

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

2025 年中期报告

2025 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：二〇二五年八月三十日

§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 2025 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 2025 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	1
§2 基金简介.....	3
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	4
3.1 主要会计数据和财务指标.....	4
3.2 基金净值表现.....	4
§4 管理人报告.....	5
§5 托管人报告.....	10
§6 中期报告财务会计报告（未经审计）.....	10
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.....	14
§7 投资组合报告.....	34
7.1 期末基金资产组合情况.....	34
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	34
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.....	35
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	45
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.....	45
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.....	45
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.....	45
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.....	45
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	45
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	46
7.14 投资组合报告附注.....	46
§8 基金份额持有人信息.....	47
§9 开放式基金份额变动.....	48
§10 重大事件揭示.....	48
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	51
§12 备查文件目录.....	51

§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	479,946,447.29 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		北京市朝阳区北辰西路6号院 北辰中心C座5层	北京市西城区复兴门内大街1号
邮政编码		100101	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	北京市朝阳区北辰西路 6 号院北辰中心 C 座 5 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（2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	25,146,904.21
本期利润	7,696,418.81
加权平均基金份额本期利润	0.0116
本期加权平均净值利润率	0.95%
本期基金份额净值增长率	1.77%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2025年6月30日)
期末可供分配利润	107,465,640.40
期末可供分配基金份额利润	0.2239
期末基金资产净值	592,362,947.67
期末基金份额净值	1.2342
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025年6月30日)
基金份额累计净值增长率	23.42%

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	-0.24%	0.13%	0.30%	0.00%	-0.54%	0.13%
过去三个月	1.57%	0.21%	0.87%	0.00%	0.70%	0.21%
过去六个月	1.77%	0.23%	1.74%	0.00%	0.03%	0.23%
过去一年	-0.87%	0.41%	3.50%	0.00%	-4.37%	0.41%
过去三年	16.49%	0.36%	10.50%	0.00%	5.99%	0.36%
自基金合同生效起至今	23.42%	0.36%	17.74%	0.00%	5.68%	0.36%

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 2025 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、首批浮动管理费基金管理人,境内首家承诺“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,形成了覆盖宽基指数、港股(QDII)指数、港股(港股通)指数、行业主题指数、策略指数、跨境指数、固收指数、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 2025 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 2/11;在灵活配置型基金(基准股票比例 30%-60%)(A 类)中华夏新锦绣混合 A 排名第 3/420、华夏稳增混合排名第 8/420;在混合型 FOF(权益资产 0-30%)(A 类)中华夏聚惠 FOF(A)排名第 8/75;在偏股型基金(股票上下限 60%-95%)(A 类)中华夏智造升级混合 A 排名第 14/1819、华夏成长精选 6 个月定开混合 A 排名第 24/1819、华夏磐润两年定开混合 A 排名第 28/1819、华夏招鑫鸿瑞混合 A 排名第 30/1819、华夏磐益一年定开混合排名第 108/1819、华夏远见成长一年持有混合 A 排名第 111/1819、华夏行业景气混合排名第 137/1819、华夏核心科技 6 个月定开混合 A 排名第 162/1819、华夏先锋科技一年定开混合 A 类排名第 173/1819、华夏价值精选混合排名第 180/1819;在偏股型基金(股票上限 95%)(A 类)中华夏磐利一年定开混合 A 排名第 6/220、华夏磐锐一年定开混合 A 排名第 9/220;在汽车主题行业偏股型基金(A 类)中华夏汽车产业混合 A 排名第 3/16;在消费行业偏股型基金(A 类)中华夏消费臻选混合发起式 A 排名第 6/82;在养老目标风险 FOF(权益资产 0-30%)(A 类)中

华夏稳健养老一年持有混合（FOF）A 排名第 7/81；在养老目标日期 FOF(2035)(A 类)中华夏福泽养老目标 2035 三年持有混合发起式（FOF）A 排名第 4/24。

固收与固收+产品：在普通偏债型基金(股票上限不高于 30%)(A 类)中华夏磐泰混合（LOF）排名第 2/324、华夏永顺一年持有混合 A 排名第 12/324、华夏永康添福混合 A 排名第 29/324；在信用债指数债券型基金(A 类)中华夏亚债中国指数 A 排名第 2/19；在定开纯债债券型基金(A 类)中华夏鼎庆一年定开债券发起式排名第 3/662；在普通债券型基金(可投转债)(A 类)中华夏双债债券 A 排名第 5/257、华夏聚利债券 A 排名第 7/257；在短期纯债债券型基金(A 类)中华夏安益短债债券 A 排名第 8/127；在长期纯债债券型基金(A 类)中华夏鼎茂债券 A 排名第 43/936；在中短期纯债债券型基金(A 类)中华夏中短债债券 A 排名第 22/165；在 QDII 债券型基金(A 类)中华夏收益债券（QDII）A（人民币）排名第 6/24；在普通偏债型基金(股票上限高于 30%)(A 类)中华夏永泓一年持有混合 A 排名第 13/259、华夏永鑫六个月持有混合 A 排名第 30/259。

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基金荣获“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，华夏基金凭借卓越的投资实力以及优秀的中长期业绩回报，将两大奖项收入囊中：公司层面，华夏基金荣获“三年期海外投资明星基金公司”；产品层面，华夏沪深 300ETF 荣获“三年持续回报指数型明星基金奖”。在《上海证券报》主办的第二十届“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，华夏创新前沿股票基金荣获“金基金·股票型基金五年期奖”，华夏行业景气混合基金荣获“金基金·偏股混合型基金五年期奖”。

在客户服务方面，2025 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及相关功能，新增双因子验证和交易时间预估功能，给客户更方便直观的使用体验；（2）华夏基金管家客户端新增恒生指数行情，动态追踪港股风向，行情了解更全面，从客户投资需求出发，进一步提升操作体验；（3）与高华证券、广州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“如何加入 DeepSeek 的朋友圈？”、“一些 ETF 小妙招送给大家”、“哪吒 2、DeepSeek 火出圈，如何抓住投资机遇？”等活动，为客户提供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	-	11 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	-	8 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 74 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

2025 年上半年，国际环境复杂多变，不稳定性、不确定性增加。世界经济增长动能减弱，国际经贸秩序遭受重创，主要经济体经济表现有所分化，通胀走势和货币政策调整存在不确定性。国内

方面，经济运行“稳”的主基调没有变，上半年 GDP 同比增长 5.3%，经济增长稳中有升；CPI 较上年同期下降 0.1%，物价运行总体平稳；月度调查失业率在 5.0%-5.4% 区间波动，就业形势总体稳定；货物进出口总额同比增长 2.9%，外贸展现较强韧性。货币政策方面，央行年初以来强化逆周期货币政策调节力度，持续为市场提供充足的流动性支撑，维持了市场融资环境的持续宽松。

