

---

华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金

2025 年年度报告

2025 年 12 月 31 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

送出日期：二〇二六年三月三十一日

## §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。本年度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 2026 年 3 月 27 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。

本报告中的财务资料经审计，毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2025 年 1 月 1 日起至 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况.....	4
3.1 主要会计数据和财务指标 .....	4
3.2 基金净值表现.....	5
3.3 过去三年基金的利润分配情况 .....	8
§4 管理人报告 .....	8
§5 托管人报告 .....	13
§6 审计报告 .....	14
§7 年度财务报表 .....	16
7.1 资产负债表.....	16
7.2 利润表.....	17
7.3 净资产变动表.....	18
7.4 报表附注.....	19
§8 投资组合报告 .....	48
8.1 期末基金资产组合情况.....	49
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	49
8.3 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 .....	50
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	68
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	82
8.6 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 .....	82
8.7 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 .....	82
8.8 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 .....	82
8.9 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 .....	83
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	83
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	83
8.12 本报告期投资基金情况 .....	83
8.13 投资组合报告附注 .....	83
§9 基金份额持有人信息 .....	84
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	84
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	84
9.3 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 .....	84
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产 品情况 .....	85
9.5 发起式基金发起资金持有份额情况 .....	85
§10 开放式基金份额变动 .....	85
§11 重大事件揭示 .....	85
§12 影响投资者决策的其他重要信息 .....	90
§13 备查文件目录 .....	90

## §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	340,867,359.42 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	195,541,461.45 份	145,325,897.97 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
	联系电话	400-818-6666
	电子邮箱	service@ChinaAMC.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号院	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
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	邹迎光	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》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.ChinaAMC.com
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)	北京市东城区东长安街 1 号东方广场东 2 座办公楼 8 层
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、基金净值表现及利润分配情况

### 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	2025 年		2024 年		2023 年	
	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	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	60,811,191.42	54,923,530.05	-18,211,321.73	-39,720,840.96	-5,536,327.17	7,933,363.66
本期利润	75,859,062.93	60,340,793.92	-3,034,584.92	-52,465,548.91	-4,774,910.82	3,632,823.99
加权平均基金份额本期利润	0.5658	0.5961	-0.0134	-0.3292	-0.0228	0.0084
本期加权平均净值利润率	29.84%	30.87%	-0.95%	-23.58%	-1.49%	0.55%
本期基金份额净值增长率	39.98%	39.63%	4.02%	3.76%	6.43%	6.16%
3.1.2 期末数据和指标	2025 年末		2024 年末		2023 年末	
	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	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	192,017,733.45	138,388,195.85	62,775,174.92	27,426,359.81	133,698,344.44	208,940,111.44

供分配利润						
期末可供分配基金份额利润	0.9820	0.9523	0.4868	0.4685	0.4795	0.4651
期末基金资产净值	428,116,182.53	313,445,730.91	201,686,888.52	90,425,808.65	419,287,385.21	668,766,925.48
期末基金份额净值	2.1894	2.1568	1.5641	1.5447	1.5036	1.4887
3.1.3 累计期末指标	2025 年末		2024 年末		2023 年末	
	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	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	126.76%	138.37%	62.00%	70.72%	55.73%	64.53%

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
过去三个月	3.83%	0.98%	0.71%	1.18%	3.12%	-0.20%
过去六个月	23.04%	0.92%	24.81%	1.11%	-1.77%	-0.19%
过去一年	39.98%	1.15%	28.81%	1.20%	11.17%	-0.05%
过去三年	54.97%	1.26%	26.25%	1.30%	28.72%	-0.04%
过去五年	90.25%	1.22%	19.58%	1.22%	70.67%	0.00%
自基金转型起至今	126.76%	1.26%	38.82%	1.22%	87.94%	0.04%

##### 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	业绩比较基准收益	业绩比较基准收益	①—③	②—④
----	----------	----------	----------	----------	-----	-----

		准差②	率③	率标准差④		
过去三个月	3.76%	0.98%	0.71%	1.18%	3.05%	-0.20%
过去六个月	22.88%	0.92%	24.81%	1.11%	-1.93%	-0.19%
过去一年	39.63%	1.15%	28.81%	1.20%	10.82%	-0.05%
过去三年	53.80%	1.26%	26.25%	1.30%	27.55%	-0.04%
过去五年	87.91%	1.22%	19.58%	1.22%	68.33%	0.00%
2019 年 12 月 24 日起至今	138.37%	1.27%	42.00%	1.23%	96.37%	0.04%

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。

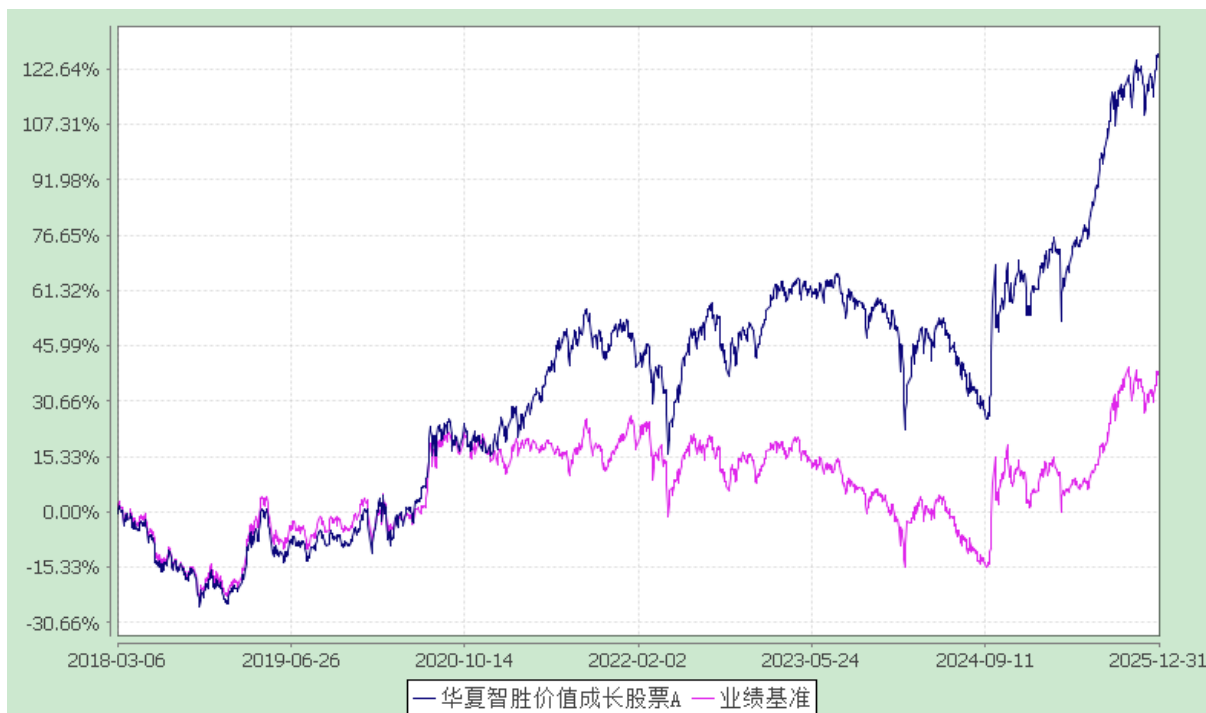
### 3.2.2 自基金转型以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

#### 华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金

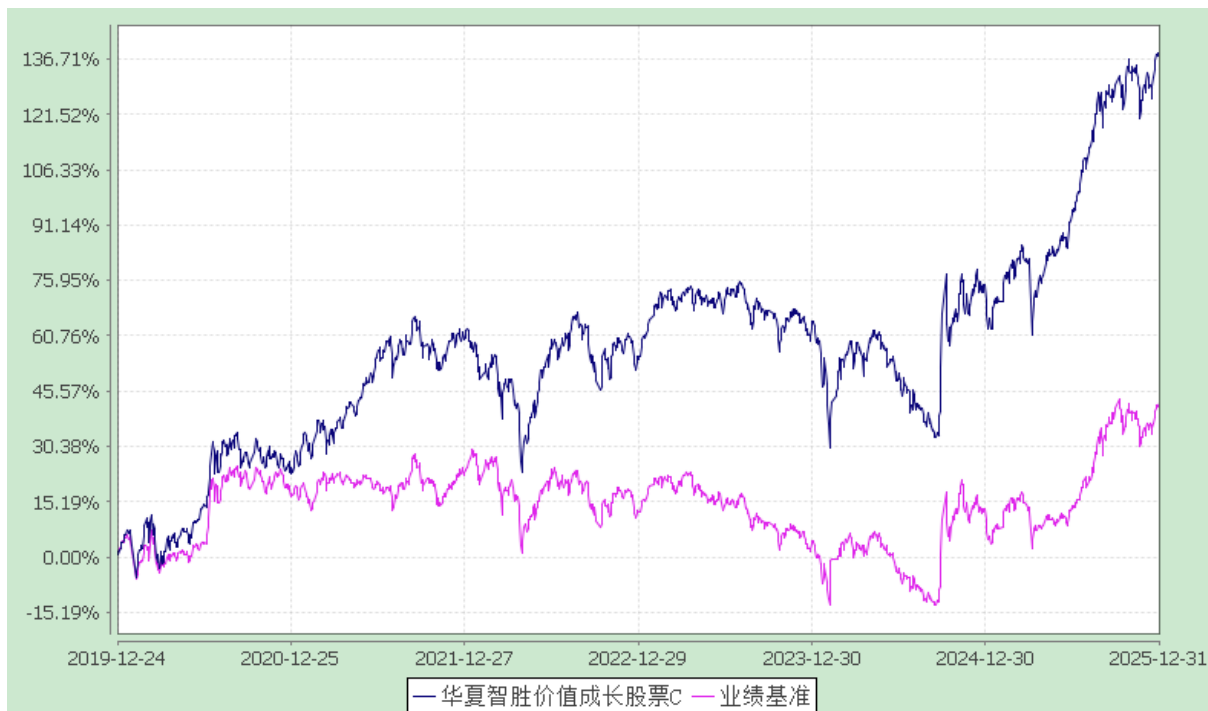
#### 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2018 年 3 月 6 日至 2025 年 12 月 31 日)

#### 华夏智胜价值成长股票 A



#### 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。

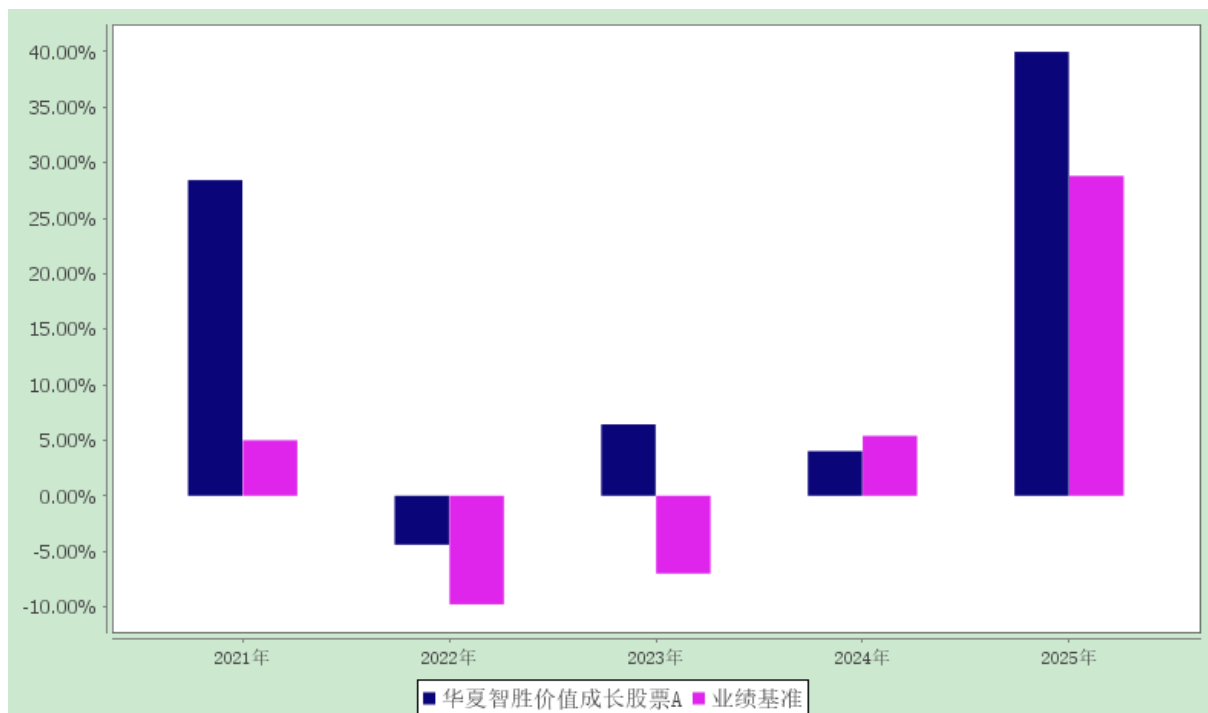
注：本基金自2018年3月6日起由“华夏新锦源灵活配置混合型证券投资基金”转型而来。

### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

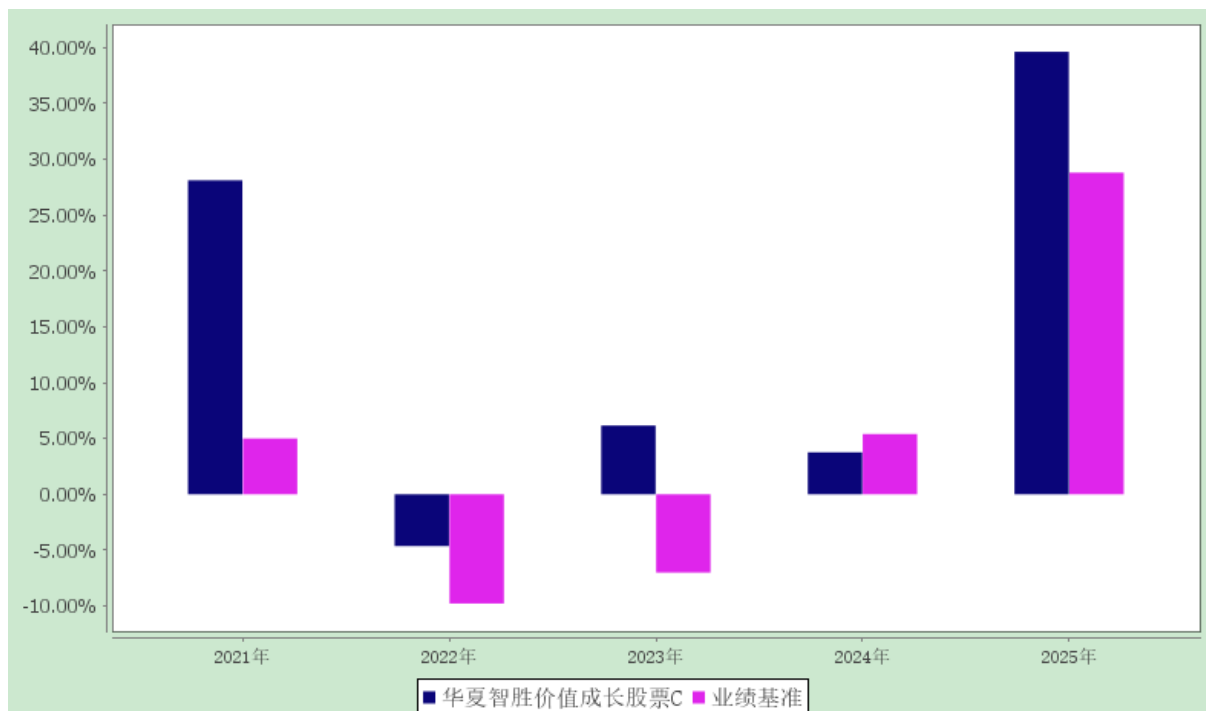
华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金

过去五年基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图

华夏智胜价值成长股票 A



### 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。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年无利润分配事项。

## §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。

华夏基金是境内权益 ETF 管理规模最大的基金管理公司之一，在指数基金管理方面积累了丰富的经验，形成了覆盖宽基、港股、行业主题、策略、跨境、商品等较为完整的指数产品线。

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 12 月 31 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 TMT 与信息技术行业偏股型基金(A 类)中华夏数字产业混合排名第 3/62；在混合型 FOF(权益资产 30%-60%)(A 类)中华夏聚源优选三个月持有混合（FOF）排名第 3/25；在养老目标日期 FOF(2050)(A 类)中华夏养老 2050 五年持有混合（FOF）排名第 4/16。

固收与固收+产品：在普通债券型基金(可投转债)(A 类)中华夏聚利债券排名第 2/273；在可转换债券型基金(A 类)中华夏可转债增强债券排名第 3/38；在普通偏债型基金(股票上限不高于 30%)(A 类)中华夏永康添福混合排名第 4/313；在短期纯债债券型基金(A 类)中华夏安益短债债券排名第 4/132；在债券型 FOF(A 类)中华夏聚顺优选六个月持有债券（FOF）排名第 5/17；在普通偏债型基金(股票上限不高于 30%)(A 类)中华夏永顺一年持有混合排名前 5%（第 14/313），华夏兴源稳健一年持有混合排名前 5%（第 15/313）。

