130	000619	海螺新材	1,206,800	4,875,472.00	0.21
131	600618	氯碱化工	543,900	4,775,442.00	0.21
132	000933	神火股份	235,400	4,762,142.00	0.21
133	601336	新华保险	157,900	4,741,737.00	0.21
134	688315	诺禾致源	434,200	4,741,464.00	0.21
135	688023	安恒信息	117,800	4,713,178.00	0.20
136	603380	易德龙	232,600	4,670,608.00	0.20
137	688036	传音控股	60,853	4,657,688.62	0.20
138	601328	交通银行	618,700	4,621,689.00	0.20
139	600938	中国海油	139,600	4,606,800.00	0.20
140	600582	天地科技	667,781	4,601,011.09	0.20
141	600025	华能水电	423,275	4,562,904.50	0.20
142	300218	安利股份	299,700	4,519,476.00	0.20
143	600282	南钢股份	903,500	4,499,430.00	0.20
144	600999	招商证券	318,800	4,434,508.00	0.19
145	002645	华宏科技	694,400	4,416,384.00	0.19
146	002563	森马服饰	746,200	4,335,422.00	0.19
147	603368	柳药集团	243,100	4,254,250.00	0.18
148	603160	汇顶科技	61,700	4,241,875.00	0.18
149	601555	东吴证券	712,800	4,205,520.00	0.18
150	000923	河钢资源	243,900	4,199,958.00	0.18
151	002139	拓邦股份	394,500	4,189,590.00	0.18
152	300394	天孚通信	47,140	4,168,118.80	0.18
153	002422	科伦药业	136,700	4,146,111.00	0.18
154	603666	亿嘉和	262,500	4,142,250.00	0.18
155	002372	伟星新材	261,600	4,033,872.00	0.18



156	002635	安洁科技	261,150	4,032,156.00	0.18
157	000596	古井贡酒	19,100	4,031,437.00	0.17
158	601138	工业富联	147,100	4,030,540.00	0.17
159	603298	杭叉集团	203,480	3,996,347.20	0.17
160	600642	申能股份	451,500	3,986,745.00	0.17
161	600521	华海药业	230,600	3,931,730.00	0.17
162	000513	丽珠集团	103,400	3,847,514.00	0.17
163	300857	协创数据	67,500	3,847,500.00	0.17
164	300529	健帆生物	141,300	3,844,773.00	0.17
165	300953	震裕科技	70,600	3,826,520.00	0.17
166	605499	东鹏饮料	17,600	3,797,200.00	0.16
167	688123	聚辰股份	62,000	3,771,460.00	0.16
168	600285	羚锐制药	155,600	3,767,076.00	0.16
169	300251	光线传媒	444,100	3,734,881.00	0.16
170	600050	中国联通	792,900	3,726,630.00	0.16
171	601101	昊华能源	402,800	3,701,732.00	0.16
172	603583	捷昌驱动	181,600	3,701,008.00	0.16
173	600750	江中药业	159,300	3,681,423.00	0.16
174	300303	聚飞光电	756,100	3,674,646.00	0.16
175	000795	英洛华	661,800	3,666,372.00	0.16
176	300820	英杰电气	92,500	3,638,950.00	0.16
177	002532	天山铝业	447,800	3,631,658.00	0.16
178	601098	中南传媒	291,800	3,624,156.00	0.16
179	002001	新和成	188,700	3,623,040.00	0.16
180	688475	萤石网络	105,600	3,602,016.00	0.16
181	600366	宁波韵升	686,600	3,584,052.00	0.16
182	601018	宁波港	1,051,300	3,574,420.00	0.16
183	000551	创元科技	408,300	3,564,459.00	0.15
184	000758	中色股份	701,400	3,563,112.00	0.15
185	600348	华阳股份	357,700	3,562,692.00	0.15
186	002545	东方铁塔	519,100	3,535,071.00	0.15
187	300415	伊之密	168,900	3,509,742.00	0.15
188	600377	宁沪高速	278,100	3,504,060.00	0.15
189	603025	大豪科技	252,860	3,494,525.20	0.15
190	603008	喜临门	200,900	3,481,597.00	0.15
191	605033	美邦股份	280,100	3,478,842.00	0.15
192	688278	特宝生物	64,600	3,459,330.00	0.15
193	600557	康缘药业	219,300	3,443,010.00	0.15
194	002706	良信股份	501,700	3,441,662.00	0.15
195	600380	健康元	307,800	3,438,126.00	0.15
196	688616	西力科技	302,949	3,435,441.66	0.15
197	601702	华峰铝业	187,800	3,429,228.00	0.15
198	300071	福石控股	1,647,400	3,410,118.00	0.15

