

华夏智胜价值成长股票型发起式
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：招商银行股份有限公司

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。

基金托管人招商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.....	5
§4 管理人报告.....	7
§5 托管人报告.....	11
§6 中期报告财务会计报告（未经审计）.....	12
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	13
6.3 净资产变动表.....	14
6.4 报表附注.....	15
§7 投资组合报告.....	37
7.1 期末基金资产组合情况.....	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	38
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	54
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	57
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.....	57
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.....	57
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.....	57
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.....	57
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	57
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	57
7.13 投资组合报告附注.....	58
§8 基金份额持有人信息.....	58
§9 开放式基金份额变动.....	59
§10 重大事件揭示.....	59
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	62
§12 备查文件目录.....	62

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金	
基金简称	华夏智胜价值成长股票	
基金主代码	002871	
交易代码	002871	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 3 月 6 日	
基金管理人	华夏基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	153,550,036.67 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华夏智胜价值成长股票 A	华夏智胜价值成长股票 C
下属分级基金的交易代码	002871	002872
报告期末下属分级基金的份额总额	101,190,115.34 份	52,359,921.33 份

2.2 基金产品说明

投资目标	利用定量投资模型，灵活应用多种策略，把握市场机会，追求资产的长期增值。
投资策略	主要投资策略包括资产配置策略、股票投资策略、固定收益品种投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、期权投资策略、国债期货投资策略等。在股票投资策略上，本基金采用混合多种投资策略，包含基本面选股策略、多因子策略，辅助其他投资策略如套利类策略、衍生品交易类策略等。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率*95%+银行活期存款利率(税后)*5%。
风险收益特征	本基金为股票基金，其预期风险和预期收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金还可通过港股通渠道投资于香港证券市场，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还将面临汇率风险、香港市场风险等特殊投资风险。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华夏基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李彬	张姗
	联系电话	400-818-6666	400-61-95555
	电子邮箱	service@ChinaAMC.com	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		400-818-6666	400-61-95555
传真		010-63136700	0755-83195201
注册地址		北京市顺义区安庆大街甲3号	深圳市深南大道7088号招商银行大

	院	厦
办公地址	北京市朝阳区北辰西路6号院 北辰中心C座5层	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
邮政编码	100101	518040
法定代表人	张佑君	缪建民

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）	
	华夏智胜价值成长股票 A	华夏智胜价值成长股票 C
本期已实现收益	13,290,342.16	6,733,336.61
本期利润	21,848,063.39	10,973,980.67
加权平均基金份额本期利润	0.2020	0.2122
本期加权平均净值利润率	12.39%	13.15%
本期基金份额净值增长率	13.77%	13.63%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)	
	华夏智胜价值成长股票 A	华夏智胜价值成长股票 C
期末可供分配利润	62,809,310.97	31,343,828.41
期末可供分配基金份额利润	0.6207	0.5986
期末基金资产净值	180,057,052.10	91,901,552.82
期末基金份额净值	1.7794	1.7552
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)	
	华夏智胜价值成长股票 A	华夏智胜价值成长股票 C
基金份额累计净值增长率	84.30%	93.99%

注：①所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

②本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

③期末可供分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华夏智胜价值成长股票 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	5.78%	0.73%	4.09%	0.75%	1.69%	-0.02%
过去三个月	7.56%	1.60%	0.97%	1.43%	6.59%	0.17%
过去六个月	13.77%	1.36%	3.21%	1.29%	10.56%	0.07%
过去一年	30.80%	1.64%	18.83%	1.64%	11.97%	0.00%
过去三年	23.31%	1.28%	-7.61%	1.29%	30.92%	-0.01%
自基金转型起至今	84.30%	1.28%	11.23%	1.23%	73.07%	0.05%

华夏智胜价值成长股票 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	5.76%	0.73%	4.09%	0.75%	1.67%	-0.02%
过去三个月	7.50%	1.60%	0.97%	1.43%	6.53%	0.17%
过去六个月	13.63%	1.36%	3.21%	1.29%	10.42%	0.07%
过去一年	30.47%	1.64%	18.83%	1.64%	11.64%	0.00%
过去三年	22.39%	1.28%	-7.61%	1.29%	30.00%	-0.01%
2019 年 12 月 24 日起至今	93.99%	1.30%	13.77%	1.23%	80.22%	0.07%

注：2018 年 3 月 6 日至 2018 年 12 月 25 日，2019 年 1 月 7 日至 2019 年 12 月 23 日期间，华夏智胜价值成长股票 C 类基金份额为零。

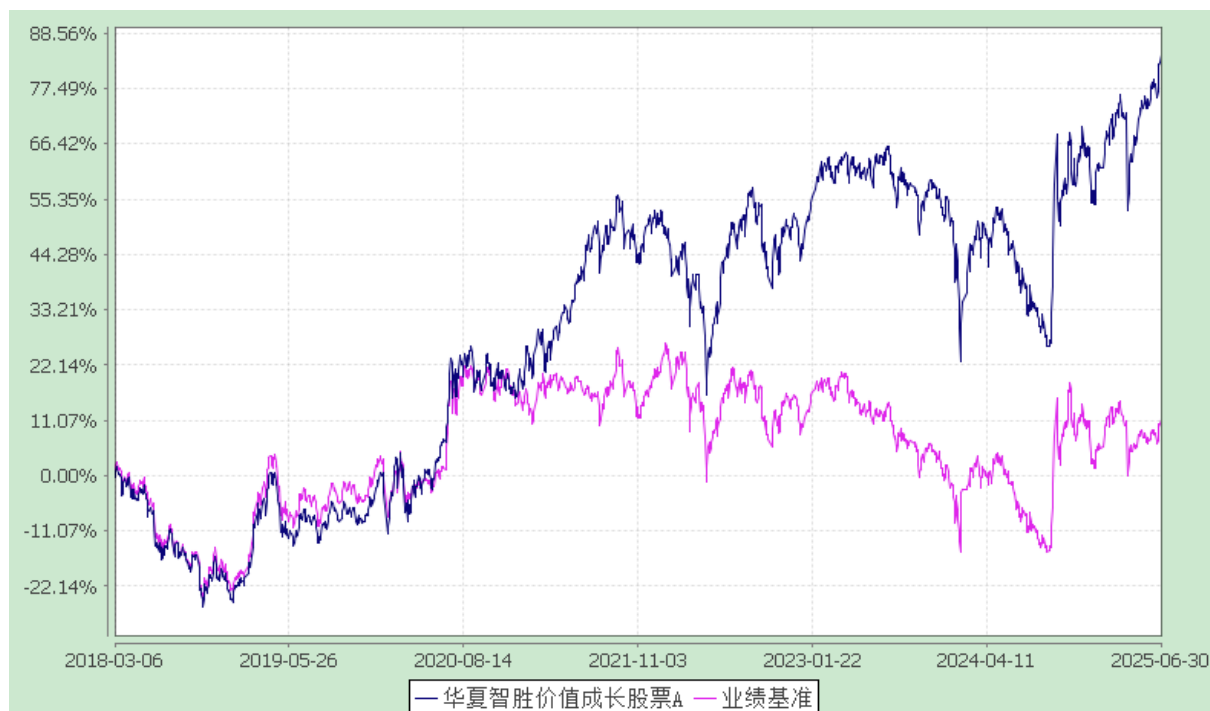
3.2.2 自基金转型以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华夏智胜价值成长股票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

(2018 年 3 月 6 日至 2025 年 6 月 30 日)

华夏智胜价值成长股票 A



注：本基金自 2018 年 3 月 6 日起由"华夏新锦源灵活配置混合型证券投资基金"转型而来。

华夏智胜价值成长股票 C



注：2018 年 3 月 6 日至 2018 年 12 月 25 日，2019 年 1 月 7 日至 2019 年 12 月 23 日期间，华夏智胜价值成长股票 C 类基金份额为零。

§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	2020-03-17	-	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	2023-03-28	-	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，本基金以多因子量化投资策略为主，我们在依据量化模型进行股票投资决策之外，还积极参与了科创板、创业板新股申购，获取较为确定性的收益增厚机会。同时，本基金秉承尽职尽责的态度，认真应对投资者日常申购、赎回等工作。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2025 年 6 月 30 日，华夏智胜价值成长股票 A 基金份额净值为 1.7794 元，本报告期份额净值增长率为 13.77%；华夏智胜价值成长股票 C 基金份额净值为 1.7552 元，本报告期份额净值增长率为 13.63%，同期业绩比较基准增长率为 3.21%。

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

本基金本报告期末进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明

托管人声明：

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

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

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

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

本中期报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§6 中期报告财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华夏智胜价值成长股票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	16,102,319.74	17,536,478.23
结算备付金		3,096,077.07	4,656,927.09
存出保证金		241,035.70	464,846.03
交易性金融资产	6.4.7.2	253,706,300.50	272,829,977.61
其中：股票投资		253,706,300.50	272,829,977.61
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	-	-
应收清算款		914,693.23	1,605,977.51
应收股利		-	-
应收申购款		963,526.85	263,831.92
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		275,023,953.09	297,358,038.39
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		816,121.40	2,514,937.42
应付赎回款		1,398,911.43	1,926,606.34
应付管理人报酬		212,443.04	264,515.86
应付托管费		42,488.60	52,903.16
应付销售服务费		17,833.75	21,709.63
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	577,549.95	464,668.81
负债合计		3,065,348.17	5,245,341.22
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	153,550,036.67	187,487,386.64
未分配利润	6.4.7.8	118,408,568.25	104,625,310.53
净资产合计		271,958,604.92	292,112,697.17
负债和净资产总计		275,023,953.09	297,358,038.39