在客户服务方面，2025 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、交易时间预估、交易场景密码验证功能给客户更方便直观安全的使用体验；（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，优化长辈模式下的业务办理功能，从客户投资需求出发，进一步提升操作体验；（3）与云湾基金、日照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“一些 ETF 小妙招送给大家”、“当你持有红利低波的时间越长，就越能感到它的可贵”“黄金的信仰比黄金贵”等活动，为客户提供了多样化的投资者教育和关怀服务。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
孙蒙	本基金的基金经理	2020-03-17	-	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。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

报告期内，孙蒙管理的 1 个私募资产管理计划已于 2025 年 12 月 29 日终止。

#### 4.1.4 基金经理薪酬机制

本基金管理人旗下基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的，基金经理个人薪酬激励与其管理的私募资产管理计划浮动管理费或产品业绩表现不直接挂钩，公司对其进行年度综合考核，考核结果作为确定其薪酬激励的重要参考因素之一。

#### 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 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规制定了《华夏基金管理有限公司公平交易制度》。公司通过科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时，通过监察稽核、事后分析和信息披露来保证公平交易过程和结果的监督。

##### 4.3.2 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。

#### 4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

本基金管理人一贯严格执行公平交易原则，对兼任基金经理的交易情况进行持续监测。本年度所有相关组合的交易行为均符合法规、制度和流程要求，未发现违反公平交易原则的情况。本年度同一基金经理管理的不同组合在邻近交易日的同向和反向交易，交易时机和交易价差均可合理解释，未发现异常。

本基金管理人根据《基金经理兼任私募资产管理计划投资经理工作指引（试行）》要求，针对同经理管理多个组合间的收益率差异进行归因分析，本年度各组合间收益率差异均属正常情况，主要原因为业绩基准不同、投资策略不同，收益率差异可以合理解释。

#### 4.3.3 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 137 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，全球经济面临复杂多变的外部环境，增长动能持续减弱，主要经济体表现分化，通胀走势与货币政策调整的不确定性上升，国际经贸秩序也持续受到扰动。国内方面，2025 年是“十四五”规划收官之年，国民经济顶住多重压力保持稳中有进发展态势，高质量发展取得新成效，中国经济在复杂多变的全球环境中展现出强劲的“向新而行”态势，不仅完成了“量的积累”，更实现了“质的飞跃”，凸显了其在压力与挑战面前强大的自我调适能力、突破困局的活力以及持久深厚的韧性。

市场方面，主题行情持续强势，行业间表现差异较大，其中有色金属、通信、电子等行业表现较好，而食品饮料、煤炭、美容护理等行业表现较差。市场风格方面，高 Beta、动量等量价类因子表现较好，而高盈利、低估值等基本面类因子表现较差，期间量化策略整体表现正常。

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 12 月 31 日，华夏智胜价值成长股票 A 基金份额净值为 2.1894 元，本报告期份额净值增长率为 39.98%；华夏智胜价值成长股票 C 基金份额净值为 2.1568 元，本报告期份额净值增

长率为 39.63%，同期业绩比较基准增长率为 28.81%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2026 年，全球宏观经济面临的风险与挑战依然突出，不确定性贯穿全年，全球范围内在货币和财政层面均采取宽松政策、AI 相关投资持续增加，在此背景下，预计全球经济将进入复苏动能开始启动的转换阶段。国内方面，宏观经济发展站上新起点，在复杂多变的全球环境中继续寻求稳增长与调结构的平衡，2025 年经济运行稳中有进为向好发展创造了有利条件，新质生产力的培育和改革红利效应持续显现，而且更加积极有为的宏观政策将为经济平稳运行保驾护航，中国经济长期向好的发展前景不可逆转。

市场方面，2025 年 A 股市场主题行情涨幅大且持续时间长，演绎比较充分，接下来将面临业绩的考验。展望 2026 年，市场将会更加关注经济复苏和公司的业绩增长，投资主线可能回归以盈利为核心的基本面，但存在较大不确定性，市场可能呈现板块轮动的特征，建议均衡配置。

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

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

在合规管理方面，公司通过合规审核、合规检查、合规咨询、合规宣传与合规培训等对合规风险进行管理，确保公司合规体系高效运行，合规风险有效控制。报告期内，公司持续推进制度体系建设，结合法律法规和业务实际，在保密管理、专兼职合规人员管理、投资管理人员职业道德与行为规范、洗钱风险管理等方面新增和修订多项管理制度，制度化水平显著提高。持续开展合规培训，在全员覆盖的基础上，着重加强投资研究和关键涉密岗位等重点人员的合规督导培训，强化员工主动合规意识和红线意识。持续优化合规管理的机制化和系统化，完善合规管理综合服务平台，提高合规管理效能。持续做好信息披露业务，通过流程优化、系统优化及强化培训持续保障信息披露的完整性、准确性、及时性。持续做好《推动公募基金高质量发展行动方案》及相关法规配套落实工作。公司高度重视洗钱风险管理，深入贯彻基于风险的原则，依法采取预防、管控措施，建立健全反洗钱内部控制制度，切实履行客户尽职调查、客户身份资料和交易记录保存、可疑交易报告、反洗钱特别预防措施等反洗钱义务，持续提升洗钱风险管理的有效性。

在风险控制方面，公司秉承数字化管理理念，持续升级优化内部风险管理系统、积极探索智能化业务应用，稳步夯实投资风险管理基础。紧密跟踪各项法律法规要求、加强风险研究，在严格管控基金日常投资运作风险的同时，持续完善风险管理制度建设，提升基金流动性风险、市场风险、合规风险、操作风险等关键风险的管控水平，努力保障各项风险管理措施落实到位。

在监察稽核方面，公司按照法规要求，做好日常合规监控，开展内部检查，排查业务风险隐患，促进公司整体业务合规运作、稳健经营。

报告期内，本基金管理人所管理的基金整体运作合法合规。本基金管理人将继续以风险控制为核心，坚持基金份额持有人利益优先的原则，提高监察稽核工作的科学性和有效性，切实保障基金合规稳健运作。

#### 4.7 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。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

#### 4.9 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

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遵规守信、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。

本年度报告中利润分配情况真实、准确。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本年度报告中财务指标、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 审计报告

毕马威华振审字第 2601049 号

华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金全体基金份额持有人：

### 6.1 审计意见

我们审计了后附的华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金（以下简称“该基金”）财务报表，包括 2025 年 12 月 31 日的资产负债表，2025 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。

我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则（以下简称“企业会计准则”）及财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制，公允反映了该基金 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及 2025 年度的经营成果和净资产变动情况。

### 6.2 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则（以下简称“审计准则”）的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则和《中国注册会计师独立性准则第 1 号——财务报表审计和审阅业务对独立性的要求》中适用于公众利益实体财务报表审计业务的独立性要求，我们独立于该基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

### 6.3 其他信息

该基金管理人华夏基金管理有限公司（以下简称“该基金管理人”）管理层对其他信息负责。其他信息包括该基金 2025 年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。

我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。

结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。

基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。

#### 6.4 管理层和治理层对财务报表的责任

该基金管理人管理层负责按照企业会计准则及财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时，该基金管理人管理层负责评估该基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非该基金预计在清算时资产无法按照公允价值处置。

该基金管理人治理层负责监督该基金的财务报告过程。

#### 6.5 注册会计师对财务报表审计的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

(3) 评价该基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

(4) 对该基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对该基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致该基金不能持续经营。

(5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

我们与该基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙） 中国注册会计师  
 王国蓓 管祎铭  
 北京市东城区东长安街 1 号东方广场东 2 座办公楼 8 层  
 2026 年 3 月 27 日

## §7 年度财务报表

### 7.1 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 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	7.4.7.1	55,540,146.68	17,536,478.23
结算备付金		7,606,062.61	4,656,927.09
存出保证金		577,730.83	464,846.03
交易性金融资产	7.4.7.2	692,983,951.22	272,829,977.61
其中：股票投资		692,913,769.42	272,829,977.61
基金投资		-	-
债券投资		70,181.80	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收清算款		2,581,944.24	1,605,977.51
应收股利		-	-
应收申购款		1,763,182.45	263,831.92
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		761,053,018.03	297,358,038.39
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2025 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2024 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			

短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		1,084,901.72	2,514,937.42
应付赎回款		16,737,619.25	1,926,606.34
应付管理人报酬		622,371.00	264,515.86
应付托管费		124,474.19	52,903.16
应付销售服务费		63,476.16	21,709.63
应付投资顾问费		-	-
应交税费		1,503.19	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	856,759.08	464,668.81
负债合计		19,491,104.59	5,245,341.22
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.7	340,867,359.42	187,487,386.64
未分配利润	7.4.7.8	400,694,554.02	104,625,310.53
净资产合计		741,561,913.44	292,112,697.17
负债和净资产总计		761,053,018.03	297,358,038.39

注：报告截止日 2025 年 12 月 31 日，华夏智胜价值成长股票 A 基金份额净值 2.1894 元，华夏智胜价值成长股票 C 基金份额净值 2.1568 元；华夏智胜价值成长股票基金份额总额 340,867,359.42 份（其中 A 类 195,541,461.45 份，C 类 145,325,897.97 份）。

## 7.2 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		142,222,333.72	-48,248,593.96
1.利息收入		122,230.11	213,238.70
其中：存款利息收入	7.4.7.9	122,230.11	213,238.70
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）		120,705,663.16	-51,441,785.44
其中：股票投资收益	7.4.7.10	114,291,358.11	-61,031,240.84
基金投资收益	7.4.7.11	-	-

债券投资收益	7.4.7.12	34,499.18	184,278.94
资产支持证券投资收益	7.4.7.13	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	580,366.81	-240,965.28
股利收益	7.4.7.16	5,799,439.06	9,646,141.74
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	20,465,135.38	2,432,028.86
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	929,305.07	547,923.92
<b>减：二、营业总支出</b>		6,022,476.87	7,251,539.87
1.管理人报酬		4,479,952.89	5,431,542.58
2.托管费		895,990.51	1,086,308.57
3.销售服务费		486,055.72	556,389.81
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	7.4.7.20	-	-
7.税金及附加		2,091.93	0.51
8.其他费用	7.4.7.21	158,385.82	177,298.40
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		136,199,856.85	-55,500,133.83
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		136,199,856.85	-55,500,133.83
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		136,199,856.85	-55,500,133.83

### 7.3 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 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）	153,379,972.78	296,069,243.49	449,449,216.27
（一）、综合收益总额	-	136,199,856.85	136,199,856.85
（二）、本期基金份额 交易产生的净资产变 动数（净资产减少以	153,379,972.78	159,869,386.64	313,249,359.42

“-”号填列)			
其中：1.基金申购款	542,721,347.92	523,906,072.57	1,066,627,420.49
2.基金赎回款	-389,341,375.14	-364,036,685.93	-753,378,061.07
(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	340,867,359.42	400,694,554.02	741,561,913.44
项目	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31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)	-540,581,978.07	-255,359,635.45	-795,941,613.52
(一)、综合收益总额	-	-55,500,133.83	-55,500,133.83
(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)	-540,581,978.07	-199,859,501.62	-740,441,479.69
其中：1.基金申购款	253,677,781.62	100,472,617.61	354,150,399.23
2.基金赎回款	-794,259,759.69	-300,332,119.23	-1,094,591,878.92
(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	187,487,386.64	104,625,310.53	292,112,697.17

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：邹迎光，主管会计工作负责人：朱威，会计机构负责人：朱威

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 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。

#### 7.4.2 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 7.4.4 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。

#### 7.4.3 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。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成

为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

### 1、金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

#### (1) 债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

##### 以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的商业模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

##### 以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益。基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资、资产支持证券投资 and 基金投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

#### (2) 权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

### 2、金融负债的分类

本基金的金融负债于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

### 3、衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，其公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益。

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益。

本基金对以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础，进行减值处理并确认损失准备。本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况。当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产。当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

1、存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

2、当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

3、如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。对于曾经实施份额拆分或折算的基金，由于基金份额拆分或折算引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日或基金份额折算日根据拆分前或折算前的基金份额数及确定的拆分或折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。对于已开放转换业务的基金，上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金

减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/（累计亏损）。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

境内基金投资在持有期间应取得的现金红利于除息日确认为投资收益；境外基金投资在持有期间应取得的基金分红收益扣除基金交易所在地适用的预缴所得税后的净额确认为投资收益。境内股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益；境外股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除股票交易所在地适用的预缴所得税后的净额确认为投资收益。境内债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。境外债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在交易所在地适用的预缴所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；处置时其公允价值与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的按直线法近似计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

针对基金合同约定费率和计算方法的费用，本基金在费用涵盖期间按合同约定进行确认。

其他以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的按直线法近似计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 20%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配。

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利

自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。

3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

4、由于基金费用的不同，不同类别的基金份额在收益分配数额方面可能有所不同，基金管理人可对各类别基金份额分别制定收益分配方案，同一类别的每一基金份额享有同等分配权。

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在不违反法律法规且对持有人利益无实质性不利影响的情况下，基金管理人、登记机构和基金托管人协商一致后，可对基金收益分配原则进行调整，不需召开基金份额持有人大会。

#### 7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，与所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

#### 7.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：（1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；（2）本基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；（3）本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个经营分部运作。

#### 7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

1、对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况参考《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》对重大影响基金资产净值的特殊事项停牌股票进行估值。

2、对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布<

证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》进行估值。

3、对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种,根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566号《关于发布<关于固定收益品种的估值处理标准>的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外),按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场交易的固定收益品种,按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

4、本基金作为境外投资者在各个国家和地区证券市场的投资所得的相关税负是基于其现行的税法法规。各个国家和地区的税收规定可能发生变化,或者实施具有追溯力的修订,从而导致本基金在正常的经营活动中,部分交易和事项的最终税务处理存在不确定性。在计提和处理税收费用时,本基金需要作出相关会计估计。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

##### 7.4.5.3 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。

#### 7.4.6 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》、财政部税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》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。2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。

(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。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
活期存款	55,540,146.68	17,536,478.23
等于：本金	55,535,217.01	17,534,535.39
加：应计利息	4,929.67	1,942.84
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	55,540,146.68	17,536,478.23

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	678,290,300.72	-	692,913,769.42	14,623,468.70	
贵金属投资- 金交所黄金 合约	-	-	-	-	
债券	交易所市 场	48,400.00	1.80	70,181.80	21,780.00
	银行 间市	-	-	-	-

	场				
	合计	48,400.00	1.80	70,181.80	21,780.00
资产支持证 券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		678,338,700.72	1.80	692,983,951.22	14,645,248.70
项目	上年度末 2024 年 12 月 31 日				
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		278,391,744.29	-	272,829,977.61	-5,561,766.68
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		278,391,744.29	-	272,829,977.61	-5,561,766.68

## 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

## 7.4.7.3.1 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 12 月 31 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	2,708,840.00	-	-	-
其中：股指期货	2,708,840.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	2,708,840.00	-	-	-
项目	上年度末 2024 年 12 月 31 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	2,364,160.00	-	-	-
其中：股指期货	2,364,160.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	2,364,160.00	-	-	-

7.4.7.3.2 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
IC2606	中证 500 期货 IC2606 合约	2	2,872,960.00	164,120.00
合计	-	-	-	164,120.00
减：可抵销期货暂 收款	-	-	-	164,120.00
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)之间抵销后的净额为 0。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

7.4.7.5 其他资产

无。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	42,915.61	1,063.43
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	660,943.47	298,605.38
其中：交易所市场	660,943.47	298,605.38
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	152,900.00	165,000.00

合计	856,759.08	464,668.81
----	------------	------------

#### 7.4.7.7 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12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	128,949,223.77	128,949,223.77
本期申购	231,362,899.59	231,362,899.59
本期赎回（以“-”号填列）	-164,770,661.91	-164,770,661.91
本期末	195,541,461.45	195,541,461.45

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12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	58,538,162.87	58,538,162.87
本期申购	311,358,448.33	311,358,448.33
本期赎回（以“-”号填列）	-224,570,713.23	-224,570,713.23
本期末	145,325,897.97	145,325,897.97

#### 7.4.7.8 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	60,811,191.42	15,047,871.51	75,859,062.93
本期基金份额交易产生的变动数	68,431,367.11	15,546,626.29	83,977,993.40
其中：基金申购款	189,906,718.29	41,411,562.48	231,318,280.77
基金赎回款	-121,475,351.18	-25,864,936.19	-147,340,287.37
本期已分配利润	-	-	-
本期末	192,017,733.45	40,556,987.63	232,574,721.08

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	54,923,530.05	5,417,263.87	60,340,793.92
本期基金份额交易产	56,038,305.99	19,853,087.25	75,891,393.24

生的变动数			
其中：基金申购款	238,403,417.29	54,184,374.51	292,587,791.80
基金赎回款	-182,365,111.30	-34,331,287.26	-216,696,398.56
本期已分配利润	-	-	-
本期末	138,388,195.85	29,731,637.09	168,119,832.94

#### 7.4.7.9 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12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日
活期存款利息收入	100,789.45	119,097.49
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	19,239.41	90,566.58
其他	2,201.25	3,574.63
合计	122,230.11	213,238.70