199	603297	永新光学	56,300	3,405,587.00	0.15
200	688100	威胜信息	88,822	3,388,559.30	0.15
201	002315	焦点科技	125,300	3,378,088.00	0.15
202	300428	立中集团	181,500	3,374,085.00	0.15
203	300783	三只松鼠	153,200	3,350,484.00	0.15
204	600967	内蒙一机	464,500	3,344,400.00	0.15
205	301078	孩子王	658,000	3,329,480.00	0.14
206	603348	文灿股份	119,500	3,308,955.00	0.14
207	603505	金石资源	118,100	3,298,533.00	0.14
208	300408	三环集团	112,900	3,295,551.00	0.14
209	002053	云南能投	272,533	3,294,923.97	0.14
210	600780	通宝能源	558,400	3,294,560.00	0.14
211	603983	丸美股份	119,200	3,281,576.00	0.14
212	002034	旺能环境	251,400	3,270,714.00	0.14
213	603039	泛微网络	102,900	3,268,104.00	0.14
214	600787	中储股份	678,600	3,264,066.00	0.14
215	688033	天宜上佳	542,300	3,253,800.00	0.14
216	002048	宁波华翔	251,400	3,253,116.00	0.14
217	002790	瑞尔特	358,100	3,233,643.00	0.14
218	688776	国光电气	58,300	3,229,820.00	0.14
219	002229	鸿博股份	292,400	3,228,096.00	0.14
220	300451	创业慧康	926,600	3,206,036.00	0.14
221	600219	南山铝业	840,460	3,202,152.60	0.14
222	002249	大洋电机	674,600	3,190,858.00	0.14
223	688383	新益昌	61,100	3,183,921.00	0.14
224	300382	斯莱克	538,000	3,179,580.00	0.14
225	603198	迎驾贡酒	54,631	3,141,282.50	0.14
226	002705	新宝股份	223,200	3,140,424.00	0.14
227	000858	五粮液	24,500	3,136,980.00	0.14
228	601187	厦门银行	588,500	3,136,705.00	0.14
229	600623	华谊集团	541,500	3,129,870.00	0.14
230	300840	酷特智能	337,400	3,120,950.00	0.14
231	688127	蓝特光学	169,300	3,113,427.00	0.14
232	300973	立高食品	110,500	3,103,945.00	0.13
233	000951	中国重汽	215,203	3,081,706.96	0.13
234	600908	无锡银行	577,800	3,073,896.00	0.13
235	600038	中直股份	74,300	3,054,473.00	0.13
236	002453	华软科技	709,300	3,042,897.00	0.13
237	000030	富奥股份	615,815	3,023,651.65	0.13
238	601872	招商轮船	353,700	2,988,765.00	0.13
239	688389	普门科技	182,800	2,972,328.00	0.13
240	300389	艾比森	241,800	2,969,304.00	0.13
241	000657	中钨高新	324,500	2,965,930.00	0.13