市场方面，2025 年上半年，市场经历了科技创新、关税冲击、内外部流动性由紧转松等诸多因素，估值收缩或抬升是市场波动的主导因素。行业方面，行业行情不断轮动、表现分化较大，有色金属、银行、国防军工等行业表现较好，而煤炭、食品饮料、房地产等行业表现较差。市场风格方面，高 Beta、动量等量价类因子表现较好，而盈利等基本面类因子表现较差，期间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 2025 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.2342 元，本报告期份额净值增长率为 1.77%，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

2025 年下半年，全球经济仍面临通胀回升、贸易政策不确定性、内外需疲软和地缘政治局势易紧难松等多重挑战，主要发达国家均面临经济减速的问题，新兴市场经济体因关税冲击不确定性增加。国内方面，尽管外部环境仍存在不少的不确定性，内部结构调整的压力也较大，但综合来看，下半年中国经济保持稳定增长仍有支撑，一方面，上半年经济稳中有进的发展态势和成效，为完成全年目标打下了良好基础；另一方面，下半年宏观政策将继续协同发力，将为经济稳定运行保驾护航。

市场方面，A 股估值修复已较为充分，进一步上涨需要盈利增速的持续修复和改善，若贸易谈判形势和内需支持政策趋于明朗，市场有望保持震荡上行。预计市场区间震荡，风格呈现轮动特征，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，本基金管理人作为准确、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。会计师事务所对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”部分未在本托管人复核范围内）、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：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	9,590,050.40	16,070,329.91
结算备付金		64,530,056.07	140,611,465.74
存出保证金		38,627,463.12	100,804,121.47
交易性金融资产	6.4.7.2	345,818,596.21	894,206,276.42
其中：股票投资		345,818,596.21	894,206,276.42
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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	135,710,712.35	-
应收清算款		31,378.49	-
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		594,308,256.64	1,151,692,193.54
负债和净资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 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		667,205.48	13,898.27
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		585,643.18	1,164,925.10
应付托管费		97,607.20	194,154.18
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-

其他负债	6.4.7.6	594,853.11	751,314.08
负债合计		1,945,308.97	2,124,291.63
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	479,946,447.29	947,968,274.28
未分配利润	6.4.7.8	112,416,500.38	201,599,627.63
净资产合计		592,362,947.67	1,149,567,901.91
负债和净资产总计		594,308,256.64	1,151,692,193.54

注：报告截止日 2025 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.2342 元，基金份额总额 479,946,447.29 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：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
一、营业总收入		13,679,531.16	93,384,976.48
1.利息收入		1,570,353.24	1,905,096.78
其中：存款利息收入	6.4.7.9	797,392.45	1,905,096.78
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		772,960.79	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		29,326,720.90	83,705,422.44
其中：股票投资收益	6.4.7.10	26,154,172.25	62,999,028.65
基金投资收益	6.4.7.11	-	-
债券投资收益	6.4.7.12	21,662.68	87,536.55
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	-1,609,161.93	-2,439,659.57
股利收益	6.4.7.16	4,760,047.90	23,058,516.81
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-17,450,485.40	6,308,673.76
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	232,942.42	1,465,783.50
减：二、营业总支出		5,983,112.35	14,117,831.71
1.管理人报酬		4,895,188.57	11,852,957.45
2.托管费		815,864.77	1,975,492.88
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		176,027.86	184,906.59
8.其他费用	6.4.7.21	96,031.15	104,474.79
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		7,696,418.81	79,267,144.77
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		7,696,418.81	79,267,144.77
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		7,696,418.81	79,267,144.77

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：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 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	947,968,274.28	201,599,627.63	1,149,567,901.91
二、本期期初净资产	947,968,274.28	201,599,627.63	1,149,567,901.91
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-468,021,826.99	-89,183,127.25	-557,204,954.24
（一）、综合收益总额	-	7,696,418.81	7,696,418.81
（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）	-468,021,826.99	-96,879,546.06	-564,901,373.05
其中：1.基金申购款	39,870,586.77	9,098,837.16	48,969,423.93
2.基金赎回款	-507,892,413.76	-105,978,383.22	-613,870,796.98
（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	479,946,447.29	112,416,500.38	592,362,947.67
项目	上年度可比期间 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、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	425,888,289.40	174,819,920.67	600,708,210.07
（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

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 2025 年 6 月 30 日
活期存款	9,590,050.40
等于：本金	9,589,246.87
加：应计利息	803.53
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
合计	9,590,050.40

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2025 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		334,743,877.54	-	345,818,596.21	11,074,718.67
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		334,743,877.54	-	345,818,596.21	11,074,718.67

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 2025 年 6 月 30 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-

货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-294,893,300.00	-	-	-
其中：股指期货	-294,893,300.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-294,893,300.00	-	-	-

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
IM2512	中证 1000 期货 IM2512 合约	-20	-23,919,200.00	-1,191,800.00
IC2512	中证 500 期货 IC2512 合约	-25	-28,278,000.00	-1,052,120.00
IF2509	沪深 300 期货 IF2509 合约	-30	-34,983,000.00	-2,105,220.00
IC2509	中证 500 期货 IC2509 合约	-50	-57,758,000.00	-7,025,760.00
IM2509	中证 1000 期货 IM2509 合约	-50	-61,556,000.00	-9,619,920.00
IF2507	沪深 300 期货 IF2507 合约	-95	-111,372,300.00	-1,978,380.00
合计	-	-	-	-22,973,200.00
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	-22,973,200.00
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

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	135,710,712.35	-
银行间市场	-	-
合计	135,710,712.35	-

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 2025 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	508,072.66
其中：交易所市场	508,072.66
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	86,780.45
合计	594,853.11

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	947,968,274.28	947,968,274.28
本期申购	39,870,586.77	39,870,586.77
本期赎回（以“-”号填列）	-507,892,413.76	-507,892,413.76
本期末	479,946,447.29	479,946,447.29

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	173,198,029.16	28,401,598.47	201,599,627.63
本期期初	173,198,029.16	28,401,598.47	201,599,627.63
本期利润	25,146,904.21	-17,450,485.40	7,696,418.81
本期基金份额交易产生的变动数	-90,879,292.97	-6,000,253.09	-96,879,546.06
其中：基金申购款	7,884,577.50	1,214,259.66	9,098,837.16
基金赎回款	-98,763,870.47	-7,214,512.75	-105,978,383.22
本期已分配利润	-	-	-
本期末	107,465,640.40	4,950,859.98	112,416,500.38

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	53,866.64

定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	741,157.08
其他	2,368.73
合计	797,392.45

