

华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金
2026 年中期报告
2026 年 6 月 30 日

基金管理人：华夏基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：二〇二六年八月三十一日

§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。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 8 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	14
§6 中期报告财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	18
§7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	40
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	67
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	70
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	70
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	70
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	70
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	70
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	70
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	70
7.12 本报告期投资基金情况	70
7.13 投资组合报告附注	70

§8 基金份额持有人信息	71
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	71
8.2 盈利投资者数量占比	72
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	72
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	72
8.5 发起式基金发起资金持有份额情况	72
§9 开放式基金份额变动	73
§10 重大事件揭示	73
10.1 基金份额持有人大会决议	73
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	73
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	73
10.4 基金投资策略的改变	73
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	73
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	73
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	74
10.8 其他重大事件	75
§11 影响投资者决策的其他重要信息	76
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	76
§12 备查文件目录	76
12.1 备查文件目录	76
12.2 存放地点	76
12.3 查阅方式	76

§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	293,535,548.20 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	187,063,852.78 份	106,471,695.42 份

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华夏基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李彬	张姗
	联系电话	400-818-6666	400-61-95555

	电子邮箱	service@ChinaAMC.com	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		400-818-6666	400-61-95555
传真		010-63136700	0755-83195201
注册地址		北京市顺义区安庆大街甲3号院	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》
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.ChinaAMC.com
基金中期报告置备地点	基金管理人和/或基金托管人的住所/办公地址

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	华夏基金管理有限公司	北京市朝阳区北辰西路6号院北辰中心C座5层

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2026年1月1日-2026年6月30日）	
	华夏智胜价值成长股票 A	华夏智胜价值成长股票 C
本期已实现收益	55,928,467.96	37,551,940.63
本期利润	50,229,738.35	31,863,653.20
加权平均基金份额本期利润	0.2398	0.2182
本期加权平均净值利润率	10.27%	9.51%
本期基金份额净值增长率	11.42%	11.29%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2026年6月30日）	
	华夏智胜价值成长股票 A	华夏智胜价值成长股票 C
期末可供分配利润	235,198,849.68	129,948,857.42

期末可供分配基金份额利润	1.2573	1.2205
期末基金资产净值	456,327,398.32	255,549,448.63
期末基金份额净值	2.4394	2.4002
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2026年6月30日）	
	华夏智胜价值成长股票 A	华夏智胜价值成长股票 C
基金份额累计净值增长率	152.66%	165.27%

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	12.25%	1.44%	17.61%	1.56%	-5.36%	-0.12%
过去六个月	11.42%	1.42%	19.93%	1.58%	-8.51%	-0.16%
过去一年	37.09%	1.18%	49.68%	1.35%	-12.59%	-0.17%
过去三年	55.44%	1.35%	48.15%	1.41%	7.29%	-0.06%
过去五年	70.67%	1.26%	42.07%	1.29%	28.60%	-0.03%
过去七年	177.24%	1.25%	74.66%	1.23%	102.58%	0.02%
自基金转型起至今	152.66%	1.27%	66.49%	1.24%	86.17%	0.03%

华夏智胜价值成长股票 C：

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	12.19%	1.44%	17.61%	1.56%	-5.42%	-0.12%
过去六个月	11.29%	1.42%	19.93%	1.58%	-8.64%	-0.16%
过去一年	36.75%	1.18%	49.68%	1.35%	-12.93%	-0.17%
过去三年	54.27%	1.35%	48.15%	1.41%	6.12%	-0.06%

过去五年	68.54%	1.26%	42.07%	1.29%	26.47%	-0.03%
2019 年 12 月 24 日起至今	165.27%	1.28%	70.30%	1.25%	94.97%	0.03%

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 2026 年 6 月 30 日)

华夏智胜价值成长股票 A:



华夏智胜价值成长股票 C:



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。

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。

§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、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、首批公募 REITs 指数基金管理人，境内首家承诺“碳中和”具体目标和路径的公募基金公司，香港子公司是首批 RQFII 基金管理人。华夏基金是业务领域最广泛的基金管理公司之一。

华夏基金是境内 ETF 基金资产管理规模最大的基金管理公司之一，在 ETF 基金管理方面积累了丰富的经验，形成了覆盖宽基指数、港股（QDII）指数、港股（港股通）指数、行业主题指数、策略指数、跨境指数、固收指数、商品指数等较为完整的产品线。

华夏基金以深入的投资研究为基础，尽力捕捉市场机会，为投资人谋求良好的回报。根据银河证券基金研究中心《中国基金业绩评价报告》，截至 2026 年 6 月 30 日，华夏基金旗下多只产品近 1 年同类排名靠前（基金排名不作为产品未来表现的保证）：