注：报告截止日 2025 年 6 月 30 日，华夏智胜价值成长股票 A 基金份额净值 1.7794 元，华夏智胜价值成长股票 C 基金份额净值 1.7552 元；华夏智胜价值成长股票基金份额总额 153,550,036.67 份（其中 A 类 101,190,115.34 份，C 类 52,359,921.33 份）。

6.2 利润表

会计主体：华夏智胜价值成长股票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		34,556,315.28	-103,184,008.97
1.利息收入		34,458.20	127,401.79
其中：存款利息收入	6.4.7.9	34,458.20	127,401.79
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）		21,634,910.96	-96,073,345.66
其中：股票投资收益	6.4.7.10	18,836,229.85	-102,005,589.39
基金投资收益	6.4.7.11	-	-
债券投资收益	6.4.7.12	11,034.58	90,936.39
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	26,714.44	-540,784.40
股利收益	6.4.7.16	2,760,932.09	6,382,091.74
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	12,798,365.29	-7,639,222.64
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	88,580.83	401,157.54
减：二、营业总支出		1,734,271.22	4,678,571.18

1.管理人报酬		1,293,471.42	3,479,139.78
2.托管费		258,694.26	695,827.99
3.销售服务费		103,430.06	406,179.56
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		127.66	0.28
8.其他费用	6.4.7.21	78,547.82	97,423.57
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		32,822,044.06	-107,862,580.15
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		32,822,044.06	-107,862,580.15
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		32,822,044.06	-107,862,580.15

6.3 净资产变动表

会计主体：华夏智胜价值成长股票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	187,487,386.64	104,625,310.53	292,112,697.17
二、本期期初净资产	187,487,386.64	104,625,310.53	292,112,697.17
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-33,937,349.97	13,783,257.72	-20,154,092.25
（一）、综合收益总额	-	32,822,044.06	32,822,044.06
（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）	-33,937,349.97	-19,038,786.34	-52,976,136.31
其中：1.基金申购款	56,759,854.81	35,722,340.15	92,482,194.96
2.基金赎回款	-90,697,204.78	-54,761,126.49	-145,458,331.27
（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	153,550,036.67	118,408,568.25	271,958,604.92
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	728,069,364.71	359,984,945.98	1,088,054,310.69
二、本期期初净资产	728,069,364.71	359,984,945.98	1,088,054,310.69
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-375,504,064.73	-234,520,712.05	-610,024,776.78
（一）、综合收益总额	-	-107,862,580.15	-107,862,580.15
（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）	-375,504,064.73	-126,658,131.90	-502,162,196.63
其中：1.基金申购款	189,607,874.51	69,894,556.43	259,502,430.94
2.基金赎回款	-565,111,939.24	-196,552,688.33	-761,664,627.57
（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	352,565,299.98	125,464,233.93	478,029,533.91

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

根据原华夏新锦源灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“华夏新锦源混合”）基金份额持有人大会审议通过的《关于华夏新锦源灵活配置混合型证券投资基金转型为华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金有关事项的议案》以及相关法律法规的规定，并向中国证券监督管理委员会备案，华夏新锦源混合于 2018 年 3 月 6 日转型为华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）。本基金为契约型开放式，存续期限为不定期。本基金的基金管理人为华夏基金管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和本基金基金合同的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括创业板、存托凭证及其他中国证监会注册或核准上市的股票）、港股通标的股票、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、衍生品（包括股指期货、国债期货、期权等）、货币市场工具（含同业存单）、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

本基金可根据相关法律法规和《基金合同》的约定，参与融资业务。

本基金投资组合比例为：股票投资占基金资产的比例为 80%–95%，港股通标的股票投资占股票资产的比例为 0-50%，每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货、期权合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付

金、存出保证金、应收申购款等。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布和修订的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则(以下合称“企业会计准则”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会发布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》和中国证监会、中国基金业协会允许的如财务报表附注 6.4.4 所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

根据财税[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]103 号《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81 号《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]125 号《财政部、国家税务总局、证监会关于内地与香港基金互认有关税收政策的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《财政部、国家税务总局关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《财政部、国家税务总局关于金融机构同业往来等增值税

政策的补充通知》、财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2023]39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

（1）以发行基金方式募集资金不属于增值税征收范围，不征收增值税。

（2）资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。

（3）基金买卖股票、债券的差价收入免征增值税，暂不征收企业所得税。

（4）存款利息收入不征收增值税。

（5）国债、地方政府债利息收入，金融同业往来利息收入免征增值税。

（6）对基金取得的债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

（7）基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

（8）对基金在境内取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利收入时代扣代缴 20%的个人所得税，暂不征收企业所得税。基金在境内从上市公司分配取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，全额计入应纳税所得额，持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，减按 50%计入应纳税所得额，持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20%的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20%的税率代扣个人所得税。对香港市场投资者取得的股息、红利收入按照 10%的税率代扣所得税。

（9）基金在境内卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

（10）基金在境外证券交易所进行交易或取得的源自境外证券市场的收益，其涉及的税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行。

（11）本基金分别按实际缴纳的增值税额的 7%、3%、2%缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日
活期存款	16,102,319.74
等于：本金	16,100,770.86
加：应计利息	1,548.88
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	16,102,319.74

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		246,606,741.89	-	253,706,300.50	7,099,558.61
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		246,606,741.89	-	253,706,300.50	7,099,558.61

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	1,130,440.00	-	-	-
其中：股指期货	1,130,440.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	1,130,440.00	-	-	-

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
IC2507	中证 500 期货 IC2507 合约	1	1,173,480.00	43,040.00
合计	-	-	-	43,040.00
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	43,040.00
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 2025 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	154.82
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	501,572.42

其中：交易所市场	501,572.42
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	75,822.71
合计	577,549.95

6.4.7.7 实收基金

华夏智胜价值成长股票 A

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	账面金额
上年度末	128,949,223.77	128,949,223.77
本期申购	25,645,699.35	25,645,699.35
本期赎回（以“-”号填列）	-53,404,807.78	-53,404,807.78
本期末	101,190,115.34	101,190,115.34

华夏智胜价值成长股票 C

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	账面金额
上年度末	58,538,162.87	58,538,162.87
本期申购	31,114,155.46	31,114,155.46
本期赎回（以“-”号填列）	-37,292,397.00	-37,292,397.00
本期末	52,359,921.33	52,359,921.33

6.4.7.8 未分配利润

华夏智胜价值成长股票 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	62,775,174.92	9,962,489.83	72,737,664.75
本期期初	62,775,174.92	9,962,489.83	72,737,664.75
本期利润	13,290,342.16	8,557,721.23	21,848,063.39
本期基金份额交易产生的变动数	-13,256,206.11	-2,462,585.27	-15,718,791.38
其中：基金申购款	13,722,899.59	2,488,396.15	16,211,295.74
基金赎回款	-26,979,105.70	-4,950,981.42	-31,930,087.12
本期已分配利润	-	-	-
本期末	62,809,310.97	16,057,625.79	78,866,936.76

华夏智胜价值成长股票 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	27,426,359.81	4,461,285.97	31,887,645.78
本期期初	27,426,359.81	4,461,285.97	31,887,645.78
本期利润	6,733,336.61	4,240,644.06	10,973,980.67
本期基金份额交易产生的变动数	-2,815,868.01	-504,126.95	-3,319,994.96
其中：基金申购款	16,299,429.19	3,211,615.22	19,511,044.41
基金赎回款	-19,115,297.20	-3,715,742.17	-22,831,039.37
本期已分配利润	-	-	-
本期末	31,343,828.41	8,197,803.08	39,541,631.49

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	27,265.95
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	6,774.60
其他	417.65
合计	34,458.20

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	2,317,564,374.05
减：卖出股票成本总额	2,296,836,071.99
减：交易费用	1,892,072.21
买卖股票差价收入	18,836,229.85

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	141.28
债券投资收益——买卖债券（债转股及	10,893.30

债券到期兑付) 差价收入	
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	11,034.58

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	1,775,462.29
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,748,545.00
减：应计利息总额	16,021.61
减：交易费用	2.38
买卖债券差价收入	10,893.30

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	26,714.44

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	2,760,932.09
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	2,760,932.09

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	12,661,325.29
——股票投资	12,661,325.29
——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	137,040.00
——权证投资	-
——期货投资	137,040.00
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	12,798,365.29

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	88,580.83
合计	88,580.83

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	16,315.34
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	2,725.11
存托服务费	-
合计	78,547.82

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
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	基金托管人
中信证券股份有限公司（“中信证券”）	基金管理人的股东
上海华夏财富投资管理有限公司（“华夏财富”）	基金管理人的子公司
中信证券华南股份有限公司（“中信证券（华南）”）	基金管理人第一大股东的子公司
中信证券（山东）有限责任公司（“中信证券（山东）”）	基金管理人第一大股东的子公司
中信期货有限公司（“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	58,080.00	0.00%	9,092,164,523.78	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	成交金额	占当期债券成交总额的