6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	3,057,597,285.15
减：卖出股票成本总额	3,029,033,379.36
减：交易费用	2,409,733.54
买卖股票差价收入	26,154,172.25

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 2025年1月1日至2025年6月30日
债券投资收益——利息收入	3.93
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	21,658.75
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	21,662.68

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 2025年1月1日至2025年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	107,667.20
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	86,000.00
减：应计利息总额	4.15
减：交易费用	4.30

买卖债券差价收入	21,658.75
----------	-----------

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 2025年1月1日至2025年6月30日
股指期货投资收益	-1,609,161.93

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
股票投资产生的股利收益	4,760,047.90
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	4,760,047.90

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
1.交易性金融资产	33,158,994.60
——股票投资	33,158,994.60
——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	-50,609,480.00
——权证投资	-
——期货投资	-50,609,480.00
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	-17,450,485.40

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
基金赎回费收入	232,942.42
合计	232,942.42

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 2025年1月1日至2025年6月30日
审计费用	27,273.08
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	9,250.70
合计	96,031.15

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 2025年1月1日至2025年6月30日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024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%

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 2025年1月1日至2025年6月30日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024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 2025 年 1 月 1 日至 2025 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	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 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%

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。根据证监会公告[2024]3 号《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，自 2024 年 7 月 1 日起，针对被动股票型基金，不再通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用。针对其他类型基金，不再通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

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 2025年1月1日至2025年6月 30日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月30 日
当期发生的基金应支付的管理费	4,895,188.57	11,852,957.45
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,819,368.54	3,832,892.64
应支付基金管理人的净管理费	3,075,820.03	8,020,064.81

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×年费率/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 2025年1月1日至2025年6月 30日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月30 日
当期发生的基金应支付的托管费	815,864.77	1,975,492.88

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

②基金托管费计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×年费率/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固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024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	2.08%	0.54%

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 2025年1月1日至2025年6月30日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行活期存款	9,590,050.40	53,866.64	6,801,247.31	71,847.04

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

2025 年 1 月 1 日至 2025 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	688775	影石创新	新股发行	5,549	262,301.23
中信证券	688583	思看科技	新股发行	1,742	58,287.32
中信证券	688755	汉邦科技	新股发行	2,023	46,063.71
中信证券	301662	宏工科技	新股发行	1,429	38,011.40
中信证券	603257	中国瑞林	新股发行	780	16,005.60
中信证券	603124	江南新材	新股发行	879	9,264.66
上年度可比期间 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

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 2,898,396,400.00 元（上年度可比期间：696,421,600.00 元），支付给中信期货的佣金为 68,663.03 元（上年度可比期间：16,498.27 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（2025 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
688775	影石创新	2025-06-04	6 个月	新发流通受限	47.27	124.16	555	26,234.85	68,908.80	-
688545	兴福电子	2025-01-15	6 个月	新发流通受限	11.68	26.95	994	11,609.92	26,788.30	-

301458	钧崴电子	2025-01-02	6 个月	新发 流通 受限	10.40	34.11	701	7,290.40	23,911.11	-
301275	汉朔科技	2025-03-04	6 个月	新发 流通 受限	27.50	56.19	397	10,917.50	22,307.43	-
688583	思看科技	2025-01-08	6 个月	新发 流通 受限	33.46	79.68	227	5,855.50	18,087.36	含证 券送 配
301678	新恒汇	2025-06-13	6 个月	新发 流通 受限	12.80	44.54	382	4,889.60	17,014.28	-
301602	超研股份	2025-01-15	6 个月	新发 流通 受限	6.70	24.80	658	4,408.60	16,318.40	-
301501	恒鑫生活	2025-03-11	6 个月	新发 流通 受限	39.92	45.22	349	9,620.72	15,781.78	含证 券送 配
603049	中策橡胶	2025-05-27	6 个月	新发 流通 受限	46.50	42.85	362	16,833.00	15,511.70	-
301479	弘景光电	2025-03-06	6 个月	新发 流通 受限	41.90	77.87	182	5,447.00	14,172.34	含证 券送 配
301535	浙江华远	2025-03-18	6 个月	新发 流通 受限	4.92	18.99	734	3,611.28	13,938.66	-
688757	胜科纳米	2025-03-18	6 个月	新发 流通 受限	9.08	25.94	536	4,866.88	13,903.84	-
001388	信通电子	2025-06-24	1 个月内 (含)	新发 流通 受限	16.42	16.42	843	13,842.06	13,842.06	-
603072	天	2024-12-24	6 个月	新发	12.30	54.45	226	2,779.80	12,305.70	-

	和磁材			流通受限						
301662	宏工科技	2025-04-10	6 个月	新发流通受限	26.60	82.50	143	3,803.80	11,797.50	-
301601	惠通科技	2025-01-08	6 个月	新发流通受限	11.80	33.85	342	4,035.60	11,576.70	-
603202	天有为	2025-04-16	6 个月	新发流通受限	93.50	90.66	124	11,594.00	11,241.84	-
001356	富岭股份	2025-01-16	6 个月	新发流通受限	5.30	14.44	709	3,757.70	10,237.96	-
301658	首航新能	2025-03-26	6 个月	新发流通受限	11.80	22.98	437	5,156.60	10,042.26	-
301665	泰禾股份	2025-04-02	6 个月	新发流通受限	10.27	22.39	393	4,036.11	8,799.27	-
688755	汉邦科技	2025-05-09	6 个月	新发流通受限	22.77	39.33	203	4,622.31	7,983.99	-
301173	毓恬冠佳	2025-02-24	6 个月	新发流通受限	28.33	44.98	173	4,901.09	7,781.54	-
001382	新亚电缆	2025-03-13	6 个月	新发流通受限	7.40	20.21	366	2,708.40	7,396.86	-
603014	威高血净	2025-05-12	6 个月	新发流通受限	26.50	32.68	205	5,432.50	6,699.40	-
301636	泽润	2025-04-30	6 个月	新发流通	33.06	47.46	128	4,231.68	6,074.88	-