主动权益产品：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）(A 类)排名第 1/25；在低碳环保行业股票型基金(A 类)中，华夏节能环保股票(A 类)排名第 1/10；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(A 类)排名第 2/64；在低碳环保偏股型基金(A 类)中，华夏低碳经济一年持有混合(A 类)排名第 3/32；在债券型 FOF(A 类)中，华夏聚顺优选六个月持有债券（FOF）(A 类)排名第 3/24；在养老目标日期 FOF(2045)(A 类)中，华夏养老 2045 三年持有混合（FOF）(A 类)排名第 3/18；在养老目标日期 FOF(2050)(A 类)中，华夏养老 2050 五年持有混合（FOF）(A 类)排名第 3/15；在 QDII 混合基金(A 类)中，华夏移动互联混合（QDII）排名第 3/56、华夏新时代混合（QDII）排名第 5/56、华夏全球科技先锋混合（QDII）排名第 7/56；在偏股型基金(股票上限 80%)(A 类)中，华夏成长混合排名第 13/149；在医药医疗健康行业偏股型基金(A 类)中，华夏乐享健康混合(A 类)排名第 15/89；在偏股型基金(股票上限 95%)(A 类)中，华夏线上经济主题精选混合排名第 25/220；在标准股票型基金(A 类)中，华夏创新前沿股票(A 类)排名第 43/354、华夏领先股票排名第 49/354、华夏经济转型股票排名第 57/354、华夏潜龙精选股票排名第 66/354；在灵活配置型基金(基准股票比例 30%-60%)(A 类)中，华夏磐晟混合（LOF）排名第 35/397、华夏新锦程混合(A 类)排名第 62/397、华夏稳增混合排名第 79/397；在灵活配置型基金(基准股票比例 60%-100%)(A 类)中，华夏高端制造混合(A 类)排名第 36/478；在偏股型基金(股票上下限 60%-95%)(A 类)中，华夏先进制造龙头混合(A 类)排名第 23/1941、华夏科技创新混合(A 类)排名第 78/1941、华夏成长先锋一年持有混合(A 类)排名第 116/1941、华夏核心科技 6 个月定开混合(A 类)排名第 191/1941、华夏产业升级混合(A 类)排名第 212/1941、华夏国企创新混合发起式（A 类）排名第 249/1941、华夏成长机会一年持有混合排名第 268/1941、华夏创业板两年定开混合排名第 276/1941、华夏盛世混合排名第 292/1941、华夏创新驱动混合(A 类)排名第 365/1941、华夏科技前沿 6 个月定开混合(A 类)排名第 372/1941、华夏行业景气混合(A 类)排名第 374/1941。

固收与固收+产品：在可转换债券型基金(A 类)中，华夏可转债增强债券 A 排名第 1/38；在普通债券型基金(可投转债)(A 类)中，华夏双债债券 A 排名第 1/280、华夏聚利债券 A 排名第 4/280、华夏债券 AB 排名第 74/280；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 A

排名第 2/307、华夏兴源稳健一年持有混合 A 排名第 17/307、华夏永顺一年持有混合 A 排名第 31/307；在短期纯债债券型基金(A 类)中，华夏安益短债债券 A 排名第 7/133、华夏 30 天滚动短债债券发起式 A 排名第 8/133；在利率债纯债债券型基金(A 类)中，华夏鼎昭利率债债券 A 排名第 7/98；在普通债券型基金(二级)(A 类)中，华夏鼎沛债券 A 排名第 10/540、华夏鼎清债券 A 排名第 12/540、华夏鼎利债券 A 排名第 47/540；在普通偏债型基金(股票上限高于 30%)(A 类)中，华夏永鑫六个月持有混合 A 排名第 17/245、华夏永泓一年持有混合 A 排名第 28/245；在长期纯债债券型基金(A 类)中，华夏鼎富债券 A 排名第 61/1041、华夏鼎航债券 A 排名第 67/1041、华夏鼎信债券 A 排名第 115/1041、华夏纯债债券 A 排名第 234/1041、华夏鼎茂债券 A 排名第 268/1041；在标准偏债型基金(股票上下限 10%-30%)(A 类)中，华夏稳进增益一年持有混合 A 排名第 11/71。

在客户服务方面，2026 年上半年，华夏基金继续以客户需求为导向，努力提高客户使用的便利性和服务体验：（1）华夏基金管家客户端优化基金详情展示，增强信息可读性，从客户投资需求出发，进一步提升使用体验；（2）与国贸期货、新华信通等代销机构合作，拓展更加丰富的客户理财渠道；（3）开展“未来，我们继续一起走过”、“选择难度大？给你支个招”、“当前科技股的三国博弈”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、投委会成员	2020-03-17	-	12 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	-	9 年	博士。2017 年 7 月加入华夏基金管理有限公司。历任研究员、基金经理助理。

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。

③根据本基金管理人发布的调整基金经理公告，自 2026 年 7 月 14 日起，叶津佐先生担任本基金的基金经理，孙蒙先生不再担任本基金基金经理。

④自 2026 年 7 月 14 日起，叶津佐先生不再担任本基金基金经理助理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《基金管理公司开展投资、研究活动防控内幕交易指导意见》等法律法规和基金合同，本着诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在严格控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《华夏基金管理有限公司公平交易制度》的规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，本基金管理人旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 45 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