		额的比例		比例
中信证券	-	-	653,533.88	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	871,927.83	100.00%	468,230.41	74.47%

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	1,293,471.42	3,479,139.78
其中：应支付销售机构的客户维护费	313,504.37	727,388.67
应支付基金管理人的净管理费	979,967.05	2,751,751.11

注：①支付基金管理人的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 1.00%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

②基金管理人报酬计算公式为：日基金管理人报酬＝前一日基金资产净值×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	258,694.26	695,827.99

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

单位：人民币元

获得 销售 服务 费的 各关 联方 名称	本期 2025年1月1日至2025年6月30日 当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华夏智胜价值成长股票 A	华夏智胜价值成长股票 C	合计
华夏 基金 管理 有限 公司	-	20,774.48	20,774.48
招商 银行	-	8,814.60	8,814.60
华夏 财富	-	2,591.53	2,591.53
中信 证券	-	1,369.07	1,369.07
中信 证券 (山	-	303.85	303.85

东)			
中信 证券 (华 南)	-	249.16	249.16
中信 期货	-	6.83	6.83
合计	-	34,109.52	34,109.52
获得 销售 服务 费的 各关 联方 名称	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华夏智胜价值成长股票 A	华夏智胜价值成长股票 C	合计
华夏 基金 管理 有限 公司	-	66,485.68	66,485.68
招商 银行	-	26,266.71	26,266.71
中信 证券	-	8,061.29	8,061.29
华夏 财富	-	4,276.78	4,276.78
中信 证券 (山 东)	-	564.62	564.62
中信 证券 (华 南)	-	192.77	192.77
中信 期货	-	57.96	57.96
合计	-	105,905.81	105,905.81

注：①支付基金销售机构的基金销售服务费按 C 类基金份额前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给基金管理人，再由基金管理人计算并支付给各基金销售

机构。

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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

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	
	华夏智胜价值成长股票A	华夏智胜价值成长股票C	华夏智胜价值成长股票A	华夏智胜价值成长股票C
期初持有的基金份额	10,608,423.83	-	10,608,423.83	-
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	10,608,423.83	-	10,608,423.83	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	10.48%	-	4.31%	-

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
招商银行活期存款	16,102,319.74	27,265.95	24,724,362.72	78,290.34

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

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 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	2,158	102,008.66
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

无。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配事项。

6.4.12 期末（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	216	10,210.32	26,818.56	-
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	钧崑电子	2025-01-02	6 个月	新发 流通 受限	10.40	34.11	701	7,290.40	23,911.11	-
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	-
301275	汉朔科技	2025-03-04	6 个月	新发 流通 受限	27.50	56.19	262	7,205.00	14,721.78	-
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	-
301501	恒鑫生活	2025-03-11	6 个月	新发流通受限	39.92	45.22	244	6,706.56	11,033.68	含证券送配
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	-
301636	泽润新能	2025-04-30	6 个月	新发流通受限	33.06	47.46	128	4,231.68	6,074.88	-
301595	太	2025-05-12	6 个月	新发	17.05	29.10	196	3,341.80	5,703.60	-

	力科技			流通受限						
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	-
603049	中策橡胶	2025-05-27	6 个月	新发流通受限	46.50	42.85	119	5,533.50	5,099.15	-
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	-
603014	威高血净	2025-05-12	6 个月	新发流通受限	26.50	32.68	136	3,604.00	4,444.48	-
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	-
603202	天有为	2025-04-16	6 个月	新发流通受限	93.50	90.66	41	3,833.50	3,717.06	-
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	2025-03-28	6 个月	新发流通	20.52	37.47	78	1,600.56	2,922.66	-

	瑞林			受限						
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	海阳科技	2025-06-05	6 个月	新发 流通 受限	11.50	22.39	105	1,207.50	2,350.95	-
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

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300225	金力泰	2025-05-06	重大事项	4.22	2025-07-03	4.01	30,100	112,473.00	127,022.00	-

300280	*ST 紫 天	2025-03 -17	重大事 项	2.50	2025-0 7-07	6.99	34,100	374,846.78	85,250.00	-
--------	------------	----------------	----------	------	----------------	------	--------	------------	-----------	---

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	253,706,300.50	93.29	272,829,977.61	93.40
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	253,706,300.50	93.29	272,829,977.61	93.40

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%	-15,747,814.81	-14,583,379.04
	+5%	15,747,814.81	14,583,379.04

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	253,128,273.29
第二层次	142,407.54
第三层次	435,619.67
合计	253,706,300.50

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	253,706,300.50	92.25
	其中：股票	253,706,300.50	92.25
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	19,198,396.81	6.98
8	其他各项资产	2,119,255.78	0.77
9	合计	275,023,953.09	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	573,131.00	0.21
B	采矿业	6,185,777.64	2.27
C	制造业	161,760,556.84	59.48
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,375,908.08	2.71
E	建筑业	1,169,374.00	0.43
F	批发和零售业	2,126,688.60	0.78
G	交通运输、仓储和邮政业	3,906,506.14	1.44
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	17,781,041.71	6.54
J	金融业	37,025,794.03	13.61
K	房地产业	3,136,276.00	1.15
L	租赁和商务服务业	2,813,331.00	1.03
M	科学研究和技术服务业	2,084,342.00	0.77
N	水利、环境和公共设施管理业	1,079,158.26	0.40
O	居民服务、修理和其他服务业	47,655.00	0.02
P	教育	138,475.00	0.05
Q	卫生和社会工作	1,941,600.00	0.71
R	文化、体育和娱乐业	4,314,439.20	1.59
S	综合	246,246.00	0.09
	合计	253,706,300.50	93.29

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	000776	广发证券	730,034	12,271,871.54	4.51
2	301286	侨源股份	209,100	5,225,409.00	1.92
3	000001	平安银行	421,400	5,086,298.00	1.87
4	000792	盐湖股份	276,900	4,729,452.00	1.74
5	301338	凯格精机	95,500	4,556,305.00	1.68

6	600900	长江电力	147,700	4,451,678.00	1.64
7	002555	三七互娱	252,900	4,372,641.00	1.61
8	001223	欧克科技	88,020	3,955,618.80	1.45
9	000623	吉林敖东	212,100	3,595,095.00	1.32
10	300476	胜宏科技	21,900	2,942,922.00	1.08
11	002595	豪迈科技	46,200	2,735,964.00	1.01
12	301369	联动科技	49,800	2,674,758.00	0.98
13	002926	华西证券	296,800	2,653,392.00	0.98
14	000893	亚钾国际	78,000	2,350,920.00	0.86
15	002701	奥瑞金	383,682	2,282,907.90	0.84
16	300990	同飞股份	45,243	2,257,625.70	0.83
17	000719	中原传媒	175,820	2,181,926.20	0.80
18	300666	江丰电子	27,500	2,037,750.00	0.75
19	002983	芯瑞达	86,500	1,832,935.00	0.67
20	301097	天益医疗	45,300	1,811,547.00	0.67
21	002230	科大讯飞	37,300	1,785,924.00	0.66
22	002978	安宁股份	55,700	1,759,006.00	0.65
23	601318	中国平安	31,400	1,742,072.00	0.64
24	301196	唯科科技	25,592	1,731,810.64	0.64
25	002597	金禾实业	71,100	1,674,405.00	0.62
26	301367	瑞迈特	19,100	1,606,310.00	0.59
27	000050	深天马 A	178,800	1,523,376.00	0.56
28	603858	步长制药	90,638	1,471,961.12	0.54
29	301459	丰茂股份	33,500	1,420,400.00	0.52
30	000726	鲁泰 A	215,900	1,368,806.00	0.50
31	603061	金海通	15,600	1,318,980.00	0.48
32	002847	盐津铺子	15,900	1,278,360.00	0.47
33	603868	飞科电器	34,200	1,226,754.00	0.45
34	600073	光明肉业	165,700	1,222,866.00	0.45
35	002545	东方铁塔	136,100	1,209,929.00	0.44
36	300648	星云股份	35,000	1,209,600.00	0.44
37	603324	盛剑科技	46,440	1,179,576.00	0.43
38	002466	天齐锂业	36,500	1,169,460.00	0.43
39	000651	格力电器	25,800	1,158,936.00	0.43
40	600909	华安证券	195,000	1,136,850.00	0.42
41	000408	藏格矿业	26,500	1,130,755.00	0.42
42	301239	普瑞眼科	28,500	1,117,200.00	0.41
43	301361	众智科技	36,000	1,099,080.00	0.40
44	301498	乖宝宠物	10,000	1,093,700.00	0.40
45	002371	北方华创	2,400	1,061,304.00	0.39
46	301217	铜冠铜箔	84,800	1,060,848.00	0.39
47	603195	公牛集团	21,600	1,042,200.00	0.38
48	601728	中国电信	131,700	1,020,675.00	0.38