	新能			受限						
301595	太力科技	2025-05-12	6 个月	新发 流通 受限	17.05	29.10	196	3,341.80	5,703.60	-
301560	众捷汽车	2025-04-17	6 个月	新发 流通 受限	16.50	27.45	190	3,135.00	5,215.50	-
603210	泰鸿万立	2025-04-01	6 个月	新发 流通 受限	8.60	15.61	286	2,459.60	4,464.46	-
603271	永杰新材	2025-03-04	6 个月	新发 流通 受限	20.60	35.08	126	2,595.60	4,420.08	-
603124	江南新材	2025-03-12	6 个月	新发 流通 受限	10.54	46.31	88	927.52	4,075.28	-
001395	亚联机械	2025-01-20	6 个月	新发 流通 受限	19.08	47.25	80	1,526.40	3,780.00	-
603409	汇通控股	2025-02-25	6 个月	新发 流通 受限	24.18	33.32	100	2,418.00	3,332.00	-
001390	古麒绒材	2025-05-21	6 个月	新发 流通 受限	12.08	18.12	178	2,150.24	3,225.36	-
603257	中国瑞林	2025-03-28	6 个月	新发 流通 受限	20.52	37.47	78	1,600.56	2,922.66	-
603400	华之杰	2025-06-12	6 个月	新发 流通 受限	19.88	43.81	57	1,133.16	2,497.17	-
603382	海阳科	2025-06-05	6 个月	新发 流通 受限	11.50	22.39	105	1,207.50	2,350.95	-

	技									
001335	信 凯 科 技	2025-04-02	6 个月	新发 流通 受限	12.80	28.05	80	1,024.00	2,244.00	-
603120	肯 特 催 化	2025-04-09	6 个月	新发 流通 受限	15.00	33.43	65	975.00	2,172.95	-
001388	信 通 电 子	2025-06-24	6 个月	新发 流通 受限	16.42	16.42	94	1,543.48	1,543.48	-

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內。

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 2025 年 6 月 30 日		上年度末 2024 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	345,818,596.21	58.38	894,206,276.42	77.79
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-

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	345,818,596.21	58.38	894,206,276.42	77.79

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 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
	-5%	-19,695,334.58	-46,368,968.55
	+5%	19,695,334.58	46,368,968.55

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 2025 年 6 月 30 日
第一层次	345,378,224.76
第二层次	15,385.54
第三层次	424,985.91
合计	345,818,596.21

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 2025 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	345,818,596.21	58.19
	其中：股票	345,818,596.21	58.19
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	135,710,712.35	22.84
	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	74,120,106.47	12.47
8	其他各项资产	38,658,841.61	6.50
9	合计	594,308,256.64	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	984,084.00	0.17
B	采矿业	8,675,225.00	1.46

C	制造业	186,351,907.93	31.46
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	10,255,937.00	1.73
E	建筑业	3,769,897.00	0.64
F	批发和零售业	4,954,758.00	0.84
G	交通运输、仓储和邮政业	14,785,125.00	2.50
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	29,343,490.75	4.95
J	金融业	68,541,269.27	11.57
K	房地产业	3,851,212.86	0.65
L	租赁和商务服务业	2,876,962.00	0.49
M	科学研究和技术服务业	4,490,080.40	0.76
N	水利、环境和公共设施管理业	2,204,037.00	0.37
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	3,211,650.00	0.54
R	文化、体育和娱乐业	1,522,960.00	0.26
S	综合	-	-
	合计	345,818,596.21	58.38

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

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	600036	招商银行	158,635	7,289,278.25	1.23
2	601318	中国平安	127,622	7,080,468.56	1.20
3	300750	宁德时代	26,520	6,688,874.40	1.13
4	600519	贵州茅台	4,565	6,434,458.80	1.09
5	600900	长江电力	172,900	5,211,206.00	0.88
6	000333	美的集团	63,200	4,563,040.00	0.77
7	601728	中国电信	569,400	4,412,850.00	0.74
8	688256	寒武纪	7,088	4,263,432.00	0.72
9	605499	东鹏饮料	11,910	3,740,335.50	0.63
10	000089	深圳机场	533,600	3,681,840.00	0.62
11	002594	比亚迪	10,900	3,617,819.00	0.61
12	601328	交通银行	450,000	3,600,000.00	0.61
13	601288	农业银行	597,000	3,510,360.00	0.59
14	300476	胜宏科技	25,800	3,467,004.00	0.59
15	000338	潍柴动力	214,300	3,295,934.00	0.56
16	601398	工商银行	432,500	3,282,675.00	0.55
17	600909	华安证券	554,300	3,231,569.00	0.55
18	002524	光正眼科	713,700	3,211,650.00	0.54
19	000050	深天马 A	360,600	3,072,312.00	0.52
20	000725	京东方 A	766,900	3,059,931.00	0.52

21	002595	豪迈科技	51,500	3,049,830.00	0.51
22	601688	华泰证券	165,500	2,947,555.00	0.50
23	601568	北元集团	704,570	2,923,965.50	0.49
24	000408	藏格矿业	63,000	2,688,210.00	0.45
25	301090	华润材料	347,200	2,614,416.00	0.44
26	601658	邮储银行	471,600	2,579,652.00	0.44
27	000001	平安银行	201,332	2,430,077.24	0.41
28	000166	申万宏源	483,820	2,428,776.40	0.41
29	301061	匠心家居	31,190	2,418,472.60	0.41
30	688608	恒玄科技	6,900	2,401,062.00	0.41
31	600941	中国移动	20,700	2,329,785.00	0.39
32	688111	金山办公	8,225	2,303,411.25	0.39
33	601899	紫金矿业	117,700	2,295,150.00	0.39
34	600269	赣粤高速	452,600	2,290,156.00	0.39
35	603022	新通联	206,800	2,287,208.00	0.39
36	600956	新天绿能	292,000	2,254,240.00	0.38
37	000100	TCL 科技	518,400	2,244,672.00	0.38
38	600020	中原高速	469,500	2,244,210.00	0.38
39	601609	金田股份	316,600	2,219,366.00	0.37
40	688208	道通科技	71,997	2,203,108.20	0.37
41	600382	广东明珠	397,200	2,164,740.00	0.37
42	002080	中材科技	111,000	2,164,500.00	0.37
43	002001	新和成	100,800	2,144,016.00	0.36
44	002414	高德红外	206,600	2,117,650.00	0.36
45	600219	南山铝业	545,800	2,090,414.00	0.35
46	603858	步长制药	127,700	2,073,848.00	0.35
47	002545	东方铁塔	231,800	2,060,702.00	0.35
48	600675	中华企业	702,920	2,024,409.60	0.34
49	001227	兰州银行	801,800	2,004,500.00	0.34
50	605507	国邦医药	101,200	2,000,724.00	0.34
51	688183	生益电子	39,000	1,996,800.00	0.34
52	002399	海普瑞	167,400	1,993,734.00	0.34
53	688659	元琛科技	220,400	1,924,092.00	0.32
54	000009	中国宝安	216,600	1,923,408.00	0.32
55	688523	航天环宇	89,100	1,916,541.00	0.32
56	603609	禾丰股份	228,500	1,887,410.00	0.32
57	600061	国投资本	246,700	1,855,184.00	0.31
58	688128	中国电研	74,800	1,832,600.00	0.31
59	002314	南山控股	694,602	1,826,803.26	0.31
60	600075	新疆天业	431,600	1,825,668.00	0.31
61	600728	佳都科技	329,200	1,794,140.00	0.30
62	300232	洲明科技	246,800	1,786,832.00	0.30
63	002807	江阴银行	365,400	1,735,650.00	0.29