242	600391	航发科技	194,000	2,958,500.00	0.13
243	600662	外服控股	737,400	2,956,974.00	0.13
244	002833	弘亚数控	161,300	2,942,112.00	0.13
245	300687	赛意信息	210,800	2,934,336.00	0.13
246	688237	超卓航科	145,700	2,921,285.00	0.13
247	002697	红旗连锁	627,500	2,905,325.00	0.13
248	300673	佩蒂股份	219,017	2,873,503.04	0.12
249	601963	重庆银行	369,500	2,863,625.00	0.12
250	603333	尚纬股份	918,000	2,854,980.00	0.12
251	002035	华帝股份	458,100	2,853,963.00	0.12
252	300379	东方通	351,800	2,842,544.00	0.12
253	002123	梦网科技	404,100	2,840,823.00	0.12
254	603338	浙江鼎力	46,952	2,836,839.84	0.12
255	000830	鲁西化工	244,200	2,830,278.00	0.12
256	002901	大博医疗	104,800	2,706,984.00	0.12
257	002549	凯美特气	526,800	2,691,948.00	0.12
258	002653	海思科	87,200	2,677,040.00	0.12
259	605365	立达信	168,500	2,674,095.00	0.12
260	600989	宝丰能源	153,800	2,665,354.00	0.12
261	601886	江河集团	542,100	2,645,448.00	0.11
262	002056	横店东磁	212,000	2,643,640.00	0.11
263	002524	光正眼科	835,400	2,631,510.00	0.11
264	300049	福瑞股份	51,900	2,612,646.00	0.11
265	002884	凌霄泵业	135,000	2,592,000.00	0.11
266	002498	汉缆股份	771,049	2,536,751.21	0.11
267	300308	中际旭创	18,380	2,534,234.40	0.11
268	688177	百奥泰	118,100	2,494,272.00	0.11
269	601019	山东出版	211,000	2,494,020.00	0.11
270	603112	华翔股份	236,500	2,485,615.00	0.11
271	603569	长久物流	359,100	2,463,426.00	0.11
272	603162	海通发展	263,648	2,451,926.40	0.11
273	603712	七一二	134,400	2,444,736.00	0.11
274	600559	老白干酒	133,900	2,434,302.00	0.11
275	603713	密尔克卫	45,200	2,419,104.00	0.11
276	600461	洪城环境	207,900	2,407,482.00	0.10
277	301011	华立科技	153,100	2,359,271.00	0.10
278	300515	三德科技	236,100	2,330,307.00	0.10
279	300662	科锐国际	143,800	2,319,494.00	0.10
280	601989	中国重工	466,600	2,300,338.00	0.10
281	603103	横店影视	165,000	2,283,600.00	0.10
282	000972	中基健康	1,020,900	2,276,607.00	0.10
283	600126	杭钢股份	545,800	2,243,238.00	0.10
284	601975	招商南油	607,100	2,179,489.00	0.09

285	002585	双星新材	437,900	2,171,984.00	0.09
286	688030	山石网科	206,500	2,157,925.00	0.09
287	601512	中新集团	279,500	2,129,790.00	0.09
288	601369	陕鼓动力	258,400	2,072,368.00	0.09
289	603681	永冠新材	161,900	2,064,225.00	0.09
290	600299	安迪苏	210,100	2,037,970.00	0.09
291	688679	通源环境	292,400	2,035,104.00	0.09
292	002463	沪电股份	55,500	2,025,750.00	0.09
293	002988	豪美新材	130,100	1,997,035.00	0.09
294	603071	物产环能	158,500	1,986,005.00	0.09
295	002920	德赛西威	22,700	1,976,943.00	0.09
296	002153	石基信息	342,314	1,961,459.22	0.09
297	600552	凯盛科技	207,100	1,952,953.00	0.08
298	600185	格力地产	458,100	1,946,925.00	0.08
299	600810	神马股份	313,600	1,944,320.00	0.08
300	603355	莱克电气	89,700	1,937,520.00	0.08
301	600233	圆通速递	122,800	1,921,820.00	0.08
302	688167	炬光科技	34,900	1,919,500.00	0.08
303	601636	旗滨集团	295,300	1,904,685.00	0.08
304	003006	百亚股份	79,000	1,872,300.00	0.08
305	601985	中国核电	174,900	1,864,434.00	0.08
306	000600	建投能源	295,700	1,862,910.00	0.08
307	603393	新天然气	53,500	1,858,590.00	0.08
308	002036	联创电子	274,900	1,855,575.00	0.08
309	002993	奥海科技	49,830	1,853,676.00	0.08
310	002003	伟星股份	147,200	1,847,360.00	0.08
311	603317	天味食品	161,900	1,847,279.00	0.08
312	002212	天融信	377,700	1,839,399.00	0.08
313	600480	凌云股份	186,500	1,833,295.00	0.08
314	300130	新国都	109,600	1,823,744.00	0.08
315	600707	彩虹股份	265,200	1,806,012.00	0.08
316	688231	隆达股份	126,300	1,801,038.00	0.08
317	603093	南华期货	207,400	1,796,084.00	0.08
318	002354	天娱数科	600,000	1,794,000.00	0.08
319	002011	盾安环境	182,500	1,793,975.00	0.08
320	300841	康华生物	35,400	1,792,656.00	0.08
321	605136	丽人丽妆	323,900	1,784,689.00	0.08
322	600269	赣粤高速	343,900	1,777,963.00	0.08
323	002928	华夏航空	275,300	1,745,402.00	0.08
324	601137	博威合金	114,300	1,741,932.00	0.08
325	300850	新强联	115,300	1,731,806.00	0.08
326	600562	国睿科技	126,100	1,722,526.00	0.07
327	603466	风语筑	200,800	1,714,832.00	0.07