49	002160	常铝股份	226,800	979,776.00	0.36
50	300030	阳普医疗	138,100	948,747.00	0.35
51	000553	安道麦 A	131,400	948,708.00	0.35
52	300662	科锐国际	31,500	935,865.00	0.34
53	001207	联科科技	38,100	934,974.00	0.34
54	600131	国网信通	52,700	932,790.00	0.34
55	601568	北元集团	221,000	917,150.00	0.34
56	688608	恒玄科技	2,600	904,748.00	0.33
57	000688	国城矿业	67,900	903,749.00	0.33
58	002739	万达电影	78,200	893,826.00	0.33
59	601688	华泰证券	50,100	892,281.00	0.33
60	601857	中国石油	103,900	888,345.00	0.33
61	301200	大族数控	20,900	887,623.00	0.33
62	301035	润丰股份	14,900	884,166.00	0.33
63	601988	中国银行	154,800	869,976.00	0.32
64	600808	马钢股份	250,100	862,845.00	0.32
65	000725	京东方 A	215,900	861,441.00	0.32
66	001238	浙江正特	21,900	858,480.00	0.32
67	600941	中国移动	7,600	855,380.00	0.31
68	000952	广济药业	134,700	832,446.00	0.31
69	600626	申达股份	229,000	831,270.00	0.31
70	002414	高德红外	80,700	827,175.00	0.30
71	002524	光正眼科	183,200	824,400.00	0.30
72	600925	苏能股份	153,580	803,223.40	0.30
73	000751	锌业股份	251,700	790,338.00	0.29
74	000089	深圳机场	113,900	785,910.00	0.29
75	605286	同力日升	19,800	784,476.00	0.29
76	300994	久祺股份	50,000	782,000.00	0.29
77	600382	广东明珠	142,700	777,715.00	0.29
78	300119	瑞普生物	40,000	776,800.00	0.29
79	603277	银都股份	48,545	776,720.00	0.29
80	600219	南山铝业	198,700	761,021.00	0.28
81	002402	和而泰	32,600	755,342.00	0.28
82	688231	隆达股份	41,700	752,685.00	0.28
83	002001	新和成	34,860	741,472.20	0.27
84	000166	申万宏源	147,700	741,454.00	0.27
85	000100	TCL 科技	170,800	739,564.00	0.27
86	601398	工商银行	97,100	736,989.00	0.27
87	688256	寒武纪	1,200	721,800.00	0.27
88	600012	皖通高速	42,300	718,254.00	0.26
89	301555	惠柏新材	26,000	715,780.00	0.26
90	603040	新坐标	17,600	706,992.00	0.26
91	301295	美硕科技	29,500	703,870.00	0.26

92	301059	金三江	61,300	697,594.00	0.26
93	688523	航天环宇	32,400	696,924.00	0.26
94	301090	华润材料	91,700	690,501.00	0.25
95	601658	邮储银行	123,000	672,810.00	0.25
96	000333	美的集团	9,100	657,020.00	0.24
97	000002	万科 A	101,500	651,630.00	0.24
98	300241	瑞丰光电	114,100	650,370.00	0.24
99	000960	锡业股份	42,300	647,190.00	0.24
100	000999	华润三九	20,400	638,112.00	0.23
101	600020	中原高速	133,236	636,868.08	0.23
102	600901	江苏金租	104,600	633,876.00	0.23
103	000988	华工科技	13,400	629,934.00	0.23
104	600517	国网英大	121,400	619,140.00	0.23
105	300289	利德曼	118,300	615,160.00	0.23
106	000563	陕国投 A	171,700	612,969.00	0.23
107	300308	中际旭创	4,180	609,694.80	0.22
108	301031	中熔电气	7,627	607,490.55	0.22
109	601939	建设银行	64,340	607,369.60	0.22
110	603313	梦百合	71,100	604,350.00	0.22
111	688509	正元地信	139,800	599,742.00	0.22
112	300502	新易盛	4,700	596,994.00	0.22
113	688659	元琛科技	67,500	589,275.00	0.22
114	688235	百济神州	2,500	584,100.00	0.21
115	603172	万丰股份	36,100	575,073.00	0.21
116	000720	新能泰山	164,300	573,407.00	0.21
117	601668	中国建筑	99,000	571,230.00	0.21
118	601003	柳钢股份	161,200	567,424.00	0.21
119	600299	安迪苏	58,800	567,420.00	0.21
120	601456	国联民生	54,700	566,145.00	0.21
121	000509	华塑控股	168,100	559,773.00	0.21
122	600795	国电电力	115,500	559,020.00	0.21
123	000630	铜陵有色	167,200	558,448.00	0.21
124	000338	潍柴动力	36,156	556,079.28	0.20
125	601096	宏盛华源	133,600	553,104.00	0.20
126	002500	山西证券	93,900	548,376.00	0.20
127	002544	普天科技	23,000	539,350.00	0.20
128	300978	东箭科技	48,100	536,796.00	0.20
129	688578	艾力斯	5,700	530,328.00	0.20
130	000878	云南铜业	41,400	526,608.00	0.19
131	601288	农业银行	88,400	519,792.00	0.19
132	002871	伟隆股份	46,200	514,206.00	0.19
133	002399	海普瑞	43,100	513,321.00	0.19
134	002638	勤上股份	195,000	512,850.00	0.19

135	603062	麦加芯彩	11,400	501,258.00	0.18
136	600640	国脉文化	41,100	498,132.00	0.18
137	000825	太钢不锈	138,500	497,215.00	0.18
138	002736	国信证券	43,000	495,360.00	0.18
139	301387	光大同创	12,400	482,360.00	0.18
140	688030	山石网科	30,135	481,858.65	0.18
141	301259	艾布鲁	9,800	479,024.00	0.18
142	300074	华平股份	98,000	478,240.00	0.18
143	300246	宝莱特	59,200	473,008.00	0.17
144	301356	天振股份	26,300	467,877.00	0.17
145	688015	交控科技	22,300	464,732.00	0.17
146	000783	长江证券	66,700	462,231.00	0.17
147	603515	欧普照明	25,600	460,544.00	0.17
148	601686	友发集团	80,700	458,376.00	0.17
149	601628	中国人寿	11,100	457,209.00	0.17
150	600956	新天绿能	59,000	455,480.00	0.17
151	001322	箭牌家居	53,900	455,455.00	0.17
152	300750	宁德时代	1,800	453,996.00	0.17
153	600704	物产中大	85,500	450,585.00	0.17
154	688055	龙腾光电	121,300	448,810.00	0.17
155	002069	獐子岛	115,400	447,752.00	0.16
156	300940	南极光	17,700	446,925.00	0.16
157	600061	国投资本	59,400	446,688.00	0.16
158	601609	金田股份	63,000	441,630.00	0.16
159	603050	科林电气	26,800	441,128.00	0.16
160	000789	万年青	79,900	436,254.00	0.16
161	300373	扬杰科技	8,400	435,960.00	0.16
162	301353	普莱得	17,210	435,757.20	0.16
163	002594	比亚迪	1,300	431,483.00	0.16
164	300627	华测导航	12,300	430,500.00	0.16
165	603529	爱玛科技	12,500	430,000.00	0.16
166	600488	津药药业	102,600	427,842.00	0.16
167	002080	中材科技	21,700	423,150.00	0.16
168	600519	贵州茅台	300	422,856.00	0.16
169	002102	能特科技	133,400	421,544.00	0.16
170	300525	博思软件	28,600	416,416.00	0.15
171	301080	百普赛斯	5,800	414,874.00	0.15
172	688981	中芯国际	4,700	414,399.00	0.15
173	000987	越秀资本	60,200	412,972.00	0.15
174	000933	神火股份	24,800	412,672.00	0.15
175	603022	新通联	37,300	412,538.00	0.15
176	002939	长城证券	49,200	412,296.00	0.15
177	600784	鲁银投资	64,200	410,880.00	0.15

178	000768	中航西飞	15,000	410,100.00	0.15
179	605499	东鹏饮料	1,300	408,265.00	0.15
180	300420	五洋自控	118,400	407,296.00	0.15
181	688334	西高院	23,600	405,448.00	0.15
182	688095	福昕软件	5,900	400,669.00	0.15
183	000060	中金岭南	87,400	400,292.00	0.15
184	000728	国元证券	50,100	395,289.00	0.15
185	600675	中华企业	135,600	390,528.00	0.14
186	601899	紫金矿业	20,000	390,000.00	0.14
187	600031	三一重工	21,700	389,515.00	0.14
188	600016	民生银行	81,800	388,550.00	0.14
189	301061	匠心家居	5,000	387,700.00	0.14
190	300101	振芯科技	17,100	386,973.00	0.14
191	601328	交通银行	48,100	384,800.00	0.14
192	301220	亚香股份	8,500	381,650.00	0.14
193	002694	顾地科技	78,000	381,420.00	0.14
194	601158	重庆水务	81,200	376,768.00	0.14
195	300098	高新兴	72,300	375,960.00	0.14
196	000921	海信家电	14,600	375,220.00	0.14
197	603985	恒润股份	23,100	359,898.00	0.13
198	301337	亚华电子	12,300	359,283.00	0.13
199	002032	苏泊尔	6,800	356,252.00	0.13
200	002203	海亮股份	34,500	356,040.00	0.13
201	000755	山西高速	73,000	355,510.00	0.13
202	300866	安克创新	3,100	352,160.00	0.13
203	600662	外服控股	68,700	351,057.00	0.13
204	600757	长江传媒	37,700	349,856.00	0.13
205	000429	粤高速 A	26,100	347,913.00	0.13
206	600665	天地源	103,800	347,730.00	0.13
207	688565	力源科技	37,500	346,875.00	0.13
208	603115	海星股份	23,800	343,434.00	0.13
209	002444	巨星科技	13,400	341,834.00	0.13
210	301328	维峰电子	8,100	341,415.00	0.13
211	605369	拱东医疗	17,940	340,680.60	0.13
212	002463	沪电股份	8,000	340,640.00	0.13
213	688329	艾隆科技	17,700	340,548.00	0.13
214	002956	西麦食品	14,300	335,621.00	0.12
215	300869	康泰医学	23,400	335,556.00	0.12
216	603075	热威股份	16,700	333,833.00	0.12
217	002021	中捷资源	142,800	329,868.00	0.12
218	003001	中岩大地	9,400	329,000.00	0.12
219	688387	信科移动	58,100	328,265.00	0.12
220	688098	申联生物	53,400	326,274.00	0.12