64	002926	华西证券	193,400	1,728,996.00	0.29
65	601096	宏盛华源	412,600	1,708,164.00	0.29
66	600662	外服控股	330,300	1,687,833.00	0.28
67	688387	信科移动	298,500	1,686,525.00	0.28
68	601939	建设银行	178,028	1,680,584.32	0.28
69	002925	盈趣科技	93,100	1,673,938.00	0.28
70	300492	华图山鼎	23,940	1,625,047.20	0.27
71	601319	中国人保	184,150	1,603,946.50	0.27
72	688235	百济神州	6,744	1,575,668.16	0.27
73	603259	药明康德	22,600	1,571,830.00	0.27
74	601857	中国石油	183,300	1,567,215.00	0.26
75	600031	三一重工	86,500	1,552,675.00	0.26
76	603893	瑞芯微	10,200	1,548,972.00	0.26
77	601818	光大银行	371,000	1,539,650.00	0.26
78	600063	皖维高新	332,800	1,524,224.00	0.26
79	601668	中国建筑	263,500	1,520,395.00	0.26
80	600299	安迪苏	154,400	1,489,960.00	0.25
81	300140	节能环境	240,200	1,482,034.00	0.25
82	002203	海亮股份	141,900	1,464,408.00	0.25
83	600377	宁沪高速	94,400	1,448,096.00	0.24
84	300406	九强生物	101,100	1,430,565.00	0.24
85	600640	国脉文化	116,800	1,415,616.00	0.24
86	000686	东北证券	185,000	1,411,550.00	0.24
87	002500	山西证券	235,200	1,373,568.00	0.23
88	000630	铜陵有色	410,800	1,372,072.00	0.23
89	601598	中国外运	278,000	1,370,540.00	0.23
90	000952	广济药业	220,260	1,361,206.80	0.23
91	600012	皖通高速	79,300	1,346,514.00	0.23
92	601827	三峰环境	159,100	1,336,440.00	0.23
93	600750	江中药业	60,740	1,325,954.20	0.22
94	002004	华邦健康	314,400	1,311,048.00	0.22
95	600572	康恩贝	299,200	1,310,496.00	0.22
96	301215	中汽股份	204,000	1,264,800.00	0.21
97	000893	亚钾国际	41,900	1,262,866.00	0.21
98	600305	恒顺醋业	162,800	1,258,444.00	0.21
99	603172	万丰股份	78,800	1,255,284.00	0.21
100	000030	富奥股份	211,615	1,246,412.35	0.21
101	002516	旷达科技	236,000	1,215,400.00	0.21
102	002701	奥瑞金	203,900	1,213,205.00	0.20
103	002081	金螳螂	349,400	1,198,442.00	0.20
104	600874	创业环保	198,300	1,183,851.00	0.20
105	600682	南京新百	175,000	1,176,000.00	0.20
106	000708	中信特钢	99,100	1,165,416.00	0.20

107	688088	虹软科技	23,100	1,114,575.00	0.19
108	300017	网宿科技	101,800	1,091,296.00	0.18
109	600276	恒瑞医药	21,000	1,089,900.00	0.18
110	688177	百奥泰	43,400	1,087,604.00	0.18
111	600925	苏能股份	205,300	1,073,719.00	0.18
112	002624	完美世界	69,400	1,052,798.00	0.18
113	000960	锡业股份	68,800	1,052,640.00	0.18
114	000776	广发证券	60,800	1,022,048.00	0.17
115	000783	长江证券	146,600	1,015,938.00	0.17
116	600338	西藏珠峰	90,900	1,008,081.00	0.17
117	000060	中金岭南	219,600	1,005,768.00	0.17
118	000563	陕国投 A	279,700	998,529.00	0.17
119	603678	火炬电子	26,000	988,780.00	0.17
120	300303	聚飞光电	155,900	988,406.00	0.17
121	002638	勤上股份	373,700	982,831.00	0.17
122	600998	九州通	191,100	982,254.00	0.17
123	600016	民生银行	206,500	980,875.00	0.17
124	688584	上海合晶	54,000	965,520.00	0.16
125	600517	国网英大	188,400	960,840.00	0.16
126	000690	宝新能源	211,000	960,050.00	0.16
127	603636	南威软件	75,900	959,376.00	0.16
128	300525	博思软件	65,700	956,592.00	0.16
129	002539	云图控股	101,800	954,884.00	0.16
130	300319	麦捷科技	88,900	954,786.00	0.16
131	605168	三人行	32,400	953,532.00	0.16
132	688209	英集芯	51,600	953,052.00	0.16
133	600499	科达制造	96,700	947,660.00	0.16
134	301295	美硕科技	39,500	942,470.00	0.16
135	601628	中国人寿	22,700	935,013.00	0.16
136	688127	蓝特光学	36,300	933,273.00	0.16
137	301207	华兰疫苗	55,300	932,358.00	0.16
138	002913	奥士康	30,900	908,769.00	0.15
139	600169	太原重工	373,100	902,902.00	0.15
140	600018	上港集团	157,900	901,609.00	0.15
141	603699	纽威股份	28,600	891,462.00	0.15
142	688100	威胜信息	23,900	885,495.00	0.15
143	605376	博迁新材	23,100	885,423.00	0.15
144	000650	仁和药业	162,600	881,292.00	0.15
145	002839	张家港行	194,800	876,600.00	0.15
146	601311	骆驼股份	96,600	872,298.00	0.15
147	600582	天地科技	144,200	863,758.00	0.15
148	002275	桂林三金	59,800	855,738.00	0.14
149	600058	五矿发展	109,700	847,981.00	0.14