328	688153	唯捷创芯	46,300	1,713,100.00	0.07
329	002163	海南发展	312,200	1,710,856.00	0.07
330	603323	苏农银行	352,000	1,693,120.00	0.07
331	300323	华灿光电	388,300	1,689,105.00	0.07
332	002948	青岛银行	497,000	1,674,890.00	0.07
333	000065	北方国际	161,300	1,672,681.00	0.07
334	600062	华润双鹤	85,100	1,666,258.00	0.07
335	603893	瑞芯微	28,100	1,662,677.00	0.07
336	002839	张家港行	413,000	1,660,260.00	0.07
337	300755	华致酒行	120,800	1,650,128.00	0.07
338	688380	中微半导	97,885	1,636,637.20	0.07
339	688202	美迪西	62,600	1,630,730.00	0.07
340	001286	陕西能源	141,300	1,629,189.00	0.07
341	600007	中国国贸	73,500	1,614,060.00	0.07
342	603786	科博达	24,900	1,597,335.00	0.07
343	002245	蔚蓝锂芯	205,300	1,591,075.00	0.07
344	603658	安图生物	34,400	1,584,808.00	0.07
345	603558	健盛集团	158,700	1,579,065.00	0.07
346	601375	中原证券	462,300	1,576,443.00	0.07
347	300453	三鑫医疗	245,800	1,570,662.00	0.07
348	603919	金徽酒	85,888	1,560,584.96	0.07
349	600761	安徽合力	71,700	1,551,588.00	0.07
350	002911	佛燃能源	169,721	1,551,249.94	0.07
351	601229	上海银行	210,900	1,531,134.00	0.07
352	000400	许继电气	44,100	1,517,481.00	0.07
353	001212	中旗新材	74,200	1,506,260.00	0.07
354	300873	海晨股份	101,500	1,479,870.00	0.06
355	605016	百龙创园	72,270	1,472,139.90	0.06
356	601816	京沪高铁	268,800	1,443,456.00	0.06
357	603516	淳中科技	44,100	1,392,237.00	0.06
358	601969	海南矿业	218,900	1,387,826.00	0.06
359	603618	杭电股份	312,300	1,367,874.00	0.06
360	002991	甘源食品	22,300	1,352,495.00	0.06
361	000601	韶能股份	366,500	1,352,385.00	0.06
362	002729	好利科技	145,400	1,349,312.00	0.06
363	688156	路德环境	100,900	1,334,907.00	0.06
364	600643	爱建集团	349,889	1,319,081.53	0.06
365	002380	科远智慧	71,400	1,306,620.00	0.06
366	002028	思源电气	19,500	1,304,550.00	0.06
367	301177	迪阿股份	69,700	1,296,420.00	0.06
368	605208	永茂泰	206,800	1,288,364.00	0.06
369	301043	绿岛风	53,000	1,265,110.00	0.05
370	603192	汇得科技	92,683	1,244,732.69	0.05