221	600615	丰华股份	29,200	325,872.00	0.12
222	688317	之江生物	18,000	324,360.00	0.12
223	301577	美信科技	5,500	323,565.00	0.12
224	600159	大龙地产	112,800	310,200.00	0.11
225	688172	燕东微	15,700	308,662.00	0.11
226	002380	科远智慧	12,600	308,070.00	0.11
227	600337	美克家居	138,700	306,527.00	0.11
228	001313	粤海饲料	39,500	304,150.00	0.11
229	600713	南京医药	59,800	302,588.00	0.11
230	600482	中国动力	13,100	302,217.00	0.11
231	002818	富森美	23,900	298,272.00	0.11
232	300442	润泽科技	5,900	292,227.00	0.11
233	600496	精工钢构	91,300	292,160.00	0.11
234	600874	创业环保	47,500	283,575.00	0.10
235	300006	莱美药业	75,000	281,250.00	0.10
236	603699	纽威股份	9,000	280,530.00	0.10
237	688538	和辉光电	119,700	280,098.00	0.10
238	002107	沃华医药	48,900	279,708.00	0.10
239	300150	世纪瑞尔	55,700	279,614.00	0.10
240	688428	诺诚健华	11,400	278,502.00	0.10
241	000935	四川双马	15,100	275,122.00	0.10
242	600983	惠而浦	26,400	274,032.00	0.10
243	300686	智动力	27,400	273,726.00	0.10
244	300512	中亚股份	31,800	272,844.00	0.10
245	300981	中红医疗	22,550	269,923.50	0.10
246	300879	大叶股份	6,800	267,104.00	0.10
247	688026	洁特生物	16,200	265,680.00	0.10
248	601319	中国人保	30,500	265,655.00	0.10
249	001331	胜通能源	26,720	261,321.60	0.10
250	002925	盈趣科技	14,500	260,710.00	0.10
251	600167	联美控股	45,900	257,958.00	0.09
252	000750	国海证券	62,200	256,264.00	0.09
253	603989	艾华集团	16,600	255,640.00	0.09
254	300492	华图山鼎	3,760	255,228.80	0.09
255	601928	凤凰传媒	22,800	254,676.00	0.09
256	301280	珠城科技	6,480	253,886.40	0.09
257	301289	国缆检测	5,200	253,760.00	0.09
258	688111	金山办公	900	252,045.00	0.09
259	002142	宁波银行	9,100	248,976.00	0.09
260	600861	北京人力	12,800	247,040.00	0.09
261	600620	天宸股份	45,100	246,246.00	0.09
262	601326	秦港股份	76,200	246,126.00	0.09
263	603893	瑞芯微	1,600	242,976.00	0.09

264	600716	凤凰股份	65,200	241,240.00	0.09
265	603312	西典新能	6,500	238,355.00	0.09
266	300140	节能环境	38,300	236,311.00	0.09
267	605507	国邦医药	11,900	235,263.00	0.09
268	000963	华东医药	5,800	234,088.00	0.09
269	301305	朗坤科技	12,900	231,555.00	0.09
270	300808	久量股份	7,700	228,305.00	0.08
271	603325	博隆技术	2,500	225,725.00	0.08
272	300206	理邦仪器	18,700	224,774.00	0.08
273	600728	佳都科技	41,100	223,995.00	0.08
274	300319	麦捷科技	20,800	223,392.00	0.08
275	300751	迈为股份	3,200	222,592.00	0.08
276	603969	银龙股份	30,300	222,099.00	0.08
277	300365	恒华科技	33,700	222,083.00	0.08
278	600035	楚天高速	51,800	219,632.00	0.08
279	688247	宣泰医药	21,200	218,996.00	0.08
280	600429	三元股份	48,000	216,480.00	0.08
281	301362	民爆光电	5,300	216,293.00	0.08
282	300447	全信股份	13,800	216,246.00	0.08
283	002263	大东南	52,300	215,999.00	0.08
284	600918	中泰证券	33,300	214,119.00	0.08
285	601601	中国太保	5,600	210,056.00	0.08
286	688208	道通科技	6,831	209,028.60	0.08
287	688004	博汇科技	10,500	208,950.00	0.08
288	002888	惠威科技	11,500	208,610.00	0.08
289	300883	龙利得	33,500	208,370.00	0.08
290	688469	芯联集成	43,500	207,495.00	0.08
291	001255	博菲电气	6,400	206,528.00	0.08
292	000906	浙商中拓	32,400	206,388.00	0.08
293	002637	赞宇科技	20,500	204,590.00	0.08
294	688616	西力科技	16,000	203,520.00	0.07
295	688088	虹软科技	4,189	202,119.25	0.07
296	301100	风光股份	11,500	200,330.00	0.07
297	688819	天能股份	7,200	199,872.00	0.07
298	300827	上能电气	6,500	198,575.00	0.07
299	300222	科大智能	19,300	196,667.00	0.07
300	003020	立方制药	8,800	196,416.00	0.07
301	601598	中国外运	39,800	196,214.00	0.07
302	600269	赣粤高速	38,676	195,700.56	0.07
303	002516	旷达科技	37,400	192,610.00	0.07
304	001359	平安电工	5,500	191,840.00	0.07
305	600538	国发股份	34,300	191,737.00	0.07
306	605376	博迁新材	5,000	191,650.00	0.07

307	301359	东南电子	9,200	189,428.00	0.07
308	000586	汇源通信	17,000	189,040.00	0.07
309	603379	三美股份	3,900	187,668.00	0.07
310	301395	仁信新材	13,900	187,511.00	0.07
311	688119	中钢洛耐	44,800	187,264.00	0.07
312	688371	菲沃泰	11,200	185,472.00	0.07
313	002236	大华股份	11,600	184,208.00	0.07
314	688677	海泰新光	4,700	183,347.00	0.07
315	002454	松芝股份	23,700	182,964.00	0.07
316	002675	东诚药业	12,600	181,314.00	0.07
317	688128	中国电研	7,400	181,300.00	0.07
318	603948	建业股份	7,600	181,260.00	0.07
319	300050	世纪鼎利	31,600	181,068.00	0.07
320	003031	中瓷电子	3,400	180,914.00	0.07
321	002578	闽发铝业	54,000	180,900.00	0.07
322	002807	江阴银行	38,000	180,500.00	0.07
323	002827	高争民爆	5,500	180,290.00	0.07
324	002014	永新股份	14,800	179,376.00	0.07
325	600594	益佰制药	46,500	179,025.00	0.07
326	002081	金螳螂	51,800	177,674.00	0.07
327	601999	出版传媒	25,300	176,847.00	0.07
328	301503	智迪科技	4,600	175,030.00	0.06
329	300232	洲明科技	24,100	174,484.00	0.06
330	600338	西藏珠峰	15,600	173,004.00	0.06
331	600377	宁沪高速	11,200	171,808.00	0.06
332	300768	迪普科技	10,000	171,500.00	0.06
333	688585	上纬新材	22,000	171,160.00	0.06
334	000686	东北证券	22,200	169,386.00	0.06
335	002027	分众传媒	22,900	167,170.00	0.06
336	600058	五矿发展	21,600	166,968.00	0.06
337	002905	金逸影视	17,800	165,184.00	0.06
338	600153	建发股份	15,900	164,883.00	0.06
339	000877	天山股份	35,200	163,328.00	0.06
340	601766	中国中车	23,000	161,920.00	0.06
341	301171	易点天下	6,000	160,380.00	0.06
342	002585	双星新材	29,300	159,978.00	0.06
343	002976	瑞玛精密	6,100	158,600.00	0.06
344	002686	亿利达	24,300	158,193.00	0.06
345	002895	川恒股份	6,900	155,664.00	0.06
346	601991	大唐发电	49,000	155,330.00	0.06
347	603601	再升科技	38,200	155,092.00	0.06
348	002970	锐明技术	3,100	153,140.00	0.06
349	301345	涛涛车业	1,400	151,340.00	0.06