150	605116	奥锐特	40,400	844,360.00	0.14
151	300101	振芯科技	37,200	841,836.00	0.14
152	600507	方大特钢	191,000	828,940.00	0.14
153	300655	晶瑞电材	82,700	827,827.00	0.14
154	600866	星湖科技	119,400	825,054.00	0.14
155	300166	东方国信	74,200	808,780.00	0.14
156	603730	岱美股份	140,630	800,184.70	0.14
157	600739	辽宁成大	71,300	784,300.00	0.13
158	300768	迪普科技	45,050	772,607.50	0.13
159	000987	越秀资本	111,300	763,518.00	0.13
160	000728	国元证券	96,400	760,596.00	0.13
161	688018	乐鑫科技	5,160	753,876.00	0.13
162	301291	明阳电气	18,100	744,815.00	0.13
163	300496	中科创达	12,900	738,138.00	0.12
164	601326	秦港股份	228,400	737,732.00	0.12
165	601118	海南橡胶	155,800	735,376.00	0.12
166	002396	星网锐捷	32,400	727,380.00	0.12
167	002060	广东建工	203,900	709,572.00	0.12
168	688289	圣湘生物	34,100	698,368.00	0.12
169	600664	哈药股份	186,800	687,424.00	0.12
170	603876	鼎胜新材	73,100	664,479.00	0.11
171	600757	长江传媒	71,600	664,448.00	0.11
172	000825	太钢不锈	181,653	652,134.27	0.11
173	300246	宝莱特	81,000	647,190.00	0.11
174	600535	天士力	40,900	640,085.00	0.11
175	601169	北京银行	93,700	639,971.00	0.11
176	688232	新点软件	20,700	621,828.00	0.10
177	601166	兴业银行	26,600	620,844.00	0.10
178	002958	青农商行	168,700	609,007.00	0.10
179	000751	锌业股份	193,300	606,962.00	0.10
180	601369	陕鼓动力	68,800	603,376.00	0.10
181	600885	宏发股份	26,040	580,952.40	0.10
182	601665	齐鲁银行	91,900	580,808.00	0.10
183	300207	欣旺达	28,300	567,698.00	0.10
184	600784	鲁银投资	88,630	567,232.00	0.10
185	688004	博汇科技	28,500	567,150.00	0.10
186	300030	阳普医疗	81,500	559,905.00	0.09
187	601158	重庆水务	120,600	559,584.00	0.09
188	300393	中来股份	95,600	550,656.00	0.09
189	300570	太辰光	5,700	549,366.00	0.09
190	002202	金风科技	51,600	528,900.00	0.09
191	600741	华域汽车	29,400	518,910.00	0.09
192	000019	深粮控股	77,000	512,820.00	0.09

193	001311	多利科技	23,920	494,426.40	0.08
194	600918	中泰证券	76,500	491,895.00	0.08
195	002020	京新药业	37,600	490,680.00	0.08
196	300548	博创科技	7,300	487,421.00	0.08
197	601717	郑煤机	29,200	485,304.00	0.08
198	601928	凤凰传媒	43,400	484,778.00	0.08
199	003031	中瓷电子	9,100	484,211.00	0.08
200	688098	申联生物	79,100	483,301.00	0.08
200	300912	凯龙高科	32,900	483,301.00	0.08
201	688300	联瑞新材	10,300	479,465.00	0.08
202	688001	华兴源创	18,600	470,022.00	0.08
203	300850	新强联	13,100	469,242.00	0.08
204	002242	九阳股份	48,400	459,800.00	0.08
205	688185	康希诺	7,700	459,151.00	0.08
206	688217	睿昂基因	17,300	437,690.00	0.07
207	600335	国机汽车	66,600	429,570.00	0.07
208	000597	东北制药	82,800	427,248.00	0.07
209	688563	航材股份	7,400	419,062.00	0.07
210	600143	金发科技	40,600	418,586.00	0.07
211	600073	光明肉业	56,500	416,970.00	0.07
212	002390	信邦制药	118,700	413,076.00	0.07
213	002649	博彦科技	28,300	411,199.00	0.07
214	688469	芯联集成	85,300	406,881.00	0.07
215	603612	索通发展	22,000	404,360.00	0.07
216	000828	东莞控股	37,600	401,944.00	0.07
217	600908	无锡银行	63,500	400,685.00	0.07
218	601766	中国中车	56,900	400,576.00	0.07
219	002517	恺英网络	20,400	393,924.00	0.07
220	601208	东材科技	40,800	386,784.00	0.07
221	601200	上海环境	48,400	384,296.00	0.06
222	301376	致欧科技	21,000	383,250.00	0.06
223	688698	伟创电气	8,100	382,320.00	0.06
224	301327	华宝新能	7,440	382,118.40	0.06
225	300502	新易盛	3,000	381,060.00	0.06
226	603698	航天工程	21,600	380,592.00	0.06
227	300257	开山股份	37,100	373,597.00	0.06
228	688279	峰昭科技	2,000	371,000.00	0.06
229	688116	天奈科技	8,000	366,160.00	0.06
230	605222	起帆电缆	24,100	364,874.00	0.06
231	002706	良信股份	40,700	362,637.00	0.06
232	300151	昌红科技	29,300	360,683.00	0.06
233	002939	长城证券	42,200	353,636.00	0.06
234	002402	和而泰	15,100	349,867.00	0.06

235	002332	仙琚制药	37,800	346,626.00	0.06
236	600055	万东医疗	19,800	342,144.00	0.06
237	001308	康冠科技	15,100	341,562.00	0.06
238	688681	科汇股份	24,300	340,200.00	0.06
239	600538	国发股份	59,300	331,487.00	0.06
240	688026	洁特生物	20,100	329,640.00	0.06
241	600928	西安银行	84,000	329,280.00	0.06
242	002755	奥赛康	20,300	324,394.00	0.05
243	600966	博汇纸业	72,400	320,008.00	0.05
244	001203	大中矿业	33,400	315,630.00	0.05
245	301087	可孚医疗	9,300	308,760.00	0.05
246	301500	飞南资源	14,100	302,022.00	0.05
247	601528	瑞丰银行	51,900	300,501.00	0.05
248	688578	艾力斯	3,200	297,728.00	0.05
249	300383	光环新网	20,800	297,440.00	0.05
250	688366	昊海生科	5,800	297,192.00	0.05
251	601801	皖新传媒	43,200	295,056.00	0.05
252	002736	国信证券	25,000	288,000.00	0.05
253	000651	格力电器	6,400	287,488.00	0.05
254	601869	长飞光纤	6,800	276,896.00	0.05
255	688030	山石网科	16,700	267,033.00	0.05
256	600959	江苏有线	76,600	263,504.00	0.04
257	688432	有研硅	23,600	260,544.00	0.04
258	002976	瑞玛精密	9,900	257,400.00	0.04
259	002069	獐子岛	64,100	248,708.00	0.04
260	600685	中船防务	9,000	244,710.00	0.04
261	000988	华工科技	5,100	239,751.00	0.04
262	002941	新疆交建	19,900	221,686.00	0.04
263	600420	国药现代	20,800	221,520.00	0.04
264	688021	奥福科技	14,000	214,060.00	0.04
265	300811	铂科新材	4,600	213,486.00	0.04
266	301171	易点天下	7,400	197,802.00	0.03
267	600028	中国石化	34,300	193,452.00	0.03
268	688819	天能股份	6,800	188,768.00	0.03
269	300088	长信科技	31,500	187,740.00	0.03
270	688150	莱特光电	7,500	185,400.00	0.03
271	002324	普利特	17,400	184,962.00	0.03
272	600643	爱建集团	22,500	166,950.00	0.03
273	002405	四维图新	18,900	161,406.00	0.03
274	000567	海德股份	26,200	155,104.00	0.03
275	300083	创世纪	18,800	154,536.00	0.03
276	300455	航天智装	10,500	151,200.00	0.03
277	002871	伟隆股份	13,400	149,142.00	0.03