#### 7.4.7.10 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12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日
卖出股票成交总额	6,987,867,056.67	8,537,995,681.00
减：卖出股票成本总额	6,867,800,572.51	8,592,137,170.47
减：交易费用	5,775,126.05	6,889,751.37
买卖股票差价收入	114,291,358.11	-61,031,240.84

#### 7.4.7.11 基金投资收益

无。

#### 7.4.7.12 债券投资收益

##### 7.4.7.12.1 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12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日
债券投资收益——利息收入	4,882.22	3,480.27
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	29,616.96	180,798.67
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	34,499.18	184,278.94

## 7.4.7.12.2 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12月31 日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31 日
卖出债券（债转股及债券到期 兑付）成交总额	20,961,340.89	16,672,228.00
减：卖出债券（债转股及债券到 期兑付）成本总额	20,782,945.00	16,406,472.00
减：应计利息总额	148,773.90	84,898.79
减：交易费用	5.03	58.54
买卖债券差价收入	29,616.96	180,798.67

## 7.4.7.13 资产支持证券投资收益

无。

## 7.4.7.14 贵金属投资收益

无。

## 7.4.7.15 衍生工具收益

## 7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

## 7.4.7.15.2 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12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日
股指期货投资收益	580,366.81	-240,965.28

## 7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31 日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31 日
股票投资产生的股利收益	5,799,439.06	9,646,141.74
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	5,799,439.06	9,646,141.74

## 7.4.7.17 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12月31 日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31 日
1.交易性金融资产	20,207,015.38	2,276,268.86
——股票投资	20,185,235.38	2,291,587.36
——债券投资	21,780.00	-15,318.50
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	258,120.00	155,760.00
——权证投资	-	-
——期货投资	258,120.00	155,760.00
3.其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	20,465,135.38	2,432,028.86

#### 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日
基金赎回费收入	929,305.07	547,923.92
合计	929,305.07	547,923.92

#### 7.4.7.19 持有基金产生的费用

无。

#### 7.4.7.20 信用减值损失

无。

#### 7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31 日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31 日
审计费用	32,900.00	45,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行费用	5,485.82	12,296.38
存托服务费	-	2.02
合计	158,385.82	177,298.40

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无或有事项。

7.4.8.2 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。

7.4.9 关联方关系

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
天津海鹏科技咨询有限公司	基金管理人的股东
Qatar Holding LLC	基金管理人的股东
MACKENZIE FINANCIAL CORPORATION	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
华夏资本管理有限公司（“华夏资本”）	基金管理人的子公司
华夏股权投资基金管理（北京）有限公司	基金管理人的子公司
北京华夏金科信息服务有限公司	基金管理人的子公司
China Asset Management (Hong Kong) Limited（中文名称：华夏基金（香港）有限公司）	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：①根据华夏基金管理有限公司于 2025 年 7 月 11 日发布的公告，华夏基金管理有限公司股权结构变更为中信证券（出资比例 62.2%）、MACKENZIE FINANCIAL CORPORATION（出资比例 27.8%）、Qatar Holding LLC（出资比例 10%）。

②下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 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12月31日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31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%	9,111,506,300.57	55.65%

7.4.10.1.2 权证交易

无。

7.4.10.1.3 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12月31日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31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	-	-	1,154,883.88	3.64%

7.4.10.1.4 债券回购交易

无。

7.4.10.1.5 基金交易

无。

7.4.10.1.6 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12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总量的比例
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12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总量的比例
中信证券	873,784.24	55.65%	-	-

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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	4,479,952.89	5,431,542.58
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,400,464.34	1,146,091.75
应支付基金管理人的净管理费	3,079,488.55	4,285,450.83

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。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	895,990.51	1,086,308.57

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。

#### 7.4.10.2.3 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12月31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
招商银行	-	123,978.89	123,978.89
华夏基金管理有限公司	-	40,760.31	40,760.31
华夏财富	-	4,856.16	4,856.16
中信期货	-	4,556.92	4,556.92
中信证券	-	4,450.44	4,450.44
中信证券（华南）	-	1,703.76	1,703.76
中信证券（山东）	-	976.51	976.51
合计	-	181,282.99	181,282.99
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12月31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	-	80,920.38	80,920.38
招商银行	-	38,267.08	38,267.08
中信证券	-	10,364.05	10,364.05
华夏财富	-	7,906.66	7,906.66
中信证券（山东）	-	943.09	943.09
中信证券（华南）	-	458.61	458.61
中信期货	-	68.73	68.73
合计	-	138,928.60	138,928.60

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。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

#### 7.4.10.4 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

##### 7.4.10.4.1 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。

##### 7.4.10.4.2 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。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.5.1 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12月31日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31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	5.43%	-	8.23%	-

7.4.10.5.2 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。

7.4.10.6 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12月31日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31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	55,540,146.68	100,789.45	17,536,478.23	119,097.49

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。

7.4.10.7 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12月31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	600930	华电新能	新股发行	72,834	231,612.12
中信证券	688783	西安奕材	新股发行	22,611	194,906.82
中信证券	688795	摩尔线程	新股发行	1,499	171,305.72
中信证券	001280	中国铀业	新股发行	7,588	135,749.32
中信证券	688759	必贝特	新股发行	6,971	123,944.38
中信证券	688775	影石创新	新股发行	2,158	102,008.66
中信证券	688807	优迅股份	新股发行	1,303	67,312.98
中信证券	688583	思看科技	新股发行	1,742	58,287.32
中信证券	001285	瑞立科密	新股发行	1,361	57,543.08
中信证券	688755	汉邦科技	新股发行	2,023	46,063.71
中信证券	301687	新广益	新股发行	1,942	42,588.06
中信证券	301662	宏工科技	新股发行	1,429	38,011.40
中信证券	301584	建发致新	新股发行	4,465	31,478.25
中信证券	603257	中国瑞林	新股发行	780	16,005.60
中信证券	001396	誉帆科技	新股发行	688	15,335.52
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12月31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	688708	佳驰科技	新股发行	7,326	198,388.08
中信证券	688584	上海合晶	新股发行	8,659	196,212.94
中信证券	301613	新铝时代	新股发行	2,756	76,341.20
中信证券	001391	国货航	新股发行	25,258	58,093.40
中信证券	001359	平安电工	新股发行	1,833	31,875.87
中信证券	603091	众鑫股份	新股发行	940	24,910.00

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

##### 7.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配事项。

#### 7.4.12 期末（2025 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600930	华电新能	2025-07-09	6个月	新发流通受限	3.18	6.24	50,984	162,129.12	318,140.16	-
688795	摩尔线程	2025-11-26	6个月	新发流通受限	114.28	416.18	675	77,139.00	280,921.50	-
688783	西安奕材	2025-10-20	6个月	新发流通受限	8.62	18.36	10,175	87,708.50	186,813.00	-
688802	沐曦股份	2025-12-09	6个月	新发流通受限	104.66	399.31	434	45,422.44	173,300.54	-
688765	禾元生物	2025-10-16	6个月	新发流通受限	29.06	52.62	2,592	75,323.52	136,391.04	-
301656	联合动力	2025-09-17	6个月	新发流通受限	12.48	25.46	4,335	54,100.80	110,369.10	-

001280	中国 钨业	2025- 11-25	6个 月	新发 流通 受限	17.89	45.36	2,277	40,735.53	103,284.72	-
688759	必贝 特	2025- 10-21	6个 月	新发 流通 受限	17.78	25.11	2,789	49,588.42	70,031.79	-
688790	昂瑞 微	2025- 12-09	6个 月	新发 流通 受限	83.06	117.19	516	42,858.96	60,470.04	-
688809	强一 股份	2025- 12-23	6个 月	新发 流通 受限	85.09	203.31	236	20,081.24	47,981.16	-
301638	南网 数字	2025- 11-11	6个 月	新发 流通 受限	5.69	14.21	2,322	13,212.18	32,995.62	-
001386	马可 波罗	2025- 10-15	6个 月	新发 流通 受限	13.75	18.53	1,626	22,357.50	30,129.78	-
688729	屹唐 股份	2025- 07-01	6个 月	新发 流通 受限	8.45	24.28	1,240	10,478.00	30,107.20	-
688727	恒坤 新材	2025- 11-11	6个 月	新发 流通 受限	14.99	34.87	563	8,439.37	19,631.81	-
001233	海安 集团	2025- 11-18	6个 月	新发 流通 受限	48.00	51.88	370	17,760.00	19,195.60	-
688796	百奥 赛图	2025- 12-02	6个 月	新发 流通 受限	26.68	42.25	423	11,285.64	17,871.75	-
688807	优迅 股份	2025- 12-10	6个 月	新发 流通 受限	51.66	135.56	131	6,767.46	17,758.36	-
301632	广东 建科	2025- 08-05	6个 月	新发 流通 受限	6.56	23.68	656	4,303.36	15,534.08	-
301563	云汉 芯城	2025- 09-23	6个 月	新发 流通 受限	27.00	133.69	110	2,970.00	14,705.90	-
301491	汉桑 科技	2025- 07-29	6个 月	新发 流通 受限	28.91	55.11	245	7,082.95	13,501.95	-
301584	建发 致新	2025- 09-18	6个 月	新发 流通 受限	7.05	26.82	447	3,151.35	11,988.54	-

001369	双欣环保	2025-12-23	6个月	新发流通受限	6.85	12.89	897	6,144.45	11,562.33	-
301609	山大电力	2025-07-16	6个月	新发流通受限	14.66	40.99	277	4,060.82	11,354.23	-
301687	新广益	2025-12-24	6个月	新发流通受限	21.93	54.39	195	4,276.35	10,606.05	-
001221	悍高集团	2025-07-23	6个月	新发流通受限	15.43	56.94	160	2,468.80	9,110.40	-
301667	纳百川	2025-12-10	6个月	新发流通受限	22.63	57.07	151	3,417.13	8,617.57	-
688805	健信超导	2025-12-17	6个月	新发流通受限	18.58	32.37	265	4,923.70	8,578.05	-
603418	友升股份	2025-09-16	6个月	新发流通受限	46.36	59.06	139	6,444.04	8,209.34	-
603175	超颖电子	2025-10-17	6个月	新发流通受限	17.08	48.56	169	2,886.52	8,206.64	-
603092	德力佳	2025-10-30	6个月	新发流通受限	46.68	55.66	146	6,815.28	8,126.36	-
001285	瑞立科密	2025-09-23	6个月	新发流通受限	42.28	56.08	137	5,792.36	7,682.96	-
301668	昊创瑞通	2025-09-15	6个月	新发流通受限	21.00	44.80	165	3,465.00	7,392.00	-
301449	天溯计量	2025-12-16	6个月	新发流通受限	36.80	65.23	112	4,121.60	7,305.76	-
601026	道生天合	2025-10-09	6个月	新发流通受限	5.98	14.28	451	2,696.98	6,440.28	-
301575	艾芬达	2025-09-03	6个月	新发流通受限	27.69	49.55	126	3,488.94	6,243.30	-
603406	天富龙	2025-07-30	6个月	新发流通受限	23.60	40.16	129	3,044.40	5,180.64	-

603262	技源集团	2025-07-16	6个月	新发流通受限	10.88	28.10	155	1,686.40	4,355.50	-
603248	锡华科技	2025-12-16	6个月	新发流通受限	10.10	16.30	260	2,626.00	4,238.00	-
001388	信通电子	2025-06-24	6个月	新发流通受限	16.42	42.94	94	1,543.48	4,036.36	-
603370	华新精科	2025-08-27	6个月	新发流通受限	18.60	46.35	82	1,525.20	3,800.70	-
603376	大明电子	2025-10-28	6个月	新发流通受限	12.55	26.21	111	1,393.05	2,909.31	-
603334	丰倍生物	2025-10-29	6个月	新发流通受限	24.49	32.82	88	2,155.12	2,888.16	-
001396	誉帆科技	2025-12-23	6个月	新发流通受限	22.29	35.39	69	1,538.01	2,441.91	-

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。

#### 7.4.12.2 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(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688012	中微公司	2025-12-19	重大事项	283.75	2026-01-05	278.00	7,200	1,960,358.91	2,043,000.00	-

### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 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之内。

#### 7.4.13.2 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。

#### 7.4.13.3 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“7.4.12 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。

#### 7.4.13.3.1 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。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 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。

##### 7.4.13.4.2 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。

##### 7.4.13.4.3 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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 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	692,913,769.42	93.44	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	70,181.80	0.01	-	-
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	692,983,951.22	93.45	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。

7.4.13.4.3.2 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 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
	-5%	-33,710,014.09	-14,583,379.04
	+5%	33,710,014.09	14,583,379.04

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 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 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日

第一层次	689,084,578.09	272,366,378.59
第二层次	2,043,000.00	27,736.50
第三层次	1,856,373.13	435,862.52
合计	692,983,951.22	272,829,977.61

#### 7.4.14.2.2 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）和非公开发行等导致流通受限的情况，本基金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所属层次。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。

#### 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

##### 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	435,862.52	435,862.52
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	989,008.50	989,008.50
转出第三层次	-	948,356.69	948,356.69
当期利得或损失总额	-	1,379,858.80	1,379,858.80
其中：计入损益的利得或损失	-	1,379,858.80	1,379,858.80
计入其他综合收益的利得或损失（若有）	-	-	-
期末余额	-	1,856,373.13	1,856,373.13
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	1,018,507.64	1,018,507.64
项目	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	1,049,153.50	1,049,153.50
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-

转入第三层次	-	1,060,674.75	1,060,674.75
转出第三层次	-	1,926,033.37	1,926,033.37
当期利得或损失总额	-	252,067.64	252,067.64
其中：计入损益的利得或损失	-	252,067.64	252,067.64
计入其他综合收益的利得或损失（若有）	-	-	-
期末余额	-	435,862.52	435,862.52
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	242,967.49	242,967.49

## 7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	1,856,373.13	平均价格亚式期权模型	预期年化波动率	0.1628-3.0791	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	435,862.52	平均价格亚式期权模型	预期年化波动率	0.3423-5.7444	负相关

## 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

截至 2025 年 12 月 31 日止，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

## 7.4.14.4 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。

## 7.4.15 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。

## §8 投资组合报告

## 8.1 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	692,913,769.42	91.05
	其中：股票	692,913,769.42	91.05
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	70,181.80	0.01
	其中：债券	70,181.80	0.01
	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	63,146,209.29	8.30
8	其他各项资产	4,922,857.52	0.65
9	合计	761,053,018.03	100.00

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

## 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	2,859,188.00	0.39
B	采矿业	21,926,055.24	2.96
C	制造业	481,928,201.44	64.99
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	11,165,781.12	1.51
E	建筑业	9,950,057.00	1.34
F	批发和零售业	10,588,550.12	1.43
G	交通运输、仓储和邮政业	7,763,892.10	1.05
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	41,391,911.33	5.58
J	金融业	74,516,524.29	10.05
K	房地产业	3,504,749.00	0.47
L	租赁和商务服务业	8,059,813.00	1.09
M	科学研究和技术服务业	9,953,471.20	1.34
N	水利、环境和公共设施管理业	4,347,881.58	0.59
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	2,483,146.00	0.33
Q	卫生和社会工作	1,208,396.00	0.16
R	文化、体育和娱乐业	958,684.00	0.13

S	综合	307,468.00	0.04
	合计	692,913,769.42	93.44

## 8.3 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	301603	乔锋智能	131,600	9,962,120.00	1.34
2	301283	聚胶股份	185,500	8,863,190.00	1.20
3	600941	中国移动	83,500	8,437,675.00	1.14
4	002311	海大集团	148,200	8,207,316.00	1.11
5	603379	三美股份	126,100	7,656,792.00	1.03
6	000776	广发证券	341,700	7,524,234.00	1.01
7	300681	英搏尔	292,530	7,330,801.80	0.99
8	600999	招商证券	405,000	6,739,200.00	0.91
9	601336	新华保险	93,900	6,544,830.00	0.88
10	300428	立中集团	275,600	6,435,260.00	0.87
11	600378	昊华科技	188,800	6,034,048.00	0.81
12	300999	金龙鱼	199,500	5,733,630.00	0.77
13	002736	国信证券	403,800	5,297,856.00	0.71
14	300458	全志科技	124,000	5,211,720.00	0.70
15	000933	神火股份	167,600	4,603,972.00	0.62
16	601628	中国人寿	100,300	4,563,650.00	0.62
17	000166	申万宏源	825,507	4,350,421.89	0.59
18	603444	吉比特	10,200	4,323,270.00	0.58
19	300743	天地数码	190,900	4,260,888.00	0.57
20	002414	高德红外	283,500	4,158,945.00	0.56
21	301219	腾远钴业	58,300	3,980,724.00	0.54
22	000898	鞍钢股份	1,565,700	3,961,221.00	0.53
23	301589	诺瓦星云	23,545	3,874,329.75	0.52
24	301528	多浦乐	55,000	3,740,000.00	0.50
25	300953	震裕科技	22,000	3,696,440.00	0.50
26	002043	兔宝宝	252,000	3,631,320.00	0.49
27	601108	财通证券	408,400	3,561,248.00	0.48
28	002517	恺英网络	157,302	3,440,194.74	0.46
29	002380	科远智慧	125,200	3,405,440.00	0.46
30	300573	兴齐眼药	48,200	3,387,978.00	0.46
31	300073	当升科技	57,500	3,323,500.00	0.45
32	300363	博腾股份	142,500	3,311,700.00	0.45
33	002850	科达利	20,900	3,299,274.00	0.44
34	000612	焦作万方	297,900	3,282,858.00	0.44
35	601668	中国建筑	581,000	2,980,530.00	0.40
36	301035	润丰股份	43,600	2,965,236.00	0.40