371	300001	特锐德	61,400	1,235,368.00	0.05
372	000848	承德露露	150,400	1,182,144.00	0.05
373	603926	铁流股份	138,900	1,152,870.00	0.05
374	600556	天下秀	305,600	1,112,384.00	0.05
375	688011	新光光电	73,400	1,112,010.00	0.05
376	600956	新天绿能	130,100	1,062,917.00	0.05
377	300119	瑞普生物	72,200	983,364.00	0.04
378	002558	巨人网络	103,000	972,320.00	0.04
379	301227	森鹰窗业	49,700	934,857.00	0.04
380	000568	泸州老窖	6,400	918,336.00	0.04
381	603611	诺力股份	53,600	913,344.00	0.04
382	300886	华业香料	54,600	896,532.00	0.04
383	600406	国电南瑞	34,700	866,112.00	0.04
384	300034	钢研高纳	54,200	861,238.00	0.04
385	002850	科达利	11,200	855,456.00	0.04
386	000338	潍柴动力	52,500	852,600.00	0.04
387	603369	今世缘	18,200	840,840.00	0.04
388	603939	益丰药房	33,472	821,737.60	0.04
389	002550	千红制药	150,400	810,656.00	0.04
390	600612	老凤祥	13,300	773,927.00	0.03
391	001914	招商积余	75,500	756,510.00	0.03
392	603727	博迈科	56,700	746,172.00	0.03
393	000955	欣龙控股	252,500	739,825.00	0.03
394	300122	智飞生物	24,200	678,326.00	0.03
395	688408	中信博	7,200	662,976.00	0.03
396	002320	海峡股份	126,500	652,740.00	0.03
397	001323	慕思股份	22,500	647,325.00	0.03
398	688178	万德斯	62,300	642,313.00	0.03
399	300856	科思股份	20,000	640,200.00	0.03
400	002803	吉宏股份	57,100	635,523.00	0.03
401	002583	海能达	154,000	626,780.00	0.03
402	002475	立讯精密	15,600	613,236.00	0.03
403	002777	久远银海	39,900	598,101.00	0.03
404	603556	海兴电力	12,600	590,058.00	0.03
405	601888	中国中免	9,100	568,659.00	0.02
406	601156	东航物流	27,900	567,765.00	0.02
407	600988	赤峰黄金	34,000	555,560.00	0.02
408	688717	艾罗能源	11,303	531,467.06	0.02
409	603728	鸣志电器	13,000	522,990.00	0.02
410	603013	亚普股份	38,100	513,207.00	0.02
411	600398	海澜之家	54,100	499,884.00	0.02
412	688187	时代电气	10,000	493,800.00	0.02
413	600610	中毅达	123,400	491,132.00	0.02

414	002276	万马股份	67,500	483,975.00	0.02
415	603236	移远通信	10,200	476,646.00	0.02
416	688659	元琛科技	79,400	476,400.00	0.02
417	002807	江阴银行	124,600	469,742.00	0.02
418	603878	武进不锈	70,800	463,032.00	0.02
419	688686	奥普特	7,100	454,613.00	0.02
420	688395	正弦电气	31,534	449,359.50	0.02
421	688680	海优新材	15,400	442,596.00	0.02
422	002798	帝欧家居	134,100	437,166.00	0.02
423	688372	伟测科技	10,400	409,032.00	0.02
424	600863	内蒙华电	86,300	400,432.00	0.02
425	601990	南京证券	50,800	390,144.00	0.02
426	002078	太阳纸业	27,800	387,810.00	0.02
427	688210	统联精密	17,400	385,410.00	0.02
428	600210	紫江企业	70,400	374,528.00	0.02
429	000738	航发控制	18,600	373,302.00	0.02
430	002823	凯中精密	30,200	368,440.00	0.02
431	000811	冰轮环境	35,300	340,645.00	0.01
432	000887	中鼎股份	27,100	331,704.00	0.01
433	603605	珀莱雅	2,900	321,871.00	0.01
434	002500	山西证券	67,400	316,780.00	0.01
435	600906	财达证券	53,700	307,701.00	0.01
436	603882	金域医学	11,200	304,528.00	0.01
437	601666	平煤股份	26,200	293,440.00	0.01
438	601077	渝农商行	57,900	290,658.00	0.01
439	000576	甘化科工	48,300	289,800.00	0.01
440	600998	九州通	58,200	284,016.00	0.01
441	003039	顺控发展	22,300	279,419.00	0.01
442	688353	华盛锂电	15,900	276,024.00	0.01
443	600170	上海建工	126,600	272,190.00	0.01
444	000810	创维数字	31,700	271,986.00	0.01
445	688281	华秦科技	3,200	266,624.00	0.01
446	000633	合金投资	67,400	265,556.00	0.01
447	002027	分众传媒	43,800	265,428.00	0.01
448	688375	国博电子	3,700	261,368.00	0.01
449	601577	长沙银行	31,300	256,034.00	0.01
450	000883	湖北能源	42,600	256,026.00	0.01
451	603993	洛阳钼业	29,100	247,350.00	0.01
452	600861	北京人力	15,000	244,800.00	0.01
453	300761	立华股份	10,600	239,984.00	0.01
454	600760	中航沈飞	5,980	239,798.00	0.01
455	603187	海容冷链	20,500	239,030.00	0.01
456	002681	奋达科技	64,900	236,885.00	0.01