350	603755	日辰股份	5,700	148,884.00	0.05
351	300777	中简科技	4,100	148,625.00	0.05
352	000009	中国宝安	16,300	144,744.00	0.05
353	001218	丽臣实业	7,900	144,175.00	0.05
354	002290	禾盛新材	4,600	143,750.00	0.05
355	002532	天山铝业	17,200	142,932.00	0.05
356	600383	金地集团	37,700	142,883.00	0.05
357	300407	凯发电气	13,500	142,695.00	0.05
358	688079	美迪凯	14,200	142,568.00	0.05
359	601168	西部矿业	8,500	141,355.00	0.05
360	600063	皖维高新	30,600	140,148.00	0.05
361	300239	东宝生物	23,500	139,355.00	0.05
362	603386	骏亚科技	11,000	139,150.00	0.05
363	000526	学大教育	2,900	138,475.00	0.05
364	002948	青岛银行	27,700	137,946.00	0.05
365	300017	网宿科技	12,800	137,216.00	0.05
366	601958	金钼股份	12,500	136,750.00	0.05
367	001366	播恩集团	11,100	135,531.00	0.05
368	600236	桂冠电力	21,600	135,432.00	0.05
369	001300	三柏硕	9,800	132,790.00	0.05
370	001212	中旗新材	3,000	129,840.00	0.05
371	002825	纳尔股份	13,000	129,740.00	0.05
372	601717	郑煤机	7,800	129,636.00	0.05
373	300054	鼎龙股份	4,500	129,060.00	0.05
374	600741	华域汽车	7,300	128,845.00	0.05
375	601211	国泰海通	6,700	128,372.00	0.05
376	000538	云南白药	2,300	128,317.00	0.05
377	300225	金力泰	30,100	127,022.00	0.05
378	301102	兆讯传媒	11,600	126,672.00	0.05
379	600685	中船防务	4,600	125,074.00	0.05
380	688021	奥福科技	8,100	123,849.00	0.05
381	600182	S 佳通	7,600	120,916.00	0.04
382	301580	爱迪特	2,900	120,147.00	0.04
383	002803	吉宏股份	8,400	119,784.00	0.04
384	002188	中天服务	21,500	119,540.00	0.04
385	600826	兰生股份	14,500	118,900.00	0.04
386	000812	陕西金叶	25,300	118,657.00	0.04
387	600998	九州通	22,500	115,650.00	0.04
388	002174	游族网络	9,500	115,235.00	0.04
389	300440	运达科技	11,000	114,950.00	0.04
390	688100	威胜信息	3,100	114,855.00	0.04
391	600305	恒顺醋业	14,700	113,631.00	0.04
392	300383	光环新网	7,900	112,970.00	0.04

393	605168	三人行	3,800	111,834.00	0.04
394	600582	天地科技	18,600	111,414.00	0.04
395	000786	北新建材	4,200	111,216.00	0.04
396	000019	深粮控股	16,600	110,556.00	0.04
397	601827	三峰环境	13,100	110,040.00	0.04
398	601369	陕鼓动力	12,200	106,994.00	0.04
399	601900	南方传媒	6,800	106,352.00	0.04
400	688217	睿昂基因	4,200	106,260.00	0.04
401	688685	迈信林	1,900	106,115.00	0.04
402	002296	辉煌科技	9,500	105,925.00	0.04
403	002209	达意隆	8,400	105,420.00	0.04
404	688209	英集芯	5,700	105,279.00	0.04
405	600050	中国联通	19,600	104,664.00	0.04
406	002314	南山控股	39,500	103,885.00	0.04
407	002436	兴森科技	7,800	103,272.00	0.04
408	300371	汇中股份	8,900	103,240.00	0.04
409	300496	中科创达	1,800	102,996.00	0.04
410	300893	松原安全	4,200	102,984.00	0.04
411	600143	金发科技	9,900	102,069.00	0.04
412	688563	航材股份	1,800	101,934.00	0.04
413	688432	有研硅	9,200	101,568.00	0.04
414	600507	方大特钢	23,300	101,122.00	0.04
415	300776	帝尔激光	1,900	101,099.00	0.04
416	688584	上海合晶	5,600	100,128.00	0.04
417	603876	鼎胜新材	11,000	99,990.00	0.04
418	002011	盾安环境	8,600	99,760.00	0.04
419	600966	博汇纸业	22,500	99,450.00	0.04
420	000685	中山公用	11,300	99,214.00	0.04
421	000690	宝新能源	21,800	99,190.00	0.04
422	002497	雅化集团	8,700	99,180.00	0.04
423	603636	南威软件	7,800	98,592.00	0.04
424	002004	华邦健康	23,600	98,412.00	0.04
425	601801	皖新传媒	14,400	98,352.00	0.04
426	002881	美格智能	2,100	97,440.00	0.04
427	600075	新疆天业	23,000	97,290.00	0.04
428	603665	康隆达	3,900	96,642.00	0.04
429	603678	火炬电子	2,500	95,075.00	0.03
430	603270	金帝股份	3,700	95,053.00	0.03
431	300762	上海瀚讯	4,200	95,046.00	0.03
432	600535	天士力	6,000	93,900.00	0.03
433	002817	黄山胶囊	12,700	93,726.00	0.03
434	603087	甘李药业	1,700	93,126.00	0.03
435	603808	歌力思	11,200	92,960.00	0.03

436	002947	恒铭达	2,800	92,932.00	0.03
437	688127	蓝特光学	3,600	92,556.00	0.03
438	301314	科瑞思	2,300	92,437.00	0.03
439	605500	森林包装	12,500	92,375.00	0.03
440	605259	绿田机械	4,700	92,167.00	0.03
441	002913	奥士康	3,100	91,171.00	0.03
442	601311	骆驼股份	9,900	89,397.00	0.03
443	601811	新华文轩	6,000	87,420.00	0.03
444	600928	西安银行	22,300	87,416.00	0.03
445	688183	生益电子	1,700	87,040.00	0.03
446	002591	恒大高新	14,100	86,010.00	0.03
447	300280	*ST 紫天	34,100	85,250.00	0.03
448	000598	兴蓉环境	11,600	83,636.00	0.03
449	000758	中色股份	16,500	82,995.00	0.03
450	688116	天奈科技	1,800	82,386.00	0.03
451	002839	张家港行	18,300	82,350.00	0.03
452	600850	电科数字	3,400	82,246.00	0.03
453	600064	南京高科	10,500	80,955.00	0.03
454	002332	仙琚制药	8,800	80,696.00	0.03
455	301327	华宝新能	1,540	79,094.40	0.03
456	688162	巨一科技	2,900	78,996.00	0.03
457	002624	完美世界	5,200	78,884.00	0.03
458	300850	新强联	2,200	78,804.00	0.03
459	688285	高铁电气	9,600	78,720.00	0.03
460	601200	上海环境	9,900	78,606.00	0.03
461	000650	仁和药业	14,500	78,590.00	0.03
462	002679	福建金森	8,100	77,355.00	0.03
463	301317	鑫磊股份	2,500	77,100.00	0.03
464	002540	亚太科技	13,200	76,956.00	0.03
465	600055	万东医疗	4,400	76,032.00	0.03
466	600866	星湖科技	10,900	75,319.00	0.03
467	300292	吴通控股	15,400	74,998.00	0.03
468	601860	紫金银行	24,900	74,700.00	0.03
469	600750	江中药业	3,400	74,222.00	0.03
470	603596	伯特利	1,400	73,766.00	0.03
471	688526	科前生物	4,700	73,226.00	0.03
472	688562	航天软件	3,900	73,086.00	0.03
473	000030	富奥股份	12,400	73,036.00	0.03
474	300661	圣邦股份	1,000	72,770.00	0.03
475	603073	彩蝶实业	4,300	72,455.00	0.03
476	003033	征和工业	1,700	72,063.00	0.03
477	603730	岱美股份	12,360	70,328.40	0.03
478	002346	柘中股份	5,100	69,360.00	0.03

479	301215	中汽股份	11,100	68,820.00	0.03
480	600885	宏发股份	3,080	68,714.80	0.03
481	300679	电连技术	1,500	68,070.00	0.03
482	300918	南山智尚	3,500	67,305.00	0.02
483	688718	唯赛勃	5,400	66,852.00	0.02
484	301127	武汉天源	3,900	66,651.00	0.02
485	603393	新天然气	2,300	66,585.00	0.02
486	001225	和泰机电	1,900	66,158.00	0.02
487	688261	东微半导	1,600	66,000.00	0.02
488	301236	软通动力	1,200	65,568.00	0.02
489	002060	广东建工	18,800	65,424.00	0.02
490	300393	中来股份	11,300	65,088.00	0.02
491	600867	通化东宝	7,800	63,960.00	0.02
492	001323	慕思股份	2,100	63,336.00	0.02
493	300160	秀强股份	11,100	62,382.00	0.02
494	002025	航天电器	1,200	61,692.00	0.02
495	000975	山金国际	3,200	60,608.00	0.02
496	605365	立达信	4,100	60,393.00	0.02
497	000034	神州数码	1,600	60,224.00	0.02
498	603987	康德莱	7,800	60,060.00	0.02
499	600682	南京新百	8,700	58,464.00	0.02
500	301207	华兰疫苗	3,400	57,324.00	0.02
501	003005	竞业达	2,800	56,588.00	0.02
502	688109	品茗科技	1,817	56,563.21	0.02
503	603170	宝立食品	4,500	56,115.00	0.02
504	600048	保利发展	6,900	55,890.00	0.02
505	603968	醋化股份	4,900	55,713.00	0.02
506	688027	国盾量子	200	55,002.00	0.02
507	002169	智光电气	8,500	54,995.00	0.02
508	600499	科达制造	5,600	54,880.00	0.02
509	600748	上实发展	17,500	54,075.00	0.02
510	603113	金能科技	7,800	54,054.00	0.02
511	001230	劲旅环境	2,600	53,222.00	0.02
512	300929	华骐环保	5,000	52,800.00	0.02
513	002295	精艺股份	5,900	50,032.00	0.02
514	600298	安琪酵母	1,400	49,238.00	0.02
515	001380	华纬科技	2,400	49,152.00	0.02
516	300196	长海股份	4,000	48,800.00	0.02
517	600288	大恒科技	4,700	48,316.00	0.02
518	600097	开创国际	4,600	48,024.00	0.02
519	003011	海象新材	2,600	47,762.00	0.02
520	300736	百邦科技	4,500	47,655.00	0.02
521	300812	易天股份	2,000	46,220.00	0.02