37	603979	金诚信	38,000	2,893,700.00	0.39
38	300850	新强联	69,900	2,891,763.00	0.39
39	301345	涛涛车业	11,500	2,890,180.00	0.39
40	601899	紫金矿业	83,400	2,874,798.00	0.39
41	002236	大华股份	149,200	2,825,848.00	0.38
42	000408	藏格矿业	33,400	2,818,960.00	0.38
43	300373	扬杰科技	41,400	2,815,200.00	0.38
44	603950	长源东谷	97,100	2,811,045.00	0.38
45	002142	宁波银行	98,800	2,775,292.00	0.37
46	601857	中国石油	265,100	2,759,691.00	0.37
47	000778	新兴铸管	644,700	2,694,846.00	0.36
48	603815	交建股份	358,900	2,670,216.00	0.36
49	002111	威海广泰	251,800	2,648,936.00	0.36
50	301608	博实结	28,600	2,589,444.00	0.35
51	601318	中国平安	37,800	2,585,520.00	0.35
52	601881	中国银河	164,400	2,584,368.00	0.35
53	000708	中信特钢	156,200	2,556,994.00	0.34
54	000030	富奥股份	444,500	2,551,430.00	0.34
55	600938	中国海油	81,900	2,471,742.00	0.33
56	000783	长江证券	298,300	2,431,145.00	0.33
57	605056	咸亨国际	146,300	2,413,950.00	0.33
58	301548	崇德科技	43,200	2,389,392.00	0.32
59	601717	中创智领	97,000	2,381,350.00	0.32
60	000157	中联重科	275,701	2,379,299.63	0.32
61	300058	蓝色光标	206,500	2,378,880.00	0.32
62	000060	中金岭南	405,203	2,370,437.55	0.32
63	603259	药明康德	25,800	2,338,512.00	0.32
64	600028	中国石化	366,800	2,266,824.00	0.31
65	002532	天山铝业	139,700	2,260,346.00	0.30
66	300662	科锐国际	89,200	2,259,436.00	0.30
67	688981	中芯国际	18,300	2,247,789.00	0.30
68	002475	立讯精密	39,400	2,234,374.00	0.30
69	002340	格林美	258,900	2,164,404.00	0.29
70	301429	森泰股份	113,800	2,162,200.00	0.29
71	605098	行动教育	51,100	2,133,936.00	0.29
72	002768	国恩股份	40,000	2,107,200.00	0.28
73	300723	一品红	62,500	2,096,875.00	0.28
74	300750	宁德时代	5,700	2,093,382.00	0.28
75	603073	彩蝶实业	110,903	2,083,867.37	0.28
76	301291	明阳电气	49,800	2,072,178.00	0.28
77	002595	豪迈科技	24,500	2,070,495.00	0.28
78	301326	捷邦科技	18,900	2,063,124.00	0.28
79	600021	上海电力	103,000	2,062,060.00	0.28
80	301031	中熔电气	18,300	2,053,077.00	0.28

81	688772	珠海冠宇	95,000	2,045,350.00	0.28
82	688012	中微公司	7,200	2,043,000.00	0.28
83	300550	和仁科技	140,700	2,041,557.00	0.28
84	688235	百济神州	7,600	2,041,360.00	0.28
85	301606	绿联科技	34,700	2,038,278.00	0.27
86	603019	中科曙光	23,600	2,021,104.00	0.27
87	301059	金三江	160,000	2,016,000.00	0.27
88	688612	威迈斯	60,900	2,007,873.00	0.27
89	601138	工业富联	32,300	2,004,215.00	0.27
90	301080	百普赛斯	37,100	2,003,400.00	0.27
91	002371	北方华创	4,340	1,992,407.20	0.27
92	301538	骏鼎达	24,600	1,972,428.00	0.27
93	000807	云铝股份	59,600	1,957,264.00	0.26
94	300408	三环集团	42,600	1,948,950.00	0.26
95	600329	达仁堂	42,500	1,938,850.00	0.26
96	301233	盛帮股份	36,312	1,921,631.04	0.26
97	002247	聚力文化	678,100	1,905,461.00	0.26
98	300502	新易盛	4,400	1,895,872.00	0.26
99	688041	海光信息	8,400	1,885,044.00	0.25
100	300615	欣天科技	141,300	1,876,464.00	0.25
101	300378	鼎捷数智	41,400	1,873,764.00	0.25
102	688281	华秦科技	24,615	1,816,587.00	0.24
103	688008	澜起科技	15,400	1,814,120.00	0.24
104	000893	亚钾国际	37,600	1,803,672.00	0.24
105	601601	中国太保	43,000	1,802,130.00	0.24
106	002357	富临运业	167,100	1,791,312.00	0.24
107	000586	汇源通信	131,100	1,773,783.00	0.24
108	000333	美的集团	22,400	1,750,560.00	0.24
109	600885	宏发股份	57,500	1,748,000.00	0.24
110	002664	信质集团	72,000	1,725,120.00	0.23
111	601577	长沙银行	176,300	1,710,110.00	0.23
112	000001	平安银行	149,300	1,703,513.00	0.23
113	601233	桐昆股份	98,900	1,702,069.00	0.23
114	300496	中科创达	25,000	1,687,500.00	0.23
115	601958	金钼股份	108,140	1,684,821.20	0.23
116	002001	新和成	65,800	1,657,502.00	0.22
117	601156	东航物流	87,800	1,616,398.00	0.22
118	601728	中国电信	256,400	1,615,320.00	0.22
119	300257	开山股份	113,700	1,597,485.00	0.22
120	002290	禾盛新材	34,100	1,558,370.00	0.21
121	301228	实朴检测	40,300	1,555,983.00	0.21
122	002074	国轩高科	39,700	1,552,667.00	0.21
123	000425	徐工机械	132,000	1,528,560.00	0.21
124	002415	海康威视	51,200	1,527,808.00	0.21

125	601061	中信金属	106,000	1,526,400.00	0.21
126	002062	宏润建设	164,900	1,525,325.00	0.21
127	000959	首钢股份	308,800	1,513,120.00	0.20
128	688187	时代电气	29,100	1,492,539.00	0.20
129	002773	康弘药业	49,400	1,480,518.00	0.20
130	600195	中牧股份	186,600	1,468,542.00	0.20
131	300756	金马游乐	25,600	1,456,128.00	0.20
132	603880	南卫股份	233,000	1,451,590.00	0.20
133	302132	中航成飞	18,300	1,445,700.00	0.19
134	600361	创新新材	338,100	1,433,544.00	0.19
135	002008	大族激光	34,800	1,433,412.00	0.19
136	002493	荣盛石化	122,300	1,432,133.00	0.19
137	000725	京东方 A	332,200	1,398,562.00	0.19
138	000338	潍柴动力	80,100	1,377,720.00	0.19
139	600426	华鲁恒升	43,600	1,370,348.00	0.18
140	002696	百洋股份	193,000	1,364,510.00	0.18
141	688669	聚石化学	58,300	1,354,892.00	0.18
142	688116	天奈科技	28,700	1,353,205.00	0.18
143	000895	双汇发展	50,900	1,347,323.00	0.18
144	600901	江苏金租	219,720	1,344,686.40	0.18
145	601211	国泰海通	65,400	1,343,970.00	0.18
146	000600	建投能源	157,500	1,343,475.00	0.18
147	300339	润和软件	27,100	1,341,450.00	0.18
148	605567	春雪食品	121,900	1,340,900.00	0.18
149	301349	信德新材	28,500	1,336,935.00	0.18
150	603968	醋化股份	119,300	1,332,581.00	0.18
151	600522	中天科技	73,500	1,331,820.00	0.18
152	002110	三钢闽光	302,100	1,326,219.00	0.18
153	002824	和胜股份	68,100	1,321,140.00	0.18
154	002056	横店东磁	67,400	1,314,300.00	0.18
155	000878	云南铜业	63,700	1,306,487.00	0.18
156	688208	道通科技	35,500	1,306,400.00	0.18
157	688352	硕中科技	103,600	1,306,396.00	0.18
158	300505	川金诺	57,900	1,296,381.00	0.17
159	002234	民和股份	149,500	1,288,690.00	0.17
160	600051	宁波联合	170,900	1,288,586.00	0.17
161	002625	光启技术	26,400	1,287,264.00	0.17
162	688088	虹软科技	25,900	1,282,050.00	0.17
163	688002	睿创微纳	12,700	1,280,160.00	0.17
164	300242	佳云科技	255,900	1,279,500.00	0.17
165	002690	美亚光电	61,800	1,271,226.00	0.17
166	601088	中国神华	31,300	1,267,650.00	0.17
167	002027	分众传媒	171,900	1,266,903.00	0.17
168	603699	纽威股份	24,300	1,262,871.00	0.17

169	002241	歌尔股份	43,800	1,258,374.00	0.17
170	300938	信测标准	38,400	1,251,840.00	0.17
171	300625	三雄极光	105,300	1,247,805.00	0.17
172	301037	保立佳	85,700	1,234,080.00	0.17
173	000528	柳工	103,600	1,229,732.00	0.17
174	688659	元琛科技	129,800	1,226,610.00	0.17
175	301628	强达电路	13,800	1,224,750.00	0.17
176	300033	同花顺	3,800	1,224,284.00	0.17
177	002396	星网锐捷	40,400	1,224,120.00	0.17
178	300980	祥源新材	37,400	1,220,362.00	0.16
179	688819	天能股份	36,725	1,220,004.50	0.16
180	002524	光正眼科	293,300	1,208,396.00	0.16
181	300308	中际旭创	1,980	1,207,800.00	0.16
182	000930	中粮科技	207,300	1,196,121.00	0.16
183	002602	世纪华通	70,000	1,194,200.00	0.16
184	301121	紫建电子	29,900	1,191,216.00	0.16
185	002436	兴森科技	55,900	1,183,403.00	0.16
186	002494	华斯股份	218,700	1,178,793.00	0.16
187	688097	博众精工	31,200	1,177,800.00	0.16
188	603993	洛阳钼业	58,700	1,174,000.00	0.16
189	000059	华锦股份	219,216	1,172,805.60	0.16
190	605580	恒盛能源	51,900	1,170,864.00	0.16
191	603808	歌力思	136,600	1,163,832.00	0.16
192	000988	华工科技	14,600	1,158,218.00	0.16
193	300140	节能环境	170,100	1,151,577.00	0.16
194	301308	江波龙	4,700	1,150,748.00	0.16
195	600019	宝钢股份	154,300	1,149,535.00	0.16
196	002787	华源控股	92,300	1,149,135.00	0.15
197	688591	泰凌微	27,000	1,149,120.00	0.15
198	688509	正元地信	208,300	1,143,567.00	0.15
199	600808	马钢股份	270,700	1,142,354.00	0.15
200	601528	瑞丰银行	198,300	1,130,310.00	0.15
201	000576	甘化科工	107,300	1,129,869.00	0.15
202	600909	华安证券	166,400	1,128,192.00	0.15
203	001218	丽臣实业	49,500	1,127,610.00	0.15
204	001286	陕西能源	120,500	1,121,855.00	0.15
205	603588	高能环境	145,300	1,121,716.00	0.15
206	688127	蓝特光学	29,100	1,120,059.00	0.15
207	603500	祥和实业	93,100	1,115,338.00	0.15
208	688584	上海合晶	50,600	1,110,164.00	0.15
209	000761	本钢板材	324,700	1,087,745.00	0.15
210	600109	国金证券	116,500	1,083,450.00	0.15
211	600160	巨化股份	28,100	1,079,602.00	0.15
212	002558	巨人网络	24,900	1,077,921.00	0.15

213	601398	工商银行	135,600	1,075,308.00	0.15
214	603172	万丰股份	60,400	1,075,120.00	0.14
215	603331	百达精工	75,100	1,070,175.00	0.14
216	002487	大金重工	20,600	1,069,758.00	0.14
217	002714	牧原股份	20,900	1,057,122.00	0.14
218	688565	力源科技	94,046	1,052,374.74	0.14
219	601339	百隆东方	181,500	1,050,885.00	0.14
220	688512	慧智微	93,500	1,043,460.00	0.14
221	002246	北化股份	57,900	1,043,358.00	0.14
222	301498	乖宝宠物	16,000	1,042,400.00	0.14
223	300124	汇川技术	13,800	1,039,554.00	0.14
224	300926	博俊科技	31,400	1,029,292.00	0.14
225	002206	海利得	175,600	1,027,260.00	0.14
226	300487	蓝晓科技	16,600	1,025,050.00	0.14
227	600096	云天化	30,500	1,019,005.00	0.14
228	688609	九联科技	99,800	1,018,958.00	0.14
229	603486	科沃斯	12,600	1,016,568.00	0.14
230	603659	璞泰来	37,100	1,014,314.00	0.14
231	600301	华锡有色	26,400	1,012,704.00	0.14
232	301266	宇邦新材	27,800	1,010,530.00	0.14
233	603081	大丰实业	72,000	1,010,160.00	0.14
234	000887	中鼎股份	43,400	1,007,314.00	0.14
235	301529	福赛科技	8,900	1,006,590.00	0.14
236	002817	黄山胶囊	132,400	1,006,240.00	0.14
237	600023	浙能电力	201,716	998,494.20	0.13
238	688371	菲沃泰	53,900	995,533.00	0.13
239	301419	阿莱德	29,300	992,684.00	0.13
240	000050	深天马 A	109,800	991,494.00	0.13
241	688708	佳驰科技	15,900	989,775.00	0.13
242	603799	华友钴业	14,500	989,770.00	0.13
243	688132	邦彦技术	53,500	985,470.00	0.13
244	601107	四川成渝	162,000	984,960.00	0.13
245	600507	方大特钢	166,600	981,274.00	0.13
246	301223	中荣股份	53,200	977,284.00	0.13
247	002803	吉宏股份	59,700	976,692.00	0.13
248	002441	众业达	103,500	972,900.00	0.13
249	600795	国电电力	192,000	967,680.00	0.13
250	688602	康鹏科技	111,300	966,084.00	0.13
251	002107	沃华医药	154,600	964,704.00	0.13
252	001333	光华股份	44,600	958,900.00	0.13
253	300302	同有科技	52,800	957,792.00	0.13
254	002054	德美化工	129,600	956,448.00	0.13
255	000063	中兴通讯	25,200	953,568.00	0.13
256	600295	鄂尔多斯	76,900	950,484.00	0.13

257	000831	中国稀土	20,200	938,088.00	0.13
258	000987	越秀资本	114,800	934,472.00	0.13
259	301006	迈拓股份	56,400	930,036.00	0.13
260	002979	雷赛智能	22,000	925,540.00	0.12
261	600202	哈空调	157,500	924,525.00	0.12
262	601162	天风证券	221,900	923,104.00	0.12
263	000630	铜陵有色	153,500	922,535.00	0.12
264	300604	长川科技	9,100	921,921.00	0.12
265	002318	久立特材	31,800	920,610.00	0.12
266	688295	中复神鹰	27,700	908,837.00	0.12
267	600075	新疆天业	182,600	903,870.00	0.12
268	002527	新时达	50,900	902,966.00	0.12
269	300409	道氏技术	40,100	901,849.00	0.12
270	600742	富维股份	90,000	900,000.00	0.12
271	300074	华平股份	194,600	897,106.00	0.12
272	603070	万控智造	68,800	891,648.00	0.12
273	301027	华蓝集团	48,300	889,203.00	0.12
274	688728	格科微	59,200	884,448.00	0.12
275	688055	龙腾光电	243,200	875,520.00	0.12
276	002963	豪尔赛	58,600	871,968.00	0.12
277	301607	富特科技	21,700	870,387.00	0.12
278	301389	隆扬电子	15,900	867,822.00	0.12
279	002392	北京利尔	116,000	867,680.00	0.12
280	000553	安道麦 A	158,300	867,484.00	0.12
281	688072	拓荆科技	2,600	858,000.00	0.12
282	000686	东北证券	91,300	850,916.00	0.11
283	688321	微芯生物	29,100	850,302.00	0.11
284	601375	中原证券	196,700	845,810.00	0.11
285	000758	中色股份	127,000	843,280.00	0.11
286	301503	智迪科技	23,200	836,592.00	0.11
287	002448	中原内配	64,100	828,813.00	0.11
288	300011	鼎汉技术	96,400	827,112.00	0.11
289	605020	永和股份	30,700	825,523.00	0.11
290	688686	奥普特	6,566	815,037.58	0.11
291	000619	海螺新材	130,800	812,268.00	0.11
292	002897	意华股份	15,000	811,050.00	0.11
293	002182	宝武镁业	52,800	807,840.00	0.11
294	600031	三一重工	38,200	807,166.00	0.11
295	603848	好太太	44,100	805,707.00	0.11
296	600643	爱建集团	145,400	804,062.00	0.11
297	301446	福事特	25,100	802,196.00	0.11
298	000899	赣能股份	81,000	801,900.00	0.11
299	601766	中国中车	116,900	797,258.00	0.11
300	600748	上实发展	147,000	796,740.00	0.11