457	603279	景津装备	10,900	236,421.00	0.01
458	301589	诺瓦星云	1,244	233,884.44	0.01
459	600888	新疆众和	32,100	226,947.00	0.01
460	300979	华利集团	3,700	225,145.00	0.01
461	688013	天臣医疗	15,100	224,084.00	0.01
462	300741	华宝股份	14,600	222,504.00	0.01
463	600663	陆家嘴	24,968	220,217.76	0.01
464	600409	三友化工	43,600	218,872.00	0.01
465	002265	建设工业	25,200	217,476.00	0.01
466	000157	中联重科	28,100	215,808.00	0.01
467	000762	西藏矿业	11,300	204,304.00	0.01
468	000768	中航西飞	8,200	197,046.00	0.01
469	002340	格林美	29,600	188,552.00	0.01
470	603995	甬金股份	10,700	187,464.00	0.01
471	601126	四方股份	9,700	186,434.00	0.01
472	600651	飞乐音响	66,100	182,436.00	0.01
473	605599	菜百股份	13,700	174,401.00	0.01
474	603806	福斯特	11,140	163,758.00	0.01
475	300055	万邦达	38,700	156,735.00	0.01
476	600489	中金黄金	10,254	151,759.20	0.01
477	000426	兴业银锡	10,600	143,948.00	0.01
478	600346	恒力石化	9,600	133,920.00	0.01
479	601958	金钼股份	12,500	130,125.00	0.01
480	000988	华工科技	4,200	125,706.00	0.01
481	605123	派克新材	2,200	123,596.00	0.01
482	300080	易成新能	41,200	118,656.00	0.01
483	601326	秦港股份	35,800	113,486.00	0.00
484	600885	宏发股份	4,000	110,720.00	0.00
485	688388	嘉元科技	11,200	109,200.00	0.00
486	601868	中国能建	51,400	108,968.00	0.00
487	000060	中金岭南	25,273	107,157.52	0.00
488	600985	淮北矿业	6,300	105,462.00	0.00
489	688819	天能股份	3,900	93,054.00	0.00
490	600276	恒瑞医药	2,300	88,458.00	0.00
491	601966	玲珑轮胎	4,200	77,154.00	0.00
492	600418	江淮汽车	4,600	72,864.00	0.00
493	000630	铜陵有色	20,000	72,200.00	0.00
494	002158	汉钟精机	4,300	71,896.00	0.00
495	300611	美力科技	8,800	67,056.00	0.00
496	300573	兴齐眼药	400	65,600.00	0.00
497	002867	周大生	4,700	61,382.00	0.00
498	601233	桐昆股份	3,800	60,648.00	0.00
499	600741	华域汽车	3,600	58,968.00	0.00