278	300658	延江股份	22,600	146,222.00	0.02
279	688015	交控科技	7,000	145,880.00	0.02
280	300762	上海瀚讯	6,400	144,832.00	0.02
281	601107	四川成渝	23,700	142,674.00	0.02
282	000061	农产品	21,500	137,385.00	0.02
283	301177	迪阿股份	4,500	133,200.00	0.02
284	688586	江航装备	11,800	132,750.00	0.02
285	002120	韵达股份	19,500	130,650.00	0.02
286	300702	天宇股份	5,600	130,256.00	0.02
287	002139	拓邦股份	8,600	118,766.00	0.02
288	300623	捷捷微电	3,900	116,220.00	0.02
289	600531	豫光金铅	14,000	108,360.00	0.02
290	688343	云天励飞	2,000	98,840.00	0.02
291	300226	上海钢联	4,300	98,212.00	0.02
292	000928	中钢国际	14,900	93,572.00	0.02
293	000685	中山公用	9,600	84,288.00	0.01
294	600004	白云机场	9,000	81,900.00	0.01
295	300755	华致酒行	4,100	79,130.00	0.01
296	300420	五洋自控	22,900	78,776.00	0.01
297	601811	新华文轩	5,400	78,678.00	0.01
298	300134	大富科技	6,100	74,603.00	0.01
299	688775	影石创新	555	68,908.80	0.01
300	300463	迈克生物	5,200	61,880.00	0.01
301	300777	中简科技	1,700	61,625.00	0.01
302	688403	汇成股份	5,900	61,301.00	0.01
303	300812	易天股份	2,300	53,153.00	0.01
304	002091	江苏国泰	7,200	52,344.00	0.01
305	002294	信立泰	1,100	52,063.00	0.01
306	300289	利德曼	9,300	48,360.00	0.01
307	002463	沪电股份	1,100	46,838.00	0.01
308	002705	新宝股份	3,000	44,100.00	0.01
309	603766	隆鑫通用	2,800	35,728.00	0.01
310	600267	海正药业	3,700	34,225.00	0.01
311	600352	浙江龙盛	3,100	31,496.00	0.01
312	600482	中国动力	1,300	29,991.00	0.01
313	688141	杰华特	900	29,322.00	0.00
314	601555	东吴证券	3,300	28,875.00	0.00
315	601225	陕西煤业	1,500	28,860.00	0.00
316	601088	中国神华	700	28,378.00	0.00
317	300074	华平股份	5,600	27,328.00	0.00
318	688779	五矿新能	5,000	27,200.00	0.00
319	688545	兴福电子	994	26,788.30	0.00
320	300150	世纪瑞尔	5,300	26,606.00	0.00

321	000750	国海证券	5,900	24,308.00	0.00
322	301458	钧崴电子	701	23,911.11	0.00
323	001366	播恩集团	1,900	23,199.00	0.00
324	002487	大金重工	700	23,030.00	0.00
325	600330	天通股份	3,200	22,944.00	0.00
326	301275	汉朔科技	397	22,307.43	0.00
327	300363	博腾股份	1,300	22,204.00	0.00
328	688583	思看科技	227	18,087.36	0.00
329	301678	新恒汇	382	17,014.28	0.00
330	601390	中国中铁	3,000	16,830.00	0.00
331	301602	超研股份	658	16,318.40	0.00
332	301501	恒鑫生活	349	15,781.78	0.00
333	603049	中策橡胶	362	15,511.70	0.00
334	001388	信通电子	937	15,385.54	0.00
335	301059	金三江	1,300	14,794.00	0.00
336	301479	弘景光电	182	14,172.34	0.00
337	301535	浙江华远	734	13,938.66	0.00
338	688757	胜科纳米	536	13,903.84	0.00
339	600626	申达股份	3,500	12,705.00	0.00
340	603072	天和磁材	226	12,305.70	0.00
341	301662	宏工科技	143	11,797.50	0.00
342	002311	海大集团	200	11,718.00	0.00
343	301601	惠通科技	342	11,576.70	0.00
344	603202	天有为	124	11,241.84	0.00
345	001356	富岭股份	709	10,237.96	0.00
346	301658	首航新能	437	10,042.26	0.00
347	600502	安徽建工	2,000	9,400.00	0.00
348	301665	泰禾股份	393	8,799.27	0.00
349	688755	汉邦科技	203	7,983.99	0.00
350	301173	毓恬冠佳	173	7,781.54	0.00
351	001382	新亚电缆	366	7,396.86	0.00
352	601006	大秦铁路	1,100	7,260.00	0.00
353	603014	威高血净	205	6,699.40	0.00
354	301636	泽润新能	128	6,074.88	0.00
355	600273	嘉化能源	700	5,922.00	0.00
356	301595	太力科技	196	5,703.60	0.00
357	301560	众捷汽车	190	5,215.50	0.00
358	603210	泰鸿万立	286	4,464.46	0.00
359	603271	永杰新材	126	4,420.08	0.00
360	603124	江南新材	88	4,075.28	0.00
361	001395	亚联机械	80	3,780.00	0.00
362	603409	汇通控股	100	3,332.00	0.00
363	001390	古麒绒材	178	3,225.36	0.00

364	600056	中国医药	300	3,102.00	0.00
365	603257	中国瑞林	78	2,922.66	0.00
366	600008	首创环保	900	2,718.00	0.00
367	603400	华之杰	57	2,497.17	0.00
368	603382	海阳科技	105	2,350.95	0.00
369	000898	鞍钢股份	1,000	2,320.00	0.00
370	001335	信凯科技	80	2,244.00	0.00
371	603120	肯特催化	65	2,172.95	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	688111	金山办公	16,878,184.78	1.47
2	688256	寒武纪	15,723,663.17	1.37
3	688235	百济神州	12,914,304.59	1.12
4	000725	京东方 A	12,612,204.00	1.10
5	601899	紫金矿业	11,628,830.00	1.01
6	688041	海光信息	11,265,959.19	0.98
7	600519	贵州茅台	10,679,237.00	0.93
8	601728	中国电信	10,624,124.00	0.92
9	002648	卫星化学	10,447,284.47	0.91
10	300366	创意信息	10,292,917.00	0.90
11	002233	塔牌集团	9,855,310.00	0.86
12	600096	云天化	9,427,352.00	0.82
13	600036	招商银行	9,258,562.00	0.81
14	600019	宝钢股份	9,133,777.00	0.79
15	600919	江苏银行	9,089,364.00	0.79
16	601689	拓普集团	8,524,668.00	0.74
17	300735	光弘科技	8,484,259.00	0.74
18	300750	宁德时代	8,453,289.00	0.74
19	600750	江中药业	8,436,950.60	0.73
20	002532	天山铝业	8,399,947.00	0.73