301	300628	亿联网络	22,300	794,995.00	0.11
302	002399	海普瑞	67,300	793,467.00	0.11
303	600015	华夏银行	114,100	783,867.00	0.11
304	600876	凯盛新能	78,900	777,954.00	0.10
305	600572	康恩贝	169,800	757,308.00	0.10
306	002652	扬子新材	190,800	753,660.00	0.10
307	603182	嘉华股份	47,600	753,032.00	0.10
308	603267	鸿远电子	13,800	751,134.00	0.10
309	002014	永新股份	63,000	750,960.00	0.10
310	601330	绿色动力	110,600	744,338.00	0.10
311	600276	恒瑞医药	12,400	738,668.00	0.10
312	688530	欧莱新材	44,800	736,512.00	0.10
313	601688	华泰证券	31,200	736,008.00	0.10
314	600549	厦门钨业	17,800	730,868.00	0.10
315	300747	锐科激光	27,000	729,810.00	0.10
316	002500	山西证券	121,600	728,384.00	0.10
317	001322	箭牌家居	82,000	727,340.00	0.10
318	600496	精工钢构	174,400	723,760.00	0.10
319	600662	外服控股	143,600	720,872.00	0.10
320	002028	思源电气	4,600	711,114.00	0.10
321	603579	荣泰健康	29,800	709,538.00	0.10
322	603969	银龙股份	70,100	708,711.00	0.10
323	002281	光迅科技	10,100	706,495.00	0.10
324	002798	帝欧水华	122,800	703,644.00	0.09
325	301388	欣灵电气	23,100	701,778.00	0.09
326	300835	龙磁科技	10,700	701,706.00	0.09
327	603590	康辰药业	17,500	695,625.00	0.09
328	000975	山金国际	28,400	690,972.00	0.09
329	002064	华峰化学	62,400	686,400.00	0.09
330	601868	中国能建	287,000	674,450.00	0.09
331	002099	海翔药业	108,000	673,920.00	0.09
332	600011	华能国际	89,400	666,924.00	0.09
333	688123	聚辰股份	5,300	665,574.00	0.09
334	002484	江海股份	22,200	659,340.00	0.09
335	600428	中远海特	92,000	653,200.00	0.09
336	000100	TCL 科技	143,700	652,398.00	0.09
337	601939	建设银行	70,100	650,528.00	0.09
338	603118	共进股份	56,400	648,600.00	0.09
339	605118	力鼎光电	21,300	641,343.00	0.09
340	601999	出版传媒	92,300	634,101.00	0.09
341	002913	奥士康	14,800	632,552.00	0.09
342	000962	东方钨业	19,100	631,446.00	0.09
343	001358	兴欣新材	24,400	629,764.00	0.08
344	300187	永清环保	129,100	628,717.00	0.08

345	300719	安达维尔	34,700	628,417.00	0.08
346	300354	东华测试	13,800	627,900.00	0.08
347	300765	新诺威	17,400	627,618.00	0.08
348	002539	云图控股	52,900	625,278.00	0.08
349	688329	艾隆科技	29,000	617,410.00	0.08
350	600497	驰宏锌锗	84,200	615,502.00	0.08
351	601963	重庆银行	56,800	615,144.00	0.08
352	600716	凤凰股份	158,900	614,943.00	0.08
353	300922	天秦装备	26,700	610,629.00	0.08
354	601600	中国铝业	49,603	606,148.66	0.08
355	002216	三全食品	52,800	596,112.00	0.08
356	002921	联诚精密	34,800	592,296.00	0.08
357	301070	开勒股份	9,600	590,880.00	0.08
358	300207	欣旺达	22,500	588,375.00	0.08
359	300845	捷安高科	50,946	574,161.42	0.08
360	600126	杭钢股份	69,992	571,134.72	0.08
361	605198	安德利	15,100	568,062.00	0.08
362	002946	新乳业	30,600	567,018.00	0.08
363	605599	莱百股份	34,600	566,402.00	0.08
364	002511	中顺洁柔	66,000	564,960.00	0.08
365	688030	山石网科	31,000	563,270.00	0.08
366	300449	汉邦高科	73,900	563,118.00	0.08
367	600660	福耀玻璃	8,600	557,022.00	0.08
368	600970	中材国际	53,500	555,865.00	0.07
369	002815	崇达技术	40,500	553,230.00	0.07
370	600741	华域汽车	27,500	550,000.00	0.07
371	002849	威星智能	34,400	546,960.00	0.07
372	600309	万华化学	7,100	544,428.00	0.07
373	002483	润邦股份	76,100	543,354.00	0.07
374	688079	美迪凯	47,600	538,832.00	0.07
375	600724	宁波富达	93,400	537,984.00	0.07
376	002624	完美世界	32,700	535,953.00	0.07
377	002258	利尔化学	40,600	529,830.00	0.07
378	002138	顺络电子	14,900	529,397.00	0.07
379	600098	广州发展	80,900	529,086.00	0.07
380	002328	新朋股份	80,000	528,800.00	0.07
381	000002	万科 A	113,100	525,915.00	0.07
382	300201	海伦哲	76,700	523,861.00	0.07
383	601117	中国化学	69,300	521,829.00	0.07
384	600578	京能电力	102,100	520,710.00	0.07
385	600233	圆通速递	31,700	520,514.00	0.07
386	600851	海欣股份	75,800	517,714.00	0.07
387	601456	国联民生	50,200	510,534.00	0.07
388	003019	宸展光电	15,235	510,067.80	0.07

389	603282	亚光股份	25,700	509,888.00	0.07
390	002004	华邦健康	106,400	508,592.00	0.07
391	601988	中国银行	88,600	507,678.00	0.07
392	600118	中国卫星	5,300	503,235.00	0.07
393	002545	东方铁塔	27,200	501,840.00	0.07
394	301181	标榜股份	11,300	499,234.00	0.07
395	002454	松芝股份	56,300	490,373.00	0.07
396	301556	托普云农	5,000	490,200.00	0.07
397	002048	宁波华翔	15,300	481,338.00	0.06
398	605177	东亚药业	26,900	478,820.00	0.06
399	601919	中远海控	31,400	476,652.00	0.06
400	300932	三友联众	39,700	476,003.00	0.06
401	301287	康力源	11,400	475,608.00	0.06
402	301192	泰祥股份	16,000	475,040.00	0.06
403	600583	海油工程	86,100	472,689.00	0.06
404	003012	东鹏控股	72,000	471,600.00	0.06
405	601609	金田股份	43,400	468,720.00	0.06
406	600935	华塑股份	190,400	466,480.00	0.06
407	300030	阳普医疗	62,500	460,000.00	0.06
408	603013	亚普股份	18,600	458,862.00	0.06
409	603982	泉峰汽车	54,800	458,676.00	0.06
410	300709	精研科技	9,700	457,452.00	0.06
411	002608	江苏国信	61,500	454,485.00	0.06
412	603353	和顺石油	16,600	453,678.00	0.06
413	002128	电投能源	16,200	452,142.00	0.06
414	300852	四会富仕	11,800	450,524.00	0.06
415	301110	青木科技	6,800	450,024.00	0.06
416	301552	科力装备	12,000	449,880.00	0.06
417	603312	西典新能	9,600	449,280.00	0.06
418	600626	申达股份	92,300	445,809.00	0.06
419	600183	生益科技	6,200	442,742.00	0.06
420	001872	招商港口	22,900	442,657.00	0.06
421	002916	深南电路	1,900	441,351.00	0.06
422	300394	天孚通信	2,168	440,169.04	0.06
423	300857	协创数据	2,600	438,568.00	0.06
424	002671	龙泉股份	83,500	437,540.00	0.06
425	600269	赣粤高速	84,300	437,517.00	0.06
426	603233	大参林	24,100	424,642.00	0.06
427	301150	中一科技	10,000	419,900.00	0.06
428	002156	通富微电	11,100	418,470.00	0.06
429	603179	新泉股份	5,500	406,340.00	0.05
430	301512	智信精密	9,200	402,408.00	0.05
431	003043	华亚智能	8,640	400,636.80	0.05
432	600251	冠农股份	43,200	398,736.00	0.05

433	000728	国元证券	47,600	397,460.00	0.05
434	603303	得邦照明	30,700	395,723.00	0.05
435	300246	宝莱特	48,800	395,280.00	0.05
436	002975	博杰股份	5,100	392,700.00	0.05
437	600499	科达制造	28,300	392,521.00	0.05
438	301090	华润材料	55,700	392,128.00	0.05
439	688296	和达科技	28,843	382,169.75	0.05
440	300682	朗新集团	25,000	380,250.00	0.05
441	688689	银河微电	13,300	377,454.00	0.05
442	603515	欧普照明	20,600	376,568.00	0.05
443	301338	凯格精机	4,200	370,062.00	0.05
444	301251	威尔高	7,000	365,960.00	0.05
445	603669	灵康药业	80,123	365,360.88	0.05
446	002837	英维克	3,400	363,426.00	0.05
447	300945	曼卡龙	22,100	357,136.00	0.05
448	300674	宇信科技	14,700	356,622.00	0.05
449	600801	华新建材	14,500	355,830.00	0.05
450	002102	能特科技	105,400	350,982.00	0.05
451	001326	联域股份	7,400	349,428.00	0.05
452	300492	华图山鼎	4,700	349,210.00	0.05
453	002398	垒知集团	61,900	347,878.00	0.05
454	001696	宗申动力	16,000	347,040.00	0.05
455	605507	国邦医药	13,900	344,720.00	0.05
456	600933	爱柯迪	17,100	343,710.00	0.05
457	603236	移远通信	3,600	343,476.00	0.05
458	002203	海亮股份	26,943	341,098.38	0.05
459	688510	航亚科技	12,600	338,940.00	0.05
460	600372	中航机载	25,019	335,754.98	0.05
461	601166	兴业银行	15,900	334,854.00	0.05
462	601877	正泰电器	12,000	334,680.00	0.05
463	003006	百亚股份	15,300	334,152.00	0.05
464	605305	中际联合	8,000	333,280.00	0.04
465	300687	赛意信息	14,500	333,065.00	0.04
466	603317	天味食品	26,600	333,032.00	0.04
467	601003	柳钢股份	65,800	330,974.00	0.04
468	300702	天宇股份	14,000	330,400.00	0.04
469	000682	东方电子	27,700	328,522.00	0.04
470	002516	旷达科技	49,800	328,182.00	0.04
471	002993	奥海科技	7,500	327,825.00	0.04
472	002096	易普力	24,600	327,672.00	0.04
473	300323	华灿光电	41,000	327,180.00	0.04
474	000902	新洋丰	20,900	326,458.00	0.04
475	600883	博闻科技	40,500	326,430.00	0.04
476	301502	华阳智能	7,300	326,164.00	0.04

477	002078	太阳纸业	20,600	324,450.00	0.04
478	301631	壹连科技	3,100	321,005.00	0.04
479	600665	天地源	97,700	320,456.00	0.04
480	600326	西藏天路	29,000	319,870.00	0.04
481	301303	真兰仪表	21,100	319,454.00	0.04
482	600930	华电新能	50,984	318,140.16	0.04
483	002245	蔚蓝锂芯	17,800	316,840.00	0.04
484	603858	步长制药	19,951	312,033.64	0.04
485	000833	粤桂股份	15,800	307,468.00	0.04
486	688450	光格科技	11,100	306,138.00	0.04
487	688597	煜邦电力	37,200	305,412.00	0.04
488	688027	国盾量子	600	302,274.00	0.04
489	601228	广州港	93,200	301,968.00	0.04
490	301095	广立微	4,200	301,182.00	0.04
491	600388	龙净环保	18,400	300,104.00	0.04
492	603733	仙鹤股份	12,400	299,708.00	0.04
493	301592	六九一二	2,400	293,280.00	0.04
494	300050	世纪鼎利	52,800	291,984.00	0.04
495	000029	深深房 A	13,200	290,664.00	0.04
496	301072	中捷精工	12,900	290,508.00	0.04
497	000978	桂林旅游	40,100	290,324.00	0.04
498	000733	振华科技	5,500	288,255.00	0.04
499	002458	益生股份	34,300	287,434.00	0.04
500	301177	迪阿股份	9,900	285,813.00	0.04
501	000751	锌业股份	69,700	285,073.00	0.04
502	002373	千方科技	24,200	284,834.00	0.04
503	601949	中国出版	44,100	284,445.00	0.04
504	605058	澳弘电子	9,300	283,836.00	0.04
505	600482	中国动力	13,700	283,590.00	0.04
506	002319	乐通股份	23,500	282,940.00	0.04
507	603323	苏农银行	55,800	281,790.00	0.04
508	300328	宜安科技	16,500	281,655.00	0.04
509	002839	张家港行	61,600	281,512.00	0.04
510	301372	科净源	11,100	281,496.00	0.04
511	002670	国盛证券	16,700	281,228.00	0.04
512	688795	摩尔线程	675	280,921.50	0.04
513	688009	中国通号	51,100	279,517.00	0.04
514	601319	中国人保	31,200	279,240.00	0.04
515	002807	江阴银行	61,000	278,770.00	0.04
516	688610	埃科光电	4,500	278,145.00	0.04
517	600386	北巴传媒	63,300	277,887.00	0.04
518	002780	三夫户外	19,100	274,276.00	0.04
519	002948	青岛银行	61,200	274,176.00	0.04
520	300274	阳光电源	1,600	273,664.00	0.04

521	300389	艾比森	16,800	272,664.00	0.04
522	000963	华东医药	6,900	272,205.00	0.04
523	300357	我武生物	9,600	272,160.00	0.04
524	688256	寒武纪	200	271,110.00	0.04
525	002940	昂利康	7,900	264,808.00	0.04
526	300415	伊之密	10,000	260,600.00	0.04
527	300695	兆丰股份	2,600	260,156.00	0.04
528	603279	景津装备	15,000	253,050.00	0.03
529	603328	依顿电子	23,000	252,080.00	0.03
530	688355	明志科技	14,000	249,200.00	0.03
531	603126	中材节能	36,700	246,624.00	0.03
532	600369	西南证券	53,900	241,472.00	0.03
533	603219	富佳股份	14,300	240,812.00	0.03
534	000009	中国宝安	24,300	239,355.00	0.03
535	600774	汉商集团	26,100	238,554.00	0.03
536	002192	融捷股份	4,600	238,050.00	0.03
537	000031	大悦城	84,200	237,444.00	0.03
538	300652	雷迪克	4,300	235,898.00	0.03
539	000828	东莞控股	21,900	235,644.00	0.03
540	600050	中国联通	46,100	235,571.00	0.03
541	301123	奕东电子	3,200	235,392.00	0.03
542	603978	深圳新星	8,300	234,392.00	0.03
543	000990	诚志股份	29,500	233,640.00	0.03
544	000977	浪潮信息	3,500	233,100.00	0.03
545	688328	深科达	7,900	230,522.00	0.03
546	600737	中粮糖业	12,600	216,846.00	0.03
547	603700	宁水集团	15,900	216,081.00	0.03
548	000006	深振业 A	21,500	213,925.00	0.03
549	300610	晨化股份	18,400	213,624.00	0.03
550	000589	贵州轮胎	41,200	213,416.00	0.03
551	600866	星湖科技	30,700	213,365.00	0.03
552	301459	丰茂股份	4,800	213,024.00	0.03
553	301622	英思特	3,300	212,520.00	0.03
554	688692	达梦数据	800	209,016.00	0.03
555	301507	民生健康	13,600	208,896.00	0.03
556	001309	德明利	900	208,701.00	0.03
557	300618	寒锐钴业	4,600	207,966.00	0.03
558	300006	莱美药业	40,100	206,114.00	0.03
559	603167	渤海轮渡	21,800	205,574.00	0.03
560	601808	中海油服	14,500	203,580.00	0.03
561	600768	宁波富邦	14,100	197,400.00	0.03
562	301236	软通动力	4,000	189,720.00	0.03
563	000672	上峰水泥	14,400	187,056.00	0.03
564	688783	西安奕材	10,175	186,813.00	0.03