522	000411	英特集团	4,300	46,096.00	0.02
523	002381	双箭股份	6,700	45,225.00	0.02
524	301109	军信股份	3,000	44,640.00	0.02
525	600802	福建水泥	9,400	43,710.00	0.02
526	600563	法拉电子	400	43,636.00	0.02
527	000708	中信特钢	3,700	43,512.00	0.02
528	688146	中船特气	1,500	43,365.00	0.02
529	600734	实达集团	9,900	41,877.00	0.02
530	300702	天宇股份	1,800	41,868.00	0.02
531	002128	电投能源	2,100	41,538.00	0.02
532	002838	道恩股份	2,300	41,193.00	0.02
533	002373	千方科技	4,300	39,990.00	0.01
534	002645	华宏科技	4,300	39,044.00	0.01
535	600572	康恩贝	8,900	38,982.00	0.01
536	600295	鄂尔多斯	4,400	38,324.00	0.01
537	600771	广誉远	1,900	38,304.00	0.01
538	601963	重庆银行	3,500	38,010.00	0.01
539	603766	隆鑫通用	2,800	35,728.00	0.01
540	002493	荣盛石化	4,300	35,604.00	0.01
541	300665	飞鹿股份	4,200	35,112.00	0.01
542	000011	深物业 A	3,900	32,955.00	0.01
543	002065	东华软件	3,400	32,640.00	0.01
544	000900	现代投资	7,400	31,302.00	0.01
545	605080	浙江自然	1,100	30,580.00	0.01
546	002649	博彦科技	2,100	30,513.00	0.01
547	001306	夏厦精密	400	30,376.00	0.01
548	601702	华峰铝业	1,900	30,191.00	0.01
549	002228	合兴包装	8,400	29,652.00	0.01
550	002208	合肥城建	4,100	28,700.00	0.01
551	300615	欣天科技	2,100	28,077.00	0.01
552	300912	凯龙高科	1,900	27,911.00	0.01
553	600526	菲达环保	5,700	27,360.00	0.01
554	688775	影石创新	216	26,818.56	0.01
555	688545	兴福电子	994	26,788.30	0.01
556	000898	鞍钢股份	11,500	26,680.00	0.01
557	600028	中国石化	4,700	26,508.00	0.01
558	300643	万通智控	1,200	25,656.00	0.01
559	301358	湖南裕能	800	24,952.00	0.01
560	301210	金杨股份	600	24,924.00	0.01
561	603153	上海建科	1,400	24,682.00	0.01
562	000551	创元科技	1,900	24,415.00	0.01
563	688232	新点软件	800	24,032.00	0.01
564	301458	钧崴电子	701	23,911.11	0.01

565	002726	龙大美食	4,100	23,862.00	0.01
566	301106	骏成科技	800	23,840.00	0.01
567	603486	科沃斯	400	23,292.00	0.01
568	301087	可孚医疗	700	23,240.00	0.01
569	300910	瑞丰新材	400	23,100.00	0.01
570	603053	成都燃气	2,400	23,064.00	0.01
571	688001	华兴源创	900	22,743.00	0.01
572	300334	津膜科技	3,300	22,671.00	0.01
573	002850	科达利	200	22,634.00	0.01
574	300616	尚品宅配	1,700	22,389.00	0.01
575	603306	华懋科技	500	21,750.00	0.01
576	300977	深圳瑞捷	1,200	21,696.00	0.01
577	000831	中国稀土	600	21,672.00	0.01
578	600276	恒瑞医药	400	20,760.00	0.01
579	688636	智明达	600	20,274.00	0.01
580	000567	海德股份	3,254	19,263.68	0.01
581	301262	海看股份	700	18,452.00	0.01
582	688702	盛科通信	300	18,324.00	0.01
583	688505	复旦张江	2,100	18,186.00	0.01
584	688583	思看科技	227	18,087.36	0.01
585	002933	新兴装备	500	17,860.00	0.01
586	301332	德尔玛	1,700	17,408.00	0.01
587	301678	新恒汇	382	17,014.28	0.01
588	301233	盛帮股份	300	16,554.00	0.01
589	301602	超研股份	658	16,318.40	0.01
590	300034	钢研高纳	960	15,964.80	0.01
591	001388	信通电子	937	15,385.54	0.01
592	603279	景津装备	1,000	14,930.00	0.01
593	002997	瑞鹄模具	400	14,740.00	0.01
594	301275	汉朔科技	262	14,721.78	0.01
595	301479	弘景光电	182	14,172.34	0.01
596	301535	浙江华远	734	13,938.66	0.01
597	688757	胜科纳米	536	13,903.84	0.01
598	601868	中国能建	6,200	13,826.00	0.01
599	300394	天孚通信	168	13,413.12	0.00
600	300699	光威复材	400	12,668.00	0.00
601	300031	宝通科技	500	12,515.00	0.00
602	603072	天和磁材	226	12,305.70	0.00
603	600502	安徽建工	2,600	12,220.00	0.00
604	600739	辽宁成大	1,100	12,100.00	0.00
605	301662	宏工科技	143	11,797.50	0.00
606	603909	建发合诚	1,200	11,688.00	0.00
607	301601	惠通科技	342	11,576.70	0.00

608	301501	恒鑫生活	244	11,033.68	0.00
609	001216	华瓷股份	800	10,800.00	0.00
610	001356	富岭股份	709	10,237.96	0.00
611	301658	首航新能	437	10,042.26	0.00
612	301665	泰禾股份	393	8,799.27	0.00
613	603600	永艺股份	800	8,512.00	0.00
614	688755	汉邦科技	203	7,983.99	0.00
615	301173	毓恬冠佳	173	7,781.54	0.00
616	301006	迈拓股份	500	7,770.00	0.00
617	001382	新亚电缆	366	7,396.86	0.00
618	002950	奥美医疗	800	6,880.00	0.00
619	301636	泽润新能	128	6,074.88	0.00
620	301595	太力科技	196	5,703.60	0.00
621	002242	九阳股份	600	5,700.00	0.00
622	002999	天禾股份	800	5,584.00	0.00
623	603698	航天工程	300	5,286.00	0.00
624	301560	众捷汽车	190	5,215.50	0.00
625	603049	中策橡胶	119	5,099.15	0.00
626	300088	长信科技	800	4,768.00	0.00
627	603210	泰鸿万立	286	4,464.46	0.00
628	603014	威高血净	136	4,444.48	0.00
629	603271	永杰新材	126	4,420.08	0.00
630	603124	江南新材	88	4,075.28	0.00
631	001395	亚联机械	80	3,780.00	0.00
632	603202	天有为	41	3,717.06	0.00
633	603409	汇通控股	100	3,332.00	0.00
634	001390	古麒绒材	178	3,225.36	0.00
635	603257	中国瑞林	78	2,922.66	0.00
636	600663	陆家嘴	300	2,658.00	0.00
637	603400	华之杰	57	2,497.17	0.00
638	300231	银信科技	200	2,462.00	0.00
639	002696	百洋股份	400	2,428.00	0.00
640	603382	海阳科技	105	2,350.95	0.00
641	002368	太极股份	100	2,342.00	0.00
642	001335	信凯科技	80	2,244.00	0.00
643	603120	肯特催化	65	2,172.95	0.00
644	002017	东信和平	115	2,119.45	0.00
645	600161	天坛生物	108	2,072.52	0.00
646	301339	通行宝	120	2,055.60	0.00
647	603939	益丰药房	80	1,957.60	0.00
648	301519	舜禹股份	99	1,360.26	0.00
649	603871	嘉友国际	118	1,268.50	0.00
650	003019	宸展光电	35	1,226.05	0.00