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	600519	贵州茅台	20,636,021.00	1.80
2	688041	海光信息	17,810,174.19	1.55
3	688235	百济神州	16,757,732.01	1.46
4	688256	寒武纪	15,767,258.29	1.37

5	300750	宁德时代	15,695,308.00	1.37
6	600036	招商银行	15,101,751.00	1.31
7	000725	京东方 A	14,878,208.00	1.29
8	601728	中国电信	14,615,655.00	1.27
9	688315	诺禾致源	14,270,749.00	1.24
10	601899	紫金矿业	14,214,685.00	1.24
11	688111	金山办公	13,812,435.76	1.20
12	601318	中国平安	13,463,053.00	1.17
13	000333	美的集团	13,239,033.00	1.15
14	300366	创意信息	13,208,053.00	1.15
15	002948	青岛银行	13,153,651.20	1.14
16	600900	长江电力	12,419,283.00	1.08
17	601288	农业银行	12,305,492.00	1.07
18	600271	航天信息	11,583,189.00	1.01
19	600096	云天化	11,458,768.00	1.00
20	600019	宝钢股份	11,414,944.00	0.99

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	2,447,486,704.55
卖出股票收入（成交）总额	3,057,597,285.15

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 345,818,596.21 元，占基金资产净值的比例为 58.38%；运用股指期货进行对冲的空头合约市值-317,866,500.00 元，占基金资产净值的比例为-53.66%，空头合约市值占股票资产的比例为-91.92%。

本报告期内，本基金执行市场中性策略的投资收益为 29,305,058.22 元，公允价值变动损益为 -17,450,485.40 元。

7.13 本报告期投资基金情况

7.13.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

7.14 投资组合报告附注

7.14.1 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。

7.14.2 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。

7.14.3 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	38,627,463.12
2	应收清算款	31,378.49
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	38,658,841.61

7.14.4 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。

7.14.5 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。

7.14.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基金份 额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比 例	持有份额	占总份额比 例
13,554	35,409.95	164,266,776.22	34.23%	315,679,671.07	65.77%

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	1,334,938.00	0.28%

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、	0

基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	
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	947,968,274.28
本报告期基金总申购份额	39,870,586.77
减：本报告期基金总赎回份额	507,892,413.76
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	479,946,447.29

§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，聘任边济东先生为资产托管部总经理。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	
华泰证券	3	3,599,829,471.48	65.41%	345,224.77	65.41%	-
国金证券	1	974,643,659.97	17.71%	93,498.23	17.72%	-
方正证券	4	364,545,592.19	6.62%	34,958.96	6.62%	-
中信建投证券	2	283,643,000.25	5.15%	27,195.44	5.15%	-
中国银河证券	7	216,413,494.81	3.93%	20,747.98	3.93%	-
申万宏源证券	4	33,753,947.25	0.61%	3,238.37	0.61%	-
兴业证券	2	30,338,395.59	0.55%	2,909.98	0.55%	-

注：①为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择研究服务证券公司的标准，即：

i 投研部门根据证券公司的总体资质情况、财务状况、研究服务能力、经营行为及风控合规能力等情况，选择证券公司进入交易合作库，并进行跟踪评估，对合作库证券公司进行调整。

ii 投研部门牵头制定证券公司研究服务评价制度，建立健全对证券公司研究服务的定期评价机制。评价指标包括但不限于：业绩贡献、反馈速度、观点或数据质量等。

②为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择交易服务证券公司的标准，即：

i 投资部门根据证券公司的总体资质、财务状况、经营行为和合规风控能力、交易服务能力等情况，选择证券公司进入交易合作库，并进行跟踪监控，对合作库证券公司进行调整。

ii 投资部门牵头制定证券公司交易服务评价制度，建立健全对证券公司交易服务的定期评价机制。

iii 投资部门定期对证券公司的交易服务开展评价，评价指标包括但不限于：交易服务成本、交易服务能力、交易系统稳定性、交易系统支持能力、应急交易能力等。

③证券公司专用交易单元选择程序：

i 投资、研究部门牵头制定规范、合理的合作证券公司管理制度，明确证券公司准入标准、退出程序等。合规管理部门对合作证券公司管理制度进行合规性审查。

ii 投资、研究部门根据上述标准进行评估并确定选用的证券公司。

iii 本基金管理人与被选择的证券公司签订交易单元租用协议/证券经纪服务协议。

④除本表列示外，本基金还选择了北京高华证券、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、高盛（中国）证券、广发证券、国盛证券、国泰海通证券、国信证券、华西证券、华源证券、华鑫证券、南京证券、平安证券、瑞银证券、太平洋证券、万和证券、五矿证券、西部证券、信达证券、野村东方国际证券、招商证券、浙商证券、中金公司、中信证券、中银国际证券的交易单元作为本基金交易单元，本报告期无股票交易及应付佣金。

⑤本报告期内，本基金租用的券商交易单元未发生变更。

⑥国泰君安证券股份有限公司自合并交割日 2025 年 3 月 14 日起吸收合并海通证券股份有限公司。根据《国泰海通证券股份有限公司关于完成公司名称变更、注册资本变更、公司章程修订及相应市场主体变更登记的公告》，自 2025 年 4 月 3 日起，国泰君安证券股份有限公司中文名称变更为“国泰海通证券股份有限公司”。

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
华泰证券	107,667.20	100.00%	4,729,880,000.00	85.42%	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中国银河证券	-	-	571,600,000.00	10.32%	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-	-	-

证券								
兴业 证券	-	-	236,000,000.00	4.26%	-	-	-	-

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	中国证监会规定报刊及网站	2025-02-18
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	中国证监会规定报刊及网站	2025-02-18
3	华夏基金管理有限公司关于办公地址变更的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025-03-07
4	华夏基金管理有限公司关于广州分公司营业场所变更的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025-03-12
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	中国证监会规定报刊及网站	2025-03-14
6	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025-04-12
7	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025-05-10
8	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	中国证监会规定报刊及网站	2025-05-13
9	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	中国证监会规定报刊及网站	2025-05-13

§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、基金合同；
- 3、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

二〇二五年八月三十日