565	688681	科汇股份	10,600	186,348.00	0.03
566	688151	华强科技	9,000	185,580.00	0.03
567	600533	栖霞建设	72,000	184,320.00	0.02
568	600784	鲁银投资	26,400	184,272.00	0.02
569	688798	艾为电子	2,400	182,664.00	0.02
570	600352	浙江龙盛	17,100	182,286.00	0.02
571	600128	苏豪弘业	16,500	181,335.00	0.02
572	688550	瑞联新材	4,000	181,240.00	0.02
573	301358	湖南裕能	2,800	181,048.00	0.02
574	002148	北纬科技	20,100	178,890.00	0.02
575	603216	梦天家居	3,700	173,900.00	0.02
576	002489	浙江永强	45,400	173,882.00	0.02
577	002976	瑞玛精密	6,200	173,786.00	0.02
578	688802	沐曦股份	434	173,300.54	0.02
579	301216	万凯新材	9,800	165,228.00	0.02
580	688515	裕太微	1,600	164,080.00	0.02
581	000597	东北制药	31,300	163,386.00	0.02
582	688006	杭可科技	5,500	161,095.00	0.02
583	301107	瑜欣电子	5,700	160,968.00	0.02
584	600629	华建集团	7,300	158,410.00	0.02
585	300162	雷曼光电	19,400	157,722.00	0.02
586	688177	百奥泰	6,500	150,410.00	0.02
587	301019	宁波色母	6,500	148,590.00	0.02
588	002155	湖南黄金	7,000	147,630.00	0.02
589	300806	斯迪克	4,800	147,552.00	0.02
590	002756	永兴材料	2,700	146,475.00	0.02
591	300358	楚天科技	14,800	144,892.00	0.02
592	002801	微光股份	4,000	141,640.00	0.02
593	688238	和元生物	20,800	138,528.00	0.02
594	301571	国科天成	2,400	138,432.00	0.02
595	600519	贵州茅台	100	137,718.00	0.02
596	001301	尚太科技	1,600	137,296.00	0.02
597	688765	禾元生物	2,592	136,391.04	0.02
598	600376	首开股份	20,600	136,166.00	0.02
599	002709	天赐材料	2,900	134,357.00	0.02
600	300087	荃银高科	11,100	129,648.00	0.02
601	002956	西麦食品	4,600	129,352.00	0.02
602	688206	概伦电子	3,700	128,871.00	0.02
603	301148	嘉戎技术	2,700	128,385.00	0.02
604	600725	云维股份	30,600	127,908.00	0.02
605	001979	招商蛇口	14,600	126,144.00	0.02
606	688411	海博思创	500	125,020.00	0.02
607	001306	夏厦精密	1,400	124,600.00	0.02
608	002303	美盈森	30,600	123,318.00	0.02

609	001287	中电港	5,400	122,364.00	0.02
610	688558	国盛智科	4,200	121,506.00	0.02
611	002060	广东建工	33,000	118,800.00	0.02
612	688678	福立旺	4,877	117,925.86	0.02
613	600908	无锡银行	19,700	116,821.00	0.02
614	000555	神州信息	6,900	114,195.00	0.02
615	688484	南芯科技	2,800	113,848.00	0.02
616	000927	中国铁物	43,200	112,752.00	0.02
617	603061	金海通	800	112,320.00	0.02
618	301656	联合动力	4,335	110,369.10	0.01
619	301160	翔楼新材	1,500	107,835.00	0.01
620	688061	灿瑞科技	3,300	107,613.00	0.01
621	688039	当虹科技	2,400	107,400.00	0.01
622	605158	华达新材	13,300	106,932.00	0.01
623	300804	广康生化	3,000	105,000.00	0.01
624	300450	先导智能	2,100	104,958.00	0.01
625	002237	恒邦股份	7,800	104,676.00	0.01
626	688213	思特威	1,100	104,599.00	0.01
627	301167	建研设计	6,400	104,000.00	0.01
628	001280	中国铀业	2,277	103,284.72	0.01
629	600273	嘉化能源	11,800	103,132.00	0.01
630	300748	金力永磁	3,000	102,330.00	0.01
631	301280	珠城科技	1,900	101,194.00	0.01
632	688799	华纳药厂	2,100	100,170.00	0.01
633	600176	中国巨石	5,800	99,180.00	0.01
634	301323	新莱福	1,800	98,226.00	0.01
635	002772	众兴菌业	6,600	96,294.00	0.01
636	600020	中原高速	22,500	95,850.00	0.01
637	000923	河钢资源	4,500	95,265.00	0.01
638	688077	大地熊	3,100	94,705.00	0.01
639	688553	汇宇制药-W	5,300	94,287.00	0.01
640	301081	严牌股份	9,200	93,196.00	0.01
641	300611	美力科技	3,400	92,684.00	0.01
642	300619	金银河	2,100	92,190.00	0.01
643	301157	华塑科技	1,700	88,434.00	0.01
644	688007	光峰科技	4,600	85,422.00	0.01
645	301061	匠心家居	900	85,320.00	0.01
646	300008	天海防务	10,800	85,212.00	0.01
647	600236	桂冠电力	10,800	84,564.00	0.01
648	600688	上海石化	30,000	83,400.00	0.01
649	000726	鲁泰 A	11,600	82,592.00	0.01
650	002230	科大讯飞	1,600	80,464.00	0.01
651	300206	理邦仪器	6,200	79,298.00	0.01
652	000883	湖北能源	17,100	77,634.00	0.01

653	002967	广电计量	3,500	77,035.00	0.01
654	002317	众生药业	4,000	75,920.00	0.01
655	301339	通行宝	5,220	75,898.80	0.01
656	600988	赤峰黄金	2,400	74,976.00	0.01
657	601225	陕西煤业	3,451	73,575.32	0.01
658	301087	可孚医疗	1,600	71,472.00	0.01
659	002293	罗莱生活	6,900	70,863.00	0.01
660	002763	汇洁股份	9,800	70,756.00	0.01
661	688326	经纬恒润	600	70,500.00	0.01
662	600262	北方股份	2,700	70,281.00	0.01
663	688759	必贝特	2,789	70,031.79	0.01
664	688636	智明达	1,600	68,544.00	0.01
664	300025	华星创业	11,900	68,544.00	0.01
665	688186	广大特材	3,000	68,040.00	0.01
666	600403	大有能源	9,600	67,008.00	0.01
667	300976	达瑞电子	1,100	66,077.00	0.01
668	002863	今飞凯达	11,200	65,744.00	0.01
669	688166	博瑞医药	1,300	63,778.00	0.01
670	300658	延江股份	4,300	63,726.00	0.01
671	002985	北摩高科	2,000	63,460.00	0.01
672	688449	联芸科技	1,400	63,252.00	0.01
673	600231	凌钢股份	28,500	60,990.00	0.01
674	688790	昂瑞微	516	60,470.04	0.01
675	688489	三未信安	1,300	59,423.00	0.01
676	000768	中航西飞	2,300	58,374.00	0.01
677	002986	宇新股份	5,400	58,104.00	0.01
678	600791	京能置业	12,400	58,032.00	0.01
679	600508	上海能源	4,900	57,673.00	0.01
680	300866	安克创新	500	57,195.00	0.01
681	002271	东方雨虹	4,200	57,078.00	0.01
682	600315	上海家化	2,500	56,300.00	0.01
683	300726	宏达电子	1,100	56,001.00	0.01
684	688531	日联科技	800	52,824.00	0.01
685	300445	康斯特	2,000	52,120.00	0.01
686	002161	远望谷	7,100	51,901.00	0.01
687	603185	弘元绿能	1,700	51,850.00	0.01
688	001212	中旗新材	1,000	50,700.00	0.01
689	601995	中金公司	1,400	49,000.00	0.01
690	688789	宏华数科	600	48,942.00	0.01
691	688809	强一股份	236	47,981.16	0.01
692	301200	大族数控	400	47,508.00	0.01
693	000993	闽东电力	3,900	46,722.00	0.01
694	300558	贝达药业	1,000	46,690.00	0.01
695	688063	派能科技	800	45,456.00	0.01

696	688439	振华风光	700	45,220.00	0.01
697	688496	清越科技	7,600	45,144.00	0.01
698	300703	创源股份	1,800	43,992.00	0.01
699	688768	容知日新	1,000	43,440.00	0.01
700	300602	飞荣达	1,300	43,108.00	0.01
701	002440	闰土股份	5,600	41,832.00	0.01
702	600415	小商品城	2,600	41,470.00	0.01
703	601801	皖新传媒	6,100	40,138.00	0.01
704	300567	精测电子	400	36,480.00	0.00
705	600517	国网英大	5,800	34,858.00	0.00
706	002996	顺博合金	4,600	34,776.00	0.00
707	000626	远大控股	4,300	34,099.00	0.00
708	688300	联瑞新材	549	34,087.41	0.00
709	301190	善水科技	1,600	33,936.00	0.00
710	603048	浙江黎明	1,600	33,824.00	0.00
711	301314	科瑞思	800	33,616.00	0.00
712	301638	南网数字	2,322	32,995.62	0.00
713	605178	时空科技	600	31,074.00	0.00
714	300655	晶瑞电材	1,900	30,647.00	0.00
715	001386	马可波罗	1,626	30,129.78	0.00
716	688729	屹唐股份	1,240	30,107.20	0.00
717	300476	胜宏科技	100	28,758.00	0.00
718	600918	中泰证券	4,100	26,650.00	0.00
719	600792	云煤能源	5,600	21,728.00	0.00
720	300154	瑞凌股份	2,200	21,670.00	0.00
721	688239	航宇科技	300	20,301.00	0.00
722	688727	恒坤新材	563	19,631.81	0.00
723	001233	海安集团	370	19,195.60	0.00
724	688001	华兴源创	600	18,108.00	0.00
725	688796	百奥赛图	423	17,871.75	0.00
726	688807	优迅股份	131	17,758.36	0.00
727	603006	联明股份	1,300	17,056.00	0.00
728	000823	超声电子	1,200	16,272.00	0.00
729	301632	广东建科	656	15,534.08	0.00
730	301563	云汉芯城	110	14,705.90	0.00
731	000960	锡业股份	500	13,940.00	0.00
732	301491	汉桑科技	245	13,501.95	0.00
733	605376	博迁新材	200	13,080.00	0.00
734	301584	建发致新	447	11,988.54	0.00
735	002841	视源股份	300	11,889.00	0.00
736	001369	双欣环保	897	11,562.33	0.00
737	301609	山大电力	277	11,354.23	0.00
738	002895	川恒股份	300	10,998.00	0.00
739	001366	播恩集团	800	10,696.00	0.00

740	301687	新广益	195	10,606.05	0.00
741	001221	悍高集团	160	9,110.40	0.00
742	301295	美硕科技	300	8,940.00	0.00
743	301667	纳百川	151	8,617.57	0.00
744	688805	健信超导	265	8,578.05	0.00
745	603418	友升股份	139	8,209.34	0.00
746	603175	超颖电子	169	8,206.64	0.00
747	603092	德力佳	146	8,126.36	0.00
748	001285	瑞立科密	137	7,682.96	0.00
749	301668	昊创瑞通	165	7,392.00	0.00
750	300644	南京聚隆	200	7,382.00	0.00
751	301449	天溯计量	112	7,305.76	0.00
752	000931	中关村	1,400	6,818.00	0.00
753	601026	道生天合	451	6,440.28	0.00
754	301575	艾芬达	126	6,243.30	0.00
755	603043	广州酒家	300	5,289.00	0.00
756	603406	天富龙	129	5,180.64	0.00
757	688468	科美诊断	700	5,138.00	0.00
758	002006	精工科技	200	4,632.00	0.00
759	300504	天邑股份	300	4,467.00	0.00
760	300196	长海股份	300	4,368.00	0.00
761	603262	技源集团	155	4,355.50	0.00
762	603248	锡华科技	260	4,238.00	0.00
763	001388	信通电子	94	4,036.36	0.00
764	000651	格力电器	100	4,022.00	0.00
765	301051	信濠光电	200	3,920.00	0.00
766	600016	民生银行	1,000	3,830.00	0.00
767	603370	华新精科	82	3,800.70	0.00
768	000999	华润三九	129	3,671.34	0.00
769	688021	奥福科技	200	3,670.00	0.00
770	002022	科华生物	600	3,564.00	0.00
771	002999	天禾股份	500	3,415.00	0.00
772	002694	顾地科技	900	3,384.00	0.00
773	688579	山大地纬	300	3,234.00	0.00
774	301333	诺思格	54	3,215.70	0.00
775	603376	大明电子	111	2,909.31	0.00
776	603334	丰倍生物	88	2,888.16	0.00
777	001323	慕思股份	110	2,855.60	0.00
778	301170	锡南科技	100	2,795.00	0.00
779	301353	普莱得	100	2,660.00	0.00
780	002017	东信和平	115	2,564.50	0.00
781	001396	誉帆科技	69	2,441.91	0.00
782	300893	松原安全	80	1,891.20	0.00
783	300768	迪普科技	100	1,853.00	0.00

784	603277	银都股份	110	1,851.30	0.00
785	600161	天坛生物	108	1,764.72	0.00
786	603939	益丰药房	80	1,737.60	0.00
787	603871	嘉友国际	118	1,646.10	0.00
788	301519	舜禹股份	99	1,328.58	0.00
789	002911	佛燃能源	98	1,187.76	0.00
790	300034	钢研高纳	60	1,174.80	0.00
791	601128	常熟银行	133	936.32	0.00
792	600998	九州通	84	430.08	0.00
793	000567	海德股份	54	346.68	0.00

#### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 8.4.1 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	74,216,192.00	25.41
2	000166	申万宏源	64,005,460.75	21.91
3	601688	华泰证券	41,446,577.00	14.19
4	002001	新和成	38,296,188.00	13.11
5	301035	润丰股份	35,226,705.00	12.06
6	601318	中国平安	33,994,803.00	11.64
7	601995	中金公司	31,572,251.80	10.81
8	603379	三美股份	30,118,222.64	10.31
9	000725	京东方 A	28,933,537.00	9.90
10	600999	招商证券	28,768,799.00	9.85
11	002736	国信证券	28,404,463.00	9.72
12	603858	步长制药	27,796,164.15	9.52
13	000538	云南白药	27,639,080.20	9.46
14	300999	金龙鱼	27,343,058.00	9.36
15	601668	中国建筑	26,689,941.00	9.14
16	601061	中信金属	25,198,051.00	8.63
17	601336	新华保险	24,510,116.00	8.39
18	301233	盛帮股份	24,445,395.56	8.37
19	002803	吉宏股份	24,378,974.00	8.35
20	000728	国元证券	23,595,168.00	8.08
21	300476	胜宏科技	23,555,309.00	8.06
22	002371	北方华创	23,270,342.00	7.97
23	601901	方正证券	22,997,581.00	7.87
24	002545	东方铁塔	22,668,720.00	7.76
25	000408	藏格矿业	21,957,904.00	7.52
26	600926	杭州银行	21,597,040.00	7.39

27	002236	大华股份	21,487,121.00	7.36
28	603979	金诚信	20,556,759.46	7.04
29	000630	铜陵有色	20,130,540.00	6.89
30	603444	吉比特	19,332,148.00	6.62
31	000623	吉林敖东	19,325,124.40	6.62
32	300866	安克创新	19,143,965.10	6.55
33	000792	盐湖股份	19,056,024.00	6.52
34	002396	星网锐捷	18,899,873.00	6.47
35	001238	浙江正特	18,836,034.00	6.45
36	301283	聚胶股份	18,753,170.00	6.42
37	002487	大金重工	18,533,488.00	6.34
38	001223	欧克科技	18,074,238.20	6.19
39	601390	中国中铁	18,018,778.00	6.17
40	601868	中国能建	17,843,042.00	6.11
41	603160	汇顶科技	17,771,966.00	6.08
42	000963	华东医药	17,744,717.00	6.07
43	301589	诺瓦星云	17,686,336.60	6.05
44	002414	高德红外	17,630,107.76	6.04
45	300373	扬杰科技	17,345,176.00	5.94
46	000001	平安银行	17,318,135.00	5.93
47	301031	中熔电气	17,299,285.31	5.92
48	601939	建设银行	17,257,785.92	5.91
49	301061	匠心家居	17,187,609.60	5.88
50	002311	海大集团	17,114,841.12	5.86
51	688235	百济神州	16,919,920.42	5.79
52	002128	电投能源	16,862,723.20	5.77
53	000333	美的集团	16,729,613.00	5.73
54	600219	南山铝业	16,691,238.00	5.71
55	301090	华润材料	16,418,174.00	5.62
56	601628	中国人寿	16,164,189.00	5.53
57	300666	江丰电子	16,046,161.00	5.49
58	002318	久立特材	15,854,835.00	5.43
59	000651	格力电器	15,711,707.00	5.38
60	000825	太钢不锈	15,505,870.00	5.31
61	300604	长川科技	15,347,801.00	5.25
62	300777	中简科技	15,273,829.00	5.23
63	603075	热威股份	15,249,357.70	5.22
64	002028	思源电气	15,245,949.62	5.22
65	601066	中信建投	15,213,148.00	5.21
66	000719	中原传媒	15,028,960.80	5.14
67	300850	新强联	14,907,545.00	5.10
68	601456	国联民生	14,898,496.56	5.10
69	002595	豪迈科技	14,881,337.00	5.09
70	603969	银龙股份	14,879,453.00	5.09