651	603303	得邦照明	100	1,207.00	0.00
652	002911	佛燃能源	98	1,005.48	0.00
653	601225	陕西煤业	51	981.24	0.00
654	601128	常熟银行	133	980.21	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	000776	广发证券	40,899,063.00	14.00
2	601688	华泰证券	22,411,918.00	7.67
3	002001	新和成	16,265,935.40	5.57
4	600219	南山铝业	12,933,340.00	4.43
5	000963	华东医药	12,813,417.00	4.39
6	601939	建设银行	12,574,976.92	4.30
7	000166	申万宏源	12,472,431.65	4.27
8	601318	中国平安	12,320,209.00	4.22
9	002252	上海莱士	11,888,499.00	4.07
10	600926	杭州银行	11,722,505.00	4.01
11	000001	平安银行	11,149,871.00	3.82
12	601390	中国中铁	10,788,249.00	3.69
13	301359	东南电子	10,456,639.00	3.58
14	002595	豪迈科技	10,132,846.00	3.47
15	600958	东方证券	9,945,560.72	3.40
16	000792	盐湖股份	9,809,276.00	3.36
17	002352	顺丰控股	9,775,482.00	3.35
18	002230	科大讯飞	9,510,009.00	3.26
19	603379	三美股份	9,221,080.64	3.16
20	301233	盛帮股份	9,153,209.00	3.13
21	002371	北方华创	9,064,979.00	3.10
22	300777	中简科技	9,051,330.00	3.10
23	300408	三环集团	8,873,719.00	3.04
24	300976	达瑞电子	8,820,382.00	3.02
25	301196	唯科科技	8,813,170.28	3.02
26	300666	江丰电子	8,800,446.00	3.01
27	601006	大秦铁路	8,704,273.99	2.98
28	601989	中国重工	8,651,102.00	2.96
29	000630	铜陵有色	8,625,152.00	2.95
30	002736	国信证券	8,465,645.00	2.90
31	002019	亿帆医药	8,277,217.00	2.83
32	000538	云南白药	8,195,080.00	2.81
33	301369	联动科技	7,654,310.00	2.62
34	301498	乖宝宠物	7,644,911.00	2.62

35	301286	侨源股份	7,615,021.00	2.61
36	601186	中国铁建	7,577,936.00	2.59
37	002555	三七互娱	7,486,777.00	2.56
38	000623	吉林敖东	7,471,737.00	2.56
39	000725	京东方 A	7,439,783.00	2.55
40	002768	国恩股份	7,230,884.00	2.48
41	600999	招商证券	7,181,310.00	2.46
42	301262	海看股份	7,169,323.00	2.45
43	603979	金诚信	7,116,358.46	2.44
44	301107	瑜欣电子	6,493,968.00	2.22
45	000893	亚钾国际	6,447,448.00	2.21
46	001223	欧克科技	6,401,832.80	2.19
47	002970	锐明技术	6,383,926.00	2.19
48	300373	扬杰科技	6,339,894.00	2.17
49	600061	国投资本	6,198,069.00	2.12
50	601868	中国能建	6,105,335.00	2.09
51	601916	浙商银行	6,095,796.00	2.09
52	002597	金禾实业	6,068,550.00	2.08
53	000728	国元证券	5,991,908.00	2.05
54	301345	涛涛车业	5,973,201.00	2.04
55	301031	中熔电气	5,908,578.31	2.02
56	002028	思源电气	5,890,098.00	2.02
57	002803	吉宏股份	5,877,693.00	2.01
58	002997	瑞鹄模具	5,852,518.00	2.00

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	000776	广发证券	30,929,709.00	10.59
2	601688	华泰证券	27,334,594.02	9.36
3	002001	新和成	15,613,905.00	5.35
4	601318	中国平安	14,122,596.00	4.83
5	000963	华东医药	12,955,080.00	4.43
6	601939	建设银行	12,882,691.00	4.41
7	600219	南山铝业	12,623,745.10	4.32
8	000166	申万宏源	12,081,156.30	4.14
9	600926	杭州银行	12,044,518.16	4.12
10	002252	上海莱士	11,923,804.00	4.08
11	000630	铜陵有色	11,874,351.00	4.06
12	002352	顺丰控股	11,598,889.00	3.97
13	301107	瑜欣电子	11,576,365.00	3.96
14	301359	东南电子	11,451,279.20	3.92

15	002230	科大讯飞	11,407,376.84	3.91
16	301233	盛帮股份	10,973,307.00	3.76
17	601390	中国中铁	10,742,977.00	3.68
18	300976	达瑞电子	10,453,380.40	3.58
19	600958	东方证券	10,003,657.96	3.42
20	300408	三环集团	9,656,665.42	3.31
21	001332	锡装股份	9,369,695.80	3.21
22	603379	三美股份	9,224,787.00	3.16
23	000725	京东方 A	8,974,154.00	3.07
24	300777	中简科技	8,967,200.00	3.07
25	300811	铂科新材	8,965,604.15	3.07
26	002019	亿帆医药	8,928,160.00	3.06
27	601006	大秦铁路	8,718,646.08	2.98
28	601989	中国重工	8,554,097.00	2.93
29	000538	云南白药	8,518,063.60	2.92
30	002970	锐明技术	8,480,810.00	2.90
31	601916	浙商银行	8,467,103.00	2.90
32	601868	中国能建	8,353,655.00	2.86
33	002736	国信证券	8,351,140.00	2.86
34	002371	北方华创	8,333,427.00	2.85
35	301345	涛涛车业	8,166,451.00	2.80
36	002595	豪迈科技	8,049,425.00	2.76
37	300666	江丰电子	7,954,719.00	2.72
38	301498	乖宝宠物	7,920,472.00	2.71
39	600037	歌华有线	7,734,163.00	2.65
40	601186	中国铁建	7,598,180.00	2.60
41	002768	国恩股份	7,353,145.00	2.52
42	603979	金诚信	7,173,228.00	2.46
43	600999	招商证券	7,143,155.00	2.45
44	301262	海看股份	7,126,608.00	2.44
45	301196	唯科科技	7,119,235.00	2.44
46	000060	中金岭南	7,000,843.00	2.40
47	000792	盐湖股份	6,777,415.00	2.32
48	301165	锐捷网络	6,732,208.00	2.30
49	301061	匠心家居	6,720,412.52	2.30
50	002948	青岛银行	6,442,130.00	2.21
51	002028	思源电气	6,334,590.00	2.17
52	002881	美格智能	6,281,978.00	2.15
53	000001	平安银行	6,271,444.00	2.15
54	300373	扬杰科技	6,252,110.00	2.14
55	301327	华宝新能	6,192,917.00	2.12
56	000728	国元证券	6,050,017.00	2.07
57	002797	第一创业	6,022,174.00	2.06

58	002997	瑞鹄模具	5,910,880.00	2.02
59	600061	国投资本	5,904,206.00	2.02

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	2,265,051,069.59
卖出股票收入（成交）总额	2,317,564,374.05

注：“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末无国债期货投资。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货投资。

7.12 本报告期投资基金情况

7.12.1 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。

7.13 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，广发证券股份有限公司、平安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	241,035.70
2	应收清算款	914,693.23
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	963,526.85
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,119,255.78

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

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
华夏智胜价值成长股票	14,173	7,139.64	45,615,282.28	45.08%	55,574,833.06	54.92%

A						
华夏智胜价值成长股票 C	17,300	3,026.59	15,578,380.26	29.75%	36,781,541.07	70.25%
合计	31,473	4,878.79	61,193,662.54	39.85%	92,356,374.13	60.15%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	华夏智胜价值成长股票 A	527,718.08	0.52%
	华夏智胜价值成长股票 C	4,511.44	0.01%
	合计	532,229.52	0.35%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	华夏智胜价值成长股票 A	0~10
	华夏智胜价值成长股票 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	华夏智胜价值成长股票 A	0
	华夏智胜价值成长股票 C	0
	合计	0

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

截至 2021 年 3 月 6 日，华夏智胜价值成长股票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

项目	华夏智胜价值成长股票 A	华夏智胜价值成长股票 C
基金合同生效日（2018 年 3 月 6 日）基金份额总额	10,903,772.92	-
本报告期期初基金份额总额	128,949,223.77	58,538,162.87
本报告期基金总申购份额	25,645,699.35	31,114,155.46
减：本报告期基金总赎回份额	53,404,807.78	37,292,397.00
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	101,190,115.34	52,359,921.33

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，基金托管人无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期未发生影响基金管理人经营或基金运营业务的诉讼。

本报告期内，无涉及基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金所聘用的会计师事务所未发生改变。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人及其高级管理人员在本报告期内无受稽查或处罚等情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
招商证券	6	1,453,283,650.50	31.72%	139,360.36	31.72%	-
国金证券	2	1,094,334,363.66	23.89%	104,977.25	23.90%	-
中泰证券	1	921,574,509.64	20.12%	88,347.83	20.11%	-
西部证券	1	588,557,113.08	12.85%	56,457.72	12.85%	-
中信建投证券	3	523,328,088.29	11.42%	50,166.75	11.42%	-
中信证券	11	58,080.00	0.00%	-	-	-

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，本基金还选择了财通证券、长江证券、第一创业证券、东北证券、东吴证券、方正证券、光大证券、广发证券、国海证券、国联民生证券、国泰海通证券、国信证券、华泰证券、华西证券、江海证券、金元证券、联储证券、平安证券、上海证券、申万宏源证券、兴业证券、中金公司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在上述租用的券商交易单元中，国金证券的部分交易单元、国海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。

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
招商	-	-	-	-	-	-	-	-

证券								
国金 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰 证券	2,030,419.60	58.69%	-	-	-	-	-	-
西部 证券	29,921.50	0.86%	-	-	-	-	-	-
中信 建投 证券	1,399,148.00	40.44%	-	-	-	-	-	-
中信 证券	-	-	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华夏基金管理有限公司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
2	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
3	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025-05-10
4	华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金调整申购、定期定额申购及转换转入业务上限的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025-06-12

§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转型的文件；
- 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