500	600459	贵研铂业	4,000	54,040.00	0.00
501	002925	盈趣科技	4,170	52,833.90	0.00
502	600267	海正药业	7,500	52,650.00	0.00
503	002625	光启技术	2,900	50,315.00	0.00
504	600392	盛和资源	5,800	49,996.00	0.00
505	002384	东山精密	2,400	49,680.00	0.00
506	300986	志特新材	6,600	44,682.00	0.00
507	600490	鹏欣资源	16,200	42,120.00	0.00
508	601609	金田股份	5,700	32,262.00	0.00
509	600873	梅花生物	3,200	32,064.00	0.00
510	600096	云天化	1,600	31,072.00	0.00
511	688692	达梦数据	175	30,612.75	0.00
512	000557	西部创业	7,800	29,328.00	0.00
513	600864	哈投股份	5,300	25,175.00	0.00
514	603285	键邦股份	1,287	24,002.55	0.00
515	603729	龙韵股份	1,700	22,542.00	0.00
516	603350	安乃达	1,051	21,608.56	0.00
517	601033	永兴股份	1,258	20,077.68	0.00
518	301536	星辰科技	481	15,521.87	0.00
519	003036	泰坦股份	1,900	15,181.00	0.00
520	688584	上海合晶	866	13,760.74	0.00
521	301538	骏鼎达	150	13,686.00	0.00
522	301565	中仑新材	711	13,494.78	0.00
523	688526	科前生物	900	13,221.00	0.00
524	603341	龙旗科技	298	11,172.02	0.00
525	600928	西安银行	3,300	10,791.00	0.00
526	688691	灿芯股份	247	10,499.97	0.00
527	301566	达利凯普	576	9,774.72	0.00
528	301392	汇成真空	219	9,123.54	0.00
529	301591	肯特股份	219	8,098.62	0.00
530	301587	中瑞股份	306	7,729.56	0.00
531	001389	广合科技	222	7,672.32	0.00
532	301539	宏鑫科技	361	7,155.02	0.00
533	301578	辰奕智能	153	6,054.21	0.00
534	688695	中创股份	186	5,868.30	0.00
535	688530	欧莱新材	344	5,538.40	0.00
536	301588	美新科技	257	5,461.25	0.00
537	301502	华阳智能	138	5,220.54	0.00
538	603325	博隆技术	66	4,491.96	0.00
539	603381	永臻股份	178	4,473.14	0.00
540	001359	平安电工	184	3,790.40	0.00
541	603312	西典新能	130	3,296.80	0.00
542	603082	北自科技	107	3,155.43	0.00

543	001379	腾达科技	213	2,871.24	0.00
544	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	601899	紫金矿业	32,575,148.00	1.91
2	600036	招商银行	29,201,145.00	1.71
3	000651	格力电器	28,784,593.00	1.69
4	601169	北京银行	26,807,104.32	1.57
5	600519	贵州茅台	25,288,384.00	1.48
6	603259	药明康德	24,132,444.83	1.42
7	300760	迈瑞医疗	24,016,028.00	1.41
8	600900	长江电力	22,865,565.00	1.34
9	688617	惠泰医疗	22,044,830.49	1.29
10	000725	京东方A	21,416,171.00	1.26
11	600941	中国移动	21,034,359.00	1.23
12	688169	石头科技	19,692,939.10	1.16
13	688188	柏楚电子	19,362,743.64	1.14
14	600406	国电南瑞	19,288,415.80	1.13
15	601328	交通银行	19,205,880.00	1.13
16	000423	东阿阿胶	19,064,623.36	1.12
17	600066	宇通客车	18,787,899.00	1.10
18	601658	邮储银行	18,428,804.00	1.08
19	688111	金山办公	18,304,107.76	1.07
20	300750	宁德时代	18,276,863.00	1.07

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	603259	药明康德	41,877,309.64	2.46
2	601328	交通银行	33,353,670.00	1.96
3	600519	贵州茅台	31,468,044.00	1.85
4	002594	比亚迪	30,381,066.00	1.78
5	000338	潍柴动力	27,946,722.00	1.64
6	600036	招商银行	26,706,224.00	1.57
7	601138	工业富联	26,270,398.00	1.54
8	600276	恒瑞医药	24,428,459.20	1.43

9	000333	美的集团	24,161,305.00	1.42
10	000858	五粮液	23,618,238.00	1.39
11	688617	惠泰医疗	22,038,914.43	1.29
12	601288	农业银行	21,596,845.00	1.27
13	000725	京东方 A	21,445,240.00	1.26
14	300750	宁德时代	20,788,259.00	1.22
15	601857	中国石油	20,767,123.00	1.22
16	000568	泸州老窖	20,744,490.64	1.22
17	600406	国电南瑞	19,726,323.97	1.16
18	601318	中国平安	19,295,643.00	1.13
19	000651	格力电器	18,994,262.00	1.12
20	600007	中国国贸	18,593,478.00	1.09

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	6,099,720,488.39
卖出股票收入（成交）总额	5,546,628,956.61