71	301367	瑞迈特	14,846,353.00	5.08
72	300567	精测电子	14,706,934.00	5.03
73	301345	涛涛车业	14,690,637.00	5.03
74	301328	维峰电子	14,463,244.00	4.95
75	000709	河钢股份	14,139,891.40	4.84
76	603325	博隆技术	14,100,282.40	4.83
77	301314	科瑞思	14,040,773.42	4.81
78	300681	英搏尔	13,939,685.78	4.77
79	002203	海亮股份	13,844,467.10	4.74
80	603061	金海通	13,815,652.00	4.73
81	002947	恒铭达	13,763,607.00	4.71
82	600958	东方证券	13,652,372.72	4.67
83	600941	中国移动	13,414,675.17	4.59
84	001872	招商港口	13,392,853.00	4.58
85	301165	锐捷网络	13,369,914.40	4.58
86	001286	陕西能源	13,331,538.00	4.56
87	002558	巨人网络	13,233,203.20	4.53
88	301286	侨源股份	13,182,571.00	4.51
89	301577	美信科技	13,176,271.00	4.51
90	300602	飞荣达	12,727,206.00	4.36
91	600015	华夏银行	12,661,213.00	4.33
92	601186	中国铁建	12,559,124.00	4.30
93	301200	大族数控	12,385,008.00	4.24
94	301280	珠城科技	12,372,804.20	4.24
95	601156	东航物流	12,326,396.00	4.22
96	301603	乔锋智能	12,315,619.10	4.22
97	600023	浙能电力	12,243,182.08	4.19
98	300976	达瑞电子	12,116,377.00	4.15
99	000831	中国稀土	12,101,862.00	4.14
100	002252	上海莱士	11,888,499.00	4.07
101	002230	科大讯飞	11,832,419.00	4.05
102	000893	亚钾国际	11,805,299.00	4.04
103	301219	腾远钴业	11,779,053.00	4.03
104	301528	多浦乐	11,775,262.00	4.03
105	301606	绿联科技	11,747,291.00	4.02
106	600061	国投资本	11,705,396.00	4.01
107	300443	金雷股份	11,704,120.27	4.01
108	600016	民生银行	11,664,449.00	3.99
109	601211	国泰海通	11,629,648.00	3.98
110	301220	亚香股份	11,508,888.20	3.94
111	601881	中国银河	11,483,638.00	3.93
112	300502	新易盛	11,405,233.00	3.90
113	002555	三七互娱	11,398,094.00	3.90
114	000783	长江证券	11,379,423.00	3.90

115	300048	合康新能	11,372,655.00	3.89
116	601899	紫金矿业	11,320,019.00	3.88
117	603486	科沃斯	11,260,503.75	3.85
118	301369	联动科技	11,121,609.00	3.81
119	603515	欧普照明	11,121,180.00	3.81
120	301359	东南电子	11,112,604.00	3.80
121	301308	江波龙	11,074,617.06	3.79
122	300408	三环集团	11,030,942.00	3.78
123	601162	天风证券	11,008,844.00	3.77
124	002895	川恒股份	10,897,103.00	3.73
125	300363	博腾股份	10,850,348.00	3.71
126	002511	中顺洁柔	10,704,226.00	3.66
127	300492	华图山鼎	10,702,529.40	3.66
128	002714	牧原股份	10,658,245.00	3.65
129	601328	交通银行	10,616,762.00	3.63
130	301349	信德新材	10,611,894.00	3.63
131	603173	福斯达	10,567,314.00	3.62
132	002948	青岛银行	10,554,775.00	3.61
133	300347	泰格医药	10,512,953.00	3.60
134	300450	先导智能	10,452,679.00	3.58
135	301196	唯科科技	10,412,409.28	3.56
136	688612	威迈斯	10,354,077.94	3.54
137	000807	云铝股份	10,272,351.00	3.52
138	002768	国恩股份	10,106,159.00	3.46
139	000553	安道麦 A	10,104,287.00	3.46
140	300643	万通智控	9,973,846.00	3.41
141	301361	众智科技	9,955,631.00	3.41
142	301095	广立微	9,871,180.00	3.38
143	300724	捷佳伟创	9,847,417.00	3.37
144	301498	乖宝宠物	9,801,278.00	3.36
145	002352	顺丰控股	9,775,482.00	3.35
146	000060	中金岭南	9,764,731.05	3.34
147	002597	金禾实业	9,744,912.00	3.34
148	002142	宁波银行	9,668,954.00	3.31
149	300428	立中集团	9,586,162.00	3.28
150	000878	云南铜业	9,576,352.00	3.28
151	688550	瑞联新材	9,561,290.32	3.27
152	688072	拓荆科技	9,547,692.86	3.27
153	002926	华西证券	9,355,311.00	3.20
154	301107	瑜欣电子	9,350,258.20	3.20
155	001328	登康口腔	9,341,976.94	3.20
156	601108	财通证券	9,287,914.00	3.18
157	002997	瑞鹄模具	9,261,478.00	3.17
158	002939	长城证券	9,230,116.00	3.16

159	000401	金隅冀东	9,108,488.00	3.12
160	002824	和胜股份	9,019,997.19	3.09
161	000898	鞍钢股份	9,014,583.00	3.09
162	001332	锡装股份	8,992,162.85	3.08
163	605198	安德利	8,965,148.00	3.07
164	000988	华工科技	8,955,936.00	3.07
165	603235	天新药业	8,929,868.12	3.06
166	600150	中国船舶	8,927,069.00	3.06
167	301608	博实结	8,915,087.00	3.05
168	601717	中创智领	8,887,653.00	3.04
169	600018	上港集团	8,851,697.37	3.03
170	002871	伟隆股份	8,773,990.00	3.00
171	600378	昊华科技	8,742,388.00	2.99
172	601006	大秦铁路	8,704,273.99	2.98
173	002920	德赛西威	8,702,180.00	2.98
174	600058	五矿发展	8,651,243.00	2.96
175	002532	天山铝业	8,645,235.00	2.96
176	002019	亿帆医药	8,628,701.00	2.95
177	002626	金达威	8,588,308.00	2.94
178	301338	凯格精机	8,517,292.00	2.92
179	600266	城建发展	8,505,947.00	2.91
180	002299	圣农发展	8,442,534.00	2.89
181	002624	完美世界	8,404,195.00	2.88
182	600329	达仁堂	8,337,189.00	2.85
183	301262	海看股份	8,311,759.00	2.85
184	300496	中科创达	8,292,314.00	2.84
185	300973	立高食品	8,204,239.00	2.81
186	301529	福赛科技	8,170,202.00	2.80
187	003019	宸展光电	8,169,884.00	2.80
188	603277	银都股份	8,125,430.00	2.78
189	600938	中国海油	8,122,767.00	2.78
190	301080	百普赛斯	8,094,009.00	2.77
191	301127	武汉天源	8,054,322.00	2.76
192	001389	广合科技	7,987,634.00	2.73
193	300979	华利集团	7,960,335.00	2.73
194	600660	福耀玻璃	7,865,522.00	2.69
195	002683	广东宏大	7,837,837.00	2.68
196	600131	国网信通	7,828,736.00	2.68
197	301548	崇德科技	7,812,768.00	2.67
198	300101	振芯科技	7,784,817.00	2.67
199	600389	江山股份	7,740,422.90	2.65
200	002970	锐明技术	7,703,413.00	2.64
201	301512	智信精密	7,667,878.00	2.62
202	000999	华润三九	7,661,358.00	2.62

203	000050	深天马 A	7,651,741.00	2.62
204	605056	咸亨国际	7,642,687.00	2.62
205	605376	博迁新材	7,588,923.00	2.60
206	000895	双汇发展	7,556,110.00	2.59
207	300953	震裕科技	7,493,585.00	2.57
208	600064	南京高科	7,491,149.22	2.56
209	600795	国电电力	7,481,263.00	2.56
210	002881	美格智能	7,477,609.00	2.56
211	603508	思维列控	7,454,534.80	2.55
212	300756	金马游乐	7,435,686.00	2.55
213	301459	丰茂股份	7,429,814.00	2.54
214	000828	东莞控股	7,387,578.00	2.53
215	300682	朗新集团	7,385,914.00	2.53
216	603019	中科曙光	7,309,661.41	2.50
217	001313	粤海饲料	7,306,497.00	2.50
218	002380	科远智慧	7,297,354.00	2.50
219	603203	快克智能	7,262,618.00	2.49
220	301387	光大同创	7,257,682.00	2.48
221	300119	瑞普生物	7,249,714.00	2.48
222	300984	金沃股份	7,245,852.80	2.48
223	300709	精研科技	7,234,560.00	2.48
224	300926	博俊科技	7,192,034.93	2.46
225	600988	赤峰黄金	7,167,571.00	2.45
226	000927	中国铁物	7,152,143.00	2.45
227	600315	上海家化	7,146,013.00	2.45
228	002353	杰瑞股份	7,113,176.00	2.44
229	605259	绿田机械	7,099,582.00	2.43
230	003006	百亚股份	7,091,633.00	2.43
231	300940	南极光	7,054,822.00	2.42
232	300389	艾比森	7,053,234.00	2.41
233	002847	盐津铺子	7,035,037.00	2.41
234	301097	天益医疗	7,030,182.00	2.41
235	601377	兴业证券	7,022,733.18	2.40
236	001255	博菲电气	7,004,845.00	2.40
237	300889	爱克股份	6,996,610.65	2.40
238	601958	金钼股份	6,990,877.07	2.39
239	688281	华秦科技	6,987,618.52	2.39
240	000778	新兴铸管	6,968,756.00	2.39
241	300409	道氏技术	6,952,782.00	2.38
242	000933	神火股份	6,952,496.00	2.38
243	688041	海光信息	6,952,012.94	2.38
244	603786	科博达	6,944,879.00	2.38
245	601319	中国人保	6,914,694.00	2.37
246	002043	兔宝宝	6,894,520.00	2.36

247	000029	深深房 A	6,812,440.00	2.33
248	002102	能特科技	6,786,469.00	2.32
249	000960	锡业股份	6,736,277.00	2.31
250	603380	易德龙	6,713,676.00	2.30
251	300662	科锐国际	6,709,509.00	2.30
252	688799	华纳药厂	6,702,773.10	2.29
253	301323	新莱福	6,702,512.00	2.29
254	002738	中矿资源	6,699,196.80	2.29
255	601811	新华文轩	6,689,499.00	2.29
256	002246	北化股份	6,669,446.00	2.28
257	001979	招商蛇口	6,660,914.00	2.28
258	002996	顺博合金	6,638,565.80	2.27
259	603236	移远通信	6,605,568.00	2.26
260	000726	鲁泰 A	6,603,885.00	2.26
261	301393	昊帆生物	6,585,869.00	2.25
262	002716	湖南白银	6,552,425.00	2.24
263	301109	军信股份	6,538,844.00	2.24
264	300812	易天股份	6,525,446.00	2.23
265	002649	博彦科技	6,478,496.00	2.22
266	002014	永新股份	6,475,979.00	2.22
267	001222	源飞宠物	6,472,697.00	2.22
268	000157	中联重科	6,442,064.34	2.21
269	300140	节能环境	6,402,906.00	2.19
270	000688	国城矿业	6,398,782.00	2.19
271	002544	普天科技	6,396,974.00	2.19
272	301002	崧盛股份	6,341,835.00	2.17
273	002415	海康威视	6,334,467.00	2.17
274	002967	广电计量	6,312,549.00	2.16
275	001314	亿道信息	6,308,854.00	2.16
276	301105	鸿铭股份	6,282,462.00	2.15
277	301327	华宝新能	6,254,134.80	2.14
278	000429	粤高速 A	6,238,827.00	2.14
279	605305	中际联合	6,228,856.00	2.13
280	001289	龙源电力	6,209,331.00	2.13
281	601169	北京银行	6,183,270.00	2.12
282	603609	禾丰股份	6,163,169.42	2.11
283	002233	塔牌集团	6,160,253.00	2.11
284	001359	平安电工	6,104,887.00	2.09
285	688578	艾力斯	6,100,671.03	2.09
286	601916	浙商银行	6,095,796.00	2.09
287	002603	以岭药业	6,094,470.00	2.09
288	688371	菲沃泰	6,092,199.09	2.09
289	000932	华菱钢铁	6,079,366.00	2.08
290	600519	贵州茅台	6,071,612.00	2.08

291	002821	凯莱英	6,060,258.00	2.07
292	301309	万得凯	6,037,935.09	2.07
293	300870	欧陆通	6,036,973.00	2.07
294	000708	中信特钢	6,030,082.00	2.06
295	000059	华锦股份	6,019,879.20	2.06
296	300770	新媒股份	6,009,708.00	2.06
297	688321	微芯生物	5,989,298.77	2.05
298	300395	菲利华	5,977,153.00	2.05
299	600021	上海电力	5,961,937.00	2.04
300	300893	松原安全	5,951,005.60	2.04
301	301538	骏鼎达	5,903,074.20	2.02
302	688515	裕太微	5,895,763.16	2.02
303	000902	新洋丰	5,882,871.00	2.01
304	300113	顺网科技	5,870,470.00	2.01
305	603737	三棵树	5,843,723.00	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。

#### 8.4.2 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	72,076,887.38	24.67
2	000166	申万宏源	59,198,095.30	20.27
3	601688	华泰证券	47,293,441.02	16.19
4	002001	新和成	36,795,380.40	12.60
5	601318	中国平安	36,402,684.13	12.46
6	301035	润丰股份	33,386,762.00	11.43
7	601995	中金公司	32,136,512.00	11.00
8	000725	京东方 A	30,173,796.00	10.33
9	000538	云南白药	27,750,779.10	9.50
10	603858	步长制药	27,577,821.00	9.44
11	300476	胜宏科技	27,322,087.00	9.35
12	601061	中信金属	24,794,061.00	8.49
13	301233	盛帮股份	24,664,431.00	8.44
14	002545	东方铁塔	24,242,083.00	8.30
15	000630	铜陵有色	24,229,815.00	8.29
16	002736	国信证券	23,973,947.00	8.21
17	000728	国元证券	23,775,861.00	8.14
18	601668	中国建筑	23,479,012.00	8.04
19	002803	吉宏股份	23,331,017.00	7.99
20	601901	方正证券	23,322,753.00	7.98
21	603379	三美股份	23,059,024.00	7.89

22	300999	金龙鱼	22,263,144.00	7.62
23	600999	招商证券	22,066,935.00	7.55
24	600926	杭州银行	21,811,195.16	7.47
25	000408	藏格矿业	21,743,619.00	7.44
26	002371	北方华创	21,645,570.00	7.41
27	000792	盐湖股份	21,232,021.00	7.27
28	000623	吉林敖东	20,369,651.60	6.97
29	300866	安克创新	19,346,044.10	6.62
30	601868	中国能建	19,324,606.00	6.62
31	001223	欧克科技	19,212,954.80	6.58
32	001238	浙江正特	19,184,529.00	6.57
33	603979	金诚信	19,135,413.00	6.55
34	002236	大华股份	19,082,075.00	6.53
35	002487	大金重工	18,583,403.00	6.36
36	301061	匠心家居	18,512,758.32	6.34
37	002396	星网锐捷	18,387,748.00	6.29
38	601390	中国中铁	18,195,227.00	6.23
39	601336	新华保险	18,098,050.00	6.20
40	000963	华东医药	17,840,709.00	6.11
41	603160	汇顶科技	17,526,497.00	6.00
42	600219	南山铝业	17,492,986.10	5.99
43	300666	江丰电子	17,492,607.00	5.99
44	601939	建设银行	17,437,403.20	5.97
45	002128	电投能源	17,300,786.40	5.92
46	300604	长川科技	17,262,661.00	5.91
47	301165	锐捷网络	17,245,172.79	5.90
48	301031	中熔电气	16,736,157.78	5.73
49	002028	思源电气	16,606,811.34	5.69
50	000825	太钢不锈	16,350,022.00	5.60
51	002414	高德红外	16,313,022.24	5.58
52	688235	百济神州	16,052,483.64	5.50
53	000001	平安银行	15,957,205.00	5.46
54	301090	华润材料	15,955,579.00	5.46
55	000333	美的集团	15,922,290.00	5.45
56	301286	侨源股份	15,820,687.00	5.42
57	301367	瑞迈特	15,481,987.08	5.30
58	601066	中信建投	15,453,313.00	5.29
59	002230	科大讯飞	15,424,201.84	5.28
60	000651	格力电器	15,353,257.00	5.26
61	300567	精测电子	15,331,752.49	5.25
62	300373	扬杰科技	15,241,072.00	5.22
63	603075	热威股份	15,130,989.46	5.18
64	603061	金海通	15,090,228.00	5.17
65	300777	中简科技	15,055,395.00	5.15

66	000719	中原传媒	14,836,103.60	5.08
67	002318	久立特材	14,800,568.00	5.07
68	601456	国联民生	14,745,050.22	5.05
69	603444	吉比特	14,611,271.00	5.00
70	002947	恒铭达	14,559,622.30	4.98
71	301345	涛涛车业	14,444,717.00	4.94
72	603325	博隆技术	14,387,023.60	4.93
73	301107	瑜欣电子	14,253,548.00	4.88
74	603969	银龙股份	14,184,963.00	4.86
75	301314	科瑞思	14,174,216.69	4.85
76	001332	锡装股份	14,152,607.60	4.84
77	002203	海亮股份	14,108,026.00	4.83
78	600016	民生银行	13,934,349.00	4.77
79	301328	维峰电子	13,930,799.00	4.77
80	300976	达瑞电子	13,798,983.40	4.72
81	600958	东方证券	13,778,633.96	4.72
82	000709	河钢股份	13,729,129.37	4.70
83	301200	大族数控	13,619,963.00	4.66
84	002595	豪迈科技	13,546,872.00	4.64
85	301589	诺瓦星云	13,475,586.00	4.61
86	300602	飞荣达	13,275,957.00	4.54
87	301577	美信科技	13,124,660.00	4.49
88	001872	招商港口	12,812,039.00	4.39
89	601186	中国铁建	12,533,493.00	4.29
90	002558	巨人网络	12,365,956.00	4.23
91	601628	中国人寿	12,324,382.00	4.22
92	301359	东南电子	12,305,657.20	4.21
93	300443	金雷股份	12,269,404.48	4.20
94	300850	新强联	12,251,306.00	4.19
95	301280	珠城科技	12,140,923.20	4.16
96	001286	陕西能源	12,086,423.00	4.14
97	600061	国投资本	11,975,094.00	4.10
98	002252	上海莱士	11,923,804.00	4.08
99	600015	华夏银行	11,863,074.00	4.06
100	300048	合康新能	11,829,514.00	4.05
101	000831	中国稀土	11,719,622.00	4.01
102	002714	牧原股份	11,657,760.00	3.99
103	002352	顺丰控股	11,598,889.00	3.97
104	002555	三七互娱	11,592,260.00	3.97
105	000060	中金岭南	11,375,657.00	3.89
106	600023	浙能电力	11,349,820.00	3.89
107	301220	亚香股份	11,330,005.60	3.88
108	300502	新易盛	11,198,201.00	3.83
109	002895	川恒股份	11,185,872.00	3.83