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

##### （1）股指期货对冲策略

本基金参与股指期货投资将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的。基金经理根据市场的变化、现货市场与期货市场的相关性等因素，计算需要用到的期货合约数量，对这个数量进行动态跟踪与测算，并进行适时灵活调整。

(2) 股指期货套利策略

股指期货套利策略是指积极发现市场上如期货与现货之间、期货不同合约之间等的价差关系，进行套利，以获取绝对收益。股指期货套利包括以下两种方式：

□期现套利：期现套利过程中，由于股指期货合约价格与标的指数价格之间的价差不断变动，套利交易可以通过捕捉该价差进而获利。

□跨期套利：跨期套利过程中，不同期货合约之间的价差不断变动，套利交易通过捕捉合约间价差进而获利。

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 市场中性策略执行情况

截至本报告期末，本基金持有股票资产 1,918,219,067.22 元，占基金资产净值的比例为 83.26%；运用股指期货进行对冲的空头合约市值-1,766,109,840.00 元，占基金资产净值的比例为-76.66%，空头合约市值占股票资产的比例为-92.07%。

本报告期内，本基金执行市场中性策略的投资收益为 83,617,885.89 元，公允价值变动损益为 6,308,673.76 元。

7.13 投资组合报告附注

7.13.1 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。

7.13.2 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。

7.13.3 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	212,469,138.23
2	应收清算款	240,663.97
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	212,709,802.20

7.13.4 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。

7.13.5 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。

7.13.6 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
30,872	59,940.39	948,346,152.89	51.25%	902,133,552.97	48.75%

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	1,538,449.36	0.08%

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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

截至2023年6月5日，华夏安泰对冲策略3个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金的基金合同生效届满三年。

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2020年6月5日）基金份额总额	1,154,005,597.33
本报告期期初基金份额总额	1,424,591,416.46
本报告期基金总申购份额	1,130,088,010.91
减：本报告期基金总赎回份额	704,199,721.51
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,850,479,705.86

## §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，经中国银行股份有限公司研究决定，郭德秋先生不再担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

### 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，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 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	股票交易	应支付该券商的佣金	备注
------	----	------	-----------	----

	单元数量	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	25	11,644,621,020.87	100.00%	1,116,652.89	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，本基金还选择了北京高华证券、财达证券、财通证券、长江证券、东北证券、东方财富证券、东方证券、东海证券、东吴证券、东兴证券、方正证券、高华证券、广发证券、国金证券、国盛证券、国泰君安证券、国信证券、海通证券、华安证券、华泰证券、华西证券、华源证券、华鑫证券、金通证券、南京证券、平安证券、瑞银证券、申万宏源证券、太平洋证券、天风证券、万和证券、五矿证券、西部证券、西南证券、信达证券、兴业证券、野村东方国际证券、招商证券、浙商证券、中国银河证券、中金公司、中信建投证券、中信证券(浙江)、中银国际证券的交易单元作为本基金交易单元，本报告期无股票交易及应付佣金。

④在上述租用的券商交易单元中，财达证券、华鑫证券的交易单元为本基金本期新增的交易单元。本期没有剔除的券商交易单元。

#### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例

中信 证券	620,598.76	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	华夏安泰对冲策略3个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金开放日常申购、赎回、转换业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024-02-02
2	华夏基金管理有限公司关于华夏安泰对冲策略3个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金开放期规模控制方案的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024-02-02
3	华夏基金管理有限公司关于限制华夏安泰对冲策略3个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金申购及转换转入业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024-02-02
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	2024-02-03
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	2024-03-21
6	华夏安泰对冲策略3个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金开放日常申购、赎回、转换业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024-05-10
7	华夏基金管理有限公司关于华夏安泰对冲策略3个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金开放期规模控制方案的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024-05-10
8	华夏基金管理有限公司关于限制华夏安泰对冲策略3个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金申购及转换转入业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024-05-10
9	华夏基金管理有限公司关于调整华夏安泰对冲策略3个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金开放期总规模上限的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024-05-16

## §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、《华夏安泰对冲策略3个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《华夏安泰对冲策略3个月定期开放灵活配置混合型发起式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

二〇二四年八月三十日