110	300492	华图山鼎	11,149,050.72	3.82
111	301369	联动科技	11,111,625.00	3.80
112	601211	国泰海通	10,999,124.00	3.77
113	601156	东航物流	10,937,893.00	3.74
114	002948	青岛银行	10,899,254.00	3.73
115	300450	先导智能	10,754,402.74	3.68
116	300724	捷佳伟创	10,690,949.00	3.66
117	300811	铂科新材	10,602,447.15	3.63
118	000893	亚钾国际	10,587,468.00	3.62
119	601328	交通银行	10,587,269.00	3.62
120	301283	聚胶股份	10,577,150.00	3.62
121	300347	泰格医药	10,549,497.00	3.61
122	603515	欧普照明	10,436,649.00	3.57
123	002939	长城证券	10,423,670.00	3.57
124	601162	天风证券	10,345,059.00	3.54
125	301361	众智科技	10,328,160.00	3.54
126	301196	唯科科技	10,316,412.50	3.53
127	603173	福斯达	10,305,152.00	3.53
128	301308	江波龙	10,240,801.00	3.51
129	301498	乖宝宠物	10,061,995.00	3.44
130	300408	三环集团	10,008,402.42	3.43
131	301606	绿联科技	9,900,643.16	3.39
132	002970	锐明技术	9,898,538.00	3.39
133	601881	中国银河	9,830,693.00	3.37
134	002511	中顺洁柔	9,807,983.00	3.36
135	301095	广立微	9,793,215.00	3.35
136	601899	紫金矿业	9,771,779.00	3.35
137	002311	海大集团	9,765,046.00	3.34
138	688072	拓荆科技	9,692,783.25	3.32
139	603486	科沃斯	9,689,314.00	3.32
140	002597	金禾实业	9,620,056.00	3.29
141	688550	瑞联新材	9,616,044.97	3.29
142	002881	美格智能	9,588,378.00	3.28
143	301327	华宝新能	9,566,384.62	3.27
144	000807	云铝股份	9,563,629.00	3.27
145	002926	华西证券	9,370,882.00	3.21
146	002997	瑞鹄模具	9,348,880.00	3.20
147	001328	登康口腔	9,319,119.03	3.19
148	300643	万通智控	9,310,814.00	3.19
149	000401	金隅冀东	9,288,190.00	3.18
150	600058	五矿发展	9,278,918.00	3.18
151	002019	亿帆医药	9,264,890.00	3.17
152	000783	长江证券	9,180,688.00	3.14
153	301349	信德新材	9,125,155.00	3.12

154	002920	德赛西威	9,076,178.00	3.11
155	000878	云南铜业	8,938,115.00	3.06
156	000553	安道麦 A	8,924,583.62	3.06
157	600150	中国船舶	8,865,226.00	3.03
158	002871	伟隆股份	8,840,083.00	3.03
159	600018	上港集团	8,767,610.11	3.00
160	301338	凯格精机	8,722,057.00	2.99
161	601006	大秦铁路	8,718,646.08	2.98
162	603235	天新药业	8,608,013.90	2.95
163	300979	华利集团	8,602,590.00	2.94
164	002532	天山铝业	8,584,436.00	2.94
165	600266	城建发展	8,531,741.00	2.92
166	001389	广合科技	8,500,827.00	2.91
167	605198	安德利	8,475,812.00	2.90
168	601916	浙商银行	8,467,103.00	2.90
169	301528	多浦乐	8,457,123.00	2.90
170	002626	金达威	8,437,440.00	2.89
171	603277	银都股份	8,376,108.50	2.87
172	600236	桂冠电力	8,348,391.00	2.86
173	301262	海看股份	8,287,727.49	2.84
174	605376	博迁新材	8,259,960.00	2.83
175	301127	武汉天源	8,259,692.60	2.83
176	002768	国恩股份	8,235,483.00	2.82
177	600389	江山股份	8,206,068.90	2.81
178	002683	广东宏大	8,194,526.00	2.81
179	002299	圣农发展	8,130,491.00	2.78
180	300973	立高食品	8,113,526.00	2.78
181	300870	欧陆通	8,052,039.00	2.76
182	300101	振芯科技	8,050,363.00	2.76
183	301219	腾远钴业	8,000,329.00	2.74
184	000988	华工科技	7,946,798.00	2.72
185	600131	国网信通	7,857,912.00	2.69
186	688612	威迈斯	7,808,058.52	2.67
187	600988	赤峰黄金	7,750,014.81	2.65
188	600037	歌华有线	7,734,163.00	2.65
189	300389	艾比森	7,694,268.00	2.63
190	600064	南京高科	7,690,750.73	2.63
191	002624	完美世界	7,689,444.00	2.63
192	002824	和胜股份	7,635,886.00	2.61
193	603786	科博达	7,626,101.90	2.61
194	301529	福赛科技	7,621,240.00	2.61
195	601811	新华文轩	7,617,512.60	2.61
196	002738	中矿资源	7,597,843.80	2.60
197	600660	福耀玻璃	7,563,419.00	2.59

198	002353	杰瑞股份	7,562,228.00	2.59
199	603508	思维列控	7,546,829.60	2.58
200	601319	中国人保	7,475,192.00	2.56
201	301459	丰茂股份	7,455,901.80	2.55
202	300869	康泰医学	7,450,278.00	2.55
203	000999	华润三九	7,450,102.73	2.55
204	301393	昊帆生物	7,448,063.00	2.55
205	000927	中国铁物	7,438,940.00	2.55
206	001313	粤海饲料	7,377,979.00	2.53
207	601717	中创智领	7,359,725.00	2.52
208	301512	智信精密	7,356,895.00	2.52
209	003019	宸展光电	7,339,539.00	2.51
210	000050	深天马 A	7,331,023.00	2.51
211	605259	绿田机械	7,258,641.00	2.48
212	300889	爱克股份	7,251,502.65	2.48
213	603609	禾丰股份	7,240,742.70	2.48
214	301097	天益医疗	7,239,919.00	2.48
215	300682	朗新集团	7,232,460.00	2.48
216	001979	招商蛇口	7,200,271.00	2.46
217	300119	瑞普生物	7,188,163.00	2.46
218	300984	金沃股份	7,182,172.07	2.46
219	603203	快克智能	7,105,884.00	2.43
220	300363	博腾股份	7,102,471.00	2.43
221	300454	深信服	7,096,450.00	2.43
222	000828	东莞控股	7,078,041.00	2.42
223	600315	上海家化	7,056,489.22	2.42
224	301387	光大同创	7,036,837.00	2.41
225	600704	物产中大	7,027,205.00	2.41
226	001255	博菲电气	6,972,546.00	2.39
227	002847	盐津铺子	6,969,092.00	2.39
228	000960	锡业股份	6,953,236.00	2.38
229	601377	兴业证券	6,933,478.45	2.37
230	300940	南极光	6,931,709.00	2.37
231	300812	易天股份	6,910,154.00	2.37
232	601288	农业银行	6,850,109.00	2.35
233	003006	百亚股份	6,843,551.00	2.34
234	300709	精研科技	6,808,790.00	2.33
235	002142	宁波银行	6,776,299.00	2.32
236	600519	贵州茅台	6,766,709.00	2.32
237	301323	新莱福	6,750,156.04	2.31
238	688799	华纳药厂	6,700,612.68	2.29
239	002649	博彦科技	6,691,694.00	2.29
240	002996	顺博合金	6,664,222.00	2.28
241	600795	国电电力	6,662,020.00	2.28

242	603380	易德龙	6,657,353.00	2.28
243	002544	普天科技	6,628,141.00	2.27
244	000029	深深房 A	6,615,626.00	2.26
245	002967	广电计量	6,609,642.00	2.26
246	002102	能特科技	6,606,439.00	2.26
247	000688	国城矿业	6,604,390.00	2.26
248	000429	粤高速 A	6,565,738.00	2.25
249	002821	凯莱英	6,561,472.00	2.25
250	002716	湖南白银	6,550,891.00	2.24
251	300496	中科创达	6,511,258.00	2.23
252	600329	达仁堂	6,482,411.00	2.22
253	300395	菲利华	6,478,245.00	2.22
254	000932	华菱钢铁	6,476,094.00	2.22
255	000726	鲁泰 A	6,449,247.00	2.21
256	601169	北京银行	6,447,027.00	2.21
257	001314	亿道信息	6,438,102.00	2.20
258	301105	鸿铭股份	6,397,931.00	2.19
259	000895	双汇发展	6,361,475.00	2.18
260	300442	润泽科技	6,343,438.00	2.17
261	603236	移远通信	6,329,772.00	2.17
262	001222	源飞宠物	6,312,301.00	2.16
263	301608	博实结	6,306,867.40	2.16
264	300756	金马游乐	6,294,231.00	2.15
265	001289	龙源电力	6,273,525.00	2.15
266	301080	百普赛斯	6,247,041.00	2.14
267	300681	英搏尔	6,218,647.38	2.13
268	600938	中国海油	6,210,603.00	2.13
269	301002	崧盛股份	6,210,340.00	2.13
270	301109	军信股份	6,196,947.00	2.12
271	688578	艾力斯	6,164,271.88	2.11
272	603680	今创集团	6,155,411.00	2.11
273	300765	新诺威	6,140,905.00	2.10
274	300696	爱乐达	6,102,932.00	2.09
275	001359	平安电工	6,087,160.00	2.08
276	002233	塔牌集团	6,071,058.00	2.08
277	300054	鼎龙股份	6,070,515.00	2.08
278	605305	中际联合	6,027,479.00	2.06
279	002797	第一创业	6,022,174.00	2.06
280	300409	道氏技术	6,008,032.00	2.06
281	300684	中石科技	6,007,870.00	2.06
282	002603	以岭药业	5,999,336.00	2.05
283	300770	新媒股份	5,986,633.00	2.05
284	300634	彩讯股份	5,975,167.00	2.05
285	603737	三棵树	5,935,172.20	2.03

286	002014	永新股份	5,890,490.00	2.02
287	002978	安宁股份	5,850,659.00	2.00

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。

#### 8.4.3 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	7,267,699,128.94
卖出股票收入（成交）总额	6,987,867,056.67

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。

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	70,181.80	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	70,181.80	0.01

#### 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	123263	鼎捷转债	484	70,181.80	0.01
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

#### 8.7 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。

#### 8.8 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。

8.9 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。

8.10 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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 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。

8.11.2 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。

8.12 本报告期投资基金情况

8.12.1 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。

8.13 投资组合报告附注

8.13.1 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、招商证券股份有限公司、新华人寿保险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。

8.13.2 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。

8.13.3 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	577,730.83
2	应收清算款	2,581,944.24
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,763,182.45
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,922,857.52

8.13.4 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。

8.13.5 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。

### 8.13.6 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。

## §9 基金份额持有人信息

### 9.1 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 A	18,808	10,396.72	37,657,509.18	19.26%	157,883,952.27	80.74%
华夏智胜价值成长股票 C	26,009	5,587.52	53,822,111.92	37.04%	91,503,786.05	62.96%
合计	44,817	7,605.76	91,479,621.10	26.84%	249,387,738.32	73.16%

注：本章节持有人户数合计按份额级别汇总，未予以合并别重。

### 9.2 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	523,009.58	0.27%
	华夏智胜价值成长股票 C	4,011.63	0.00%
	合计	527,021.21	0.15%

### 9.3 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

9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况

基金经理姓名	产品类型	持有本人管理的产品份额总量的数量区间（万份）
孙蒙	公募基金	50~100
	私募资产管理计划	0
	合计	50~100

9.5 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。

## §10 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	231,362,899.59	311,358,448.33
减：本报告期基金总赎回份额	164,770,661.91	224,570,713.23
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	195,541,461.45	145,325,897.97

## §11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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，邹迎光先生担任本基金管理人董事长，李一梅女士担任本基金管理人副董事长，张佑君先生离任本基金管理人董事长。

本报告期内，基金托管人无重大人事变动。

11.3 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。

#### 11.4 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。

#### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期应支付给毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为 32,900.00 元人民币。截至本报告期末，该事务所已向本基金提供 2 年的审计服务。

#### 11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

##### 11.6.1 管理人受调查或处罚等情况

管理人受调查或处罚等情况	内容
受到调查或处罚等措施的主体	华夏基金管理有限公司
受到调查或处罚等措施的时间	2025 年 11 月 4 日
采取调查或处罚等措施的机构	中国证监会北京监管局
受到调查或处罚等措施类型	行政监管措施
受到的具体措施类型	出具警示函
受到调查或处罚等措施的原因	人员管理、其他问题（内部控制、销售管理等）
受到处罚的依据	《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》《公开募集证券投资基金运作管理办法》《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》《证券发行与承销管理办法(2018 年修订)》《公开募集证券投资基金宣传推介材料管理暂行规定》《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》《证券期货经营机构及其工作人员廉洁从业规定》《证券基金经营机构信息技术管理办法(2021 年修正)》《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》《证券公司和证券投资基金管理公司境外设立、收购、参股经营机构管理办法(2021 年修正)》
管理人采取整改措施的情况(如提出整改意见)	基金管理人高度重视，从业务改进、制度优化、培训宣贯等方面进行了整改，现已完成全部整改工作，并向监管机构报送整改报告。
其他	无

##### 11.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

管理人相关从业人员受调查或处罚等情况	内容
受到调查或处罚等措施的主体	高级管理人员
受到调查或处罚等措施的时间	2025 年 12 月 26 日
采取调查或处罚等措施的机构	中国证监会北京监管局

受到调查或处罚等措施类型	行政监管措施
受到的具体措施类型	出具警示函
受到调查或处罚等措施的原因	人员管理、其他问题（内部控制、销售管理等）
受到处罚的依据	《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	基金管理人高度重视，从业务改进、制度优化、培训宣贯等方面进行了整改，现已完成全部整改工作，并向监管机构报送整改报告。
其他	无

### 11.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人没有受到监管部门调查或处罚。

### 11.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人相关从业人员没有受到监管部门调查或处罚。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 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	6,081,247,090.95	42.67%	583,206.97	42.67%	-
国金证券	2	2,091,901,685.98	14.68%	200,604.03	14.68%	-
兴业证券	1	1,516,397,178.68	10.64%	145,446.85	10.64%	-
中泰证券	1	1,417,157,082.90	9.94%	135,873.40	9.94%	-
国泰海通证券	2	845,695,329.80	5.93%	81,113.75	5.94%	-
国信证券	1	733,398,532.58	5.15%	70,335.14	5.15%	-
西部证券	1	588,557,113.08	4.13%	56,457.72	4.13%	-
中信建投证券	3	523,328,088.29	3.67%	50,166.75	3.67%	-
中金公司	6	428,983,164.15	3.01%	41,142.61	3.01%	-
方正证券	2	24,180,767.99	0.17%	2,321.69	0.17%	-
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、光大证券、广发证券、国海证券、国联民生证券、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，第一创业证券的部分交易单元为本期剔除的交易单元。

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”。

#### 11.7.2 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	32,324.40	0.08%	-	-	-	-	-	-
国金证券	27,980,880.00	67.42%	-	-	-	-	-	-
兴业证券	8,773.17	0.02%	-	-	-	-	-	-
中泰证券	12,022,963.60	28.97%	-	-	-	-	-	-

国泰海通证 券	8,943.20	0.02%	-	-	-	-	-	-
国信证券	16,465.32	0.04%	-	-	-	-	-	-
西部证券	29,921.50	0.07%	-	-	-	-	-	-
中信建投证 券	1,399,148.00	3.37%	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-

## 11.8 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
5	华夏基金管理有限公司公告	中国证监会规定报刊及网站	2025-07-11
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	2025-07-11
7	华夏基金管理有限公司关于设立北京华夏金科信息服务有限公司的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025-08-06
8	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	2025-09-22
9	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025-09-25
10	华夏基金管理有限公司公告	中国证监会规定报刊及网站	2025-10-01
11	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025-10-23
12	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025-11-27
13	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025-12-12
14	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	2025-12-25
15	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	2025-12-26

## §12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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。

## §13 备查文件目录

### 13.1 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。

### 13.2 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。

### 13.3 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

二〇二六年三月三十一日