2026 年上半年，全球经济在地缘冲突扰动和 AI 基建加速两条主线影响下呈现 K 型分化。油价先扬后抑、上半年中枢较去年四季度整体上移，叠加地缘风险溢价，推高全球通胀压力并影响传统经济复苏；AI Agent 驱动下 AI 产业链投资构建增长核心动能。主要经济体受供给冲击和需求韧性差异表现分化，货币政策由前期宽松转向“按兵不动+紧缩预期”并明显分化。国内方面，十五五开局之年延续高质量发展趋势，上半年保持一定增长韧性，物价呈结构性复苏，输入型通胀特征显现；

货币政策保持适度宽松，但 M2、社融增速边际回落；总体供强需弱矛盾突出、经济向好基础仍需巩固。

市场方面，2026 年上半年 A 股在科技主线引领下延续宽幅震荡上行、呈现标准 K 型结构性牛市特征，指数分层显著。行业层面呈现分化，31 个申万一级行业仅约 10 个上涨，电子、通信、建筑材料、机械设备等 AI 相关行业领涨，而商贸零售、农林牧渔、美容护理、食品饮料、医药生物等消费医药内需行业表现落后。市场风格方面，受成长板块基本面优势领先、AI/算力产业链远期景气预期上修及流动性宽松环境等因素影响，成长风格相对价值风格的超额收益极为突出，期间量化策略整体表现出现分化。

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 2026 年 6 月 30 日，华夏智胜价值成长股票 A 基金份额净值为 2.4394 元，本报告期份额净值增长率为 11.42%；华夏智胜价值成长股票 C 基金份额净值为 2.4002 元，本报告期份额净值增长率为 11.29%，同期业绩比较基准增长率为 19.93%。

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 年上半年，A 股市场行情分化比较大，AI 科技相关主题上涨，而其他行业股票大部分下跌。不管是从基本面角度，还是从交易结构看，相关主题行情已经走向过热阶段。展望下半年，科技板块继续大幅上涨可能性较小，市场较大可能迎来行业或者风格上的再平衡，建议均衡配置。

珍惜基金份额持有人的每一分投资和每一份信任，本基金将继续奉行华夏基金管理有限公司“为信任奉献回报”的经营理念，规范运作，审慎投资，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求长期、稳定的回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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。

本中期报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§6 中期报告财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	45,923,059.74	55,540,146.68
结算备付金		8,296,082.06	7,606,062.61
存出保证金		696,270.94	577,730.83
交易性金融资产	6.4.7.2	664,458,948.16	692,983,951.22

其中：股票投资		664,458,948.16	692,913,769.42
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	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		16,934,992.67	2,581,944.24
应收股利		-	-
应收申购款		561,982.41	1,763,182.45
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		736,871,335.98	761,053,018.03
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		12,142,122.22	1,084,901.72
应付赎回款		10,786,748.67	16,737,619.25
应付管理人报酬		624,450.88	622,371.00
应付托管费		124,890.17	124,474.19
应付销售服务费		57,827.93	63,476.16
应付投资顾问费		-	-
应交税费		21,475.98	1,503.19
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	1,236,973.18	856,759.08

负债合计		24,994,489.03	19,491,104.59
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	293,535,548.20	340,867,359.42
未分配利润	6.4.7.8	418,341,298.75	400,694,554.02
净资产合计		711,876,846.95	741,561,913.44
负债和净资产总计		736,871,335.98	761,053,018.03

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，华夏智胜价值成长股票 A 基金份额净值 2.4394 元，华夏智胜价值成长股票 C 基金份额净值 2.4002 元；华夏智胜价值成长股票基金份额总额 293,535,548.20 份（其中 A 类 187,063,852.78 份，C 类 106,471,695.42 份）。

6.2 利润表

会计主体：华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		87,513,765.25	34,556,315.28
1.利息收入		115,698.66	34,458.20
其中：存款利息收入	6.4.7.9	115,698.66	34,458.20
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）		97,697,130.30	21,634,910.96
其中：股票投资收益	6.4.7.1 0	92,391,106.58	18,836,229.85
基金投资收益	6.4.7.1 1	-	-
债券投资收益	6.4.7.1 2	186,255.04	11,034.58
资产支持证券投资收益	6.4.7.1 3	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.1 4	-	-

衍生工具收益	6.4.7.1 5	638,934.75	26,714.44
股利收益	6.4.7.1 6	4,480,833.93	2,760,932.09
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.1 7	-11,387,017.04	12,798,365.29
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.1 8	1,087,953.33	88,580.83
减：二、营业总支出		5,420,373.70	1,734,271.22
1.管理人报酬		4,095,101.44	1,293,471.42
2.托管费		819,020.27	258,694.26
3.销售服务费		416,748.83	103,430.06
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.信用减值损失	6.4.7.2 0	-	-
7.税金及附加		2,301.08	127.66
8.其他费用	6.4.7.2 1	87,202.08	78,547.82
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		82,093,391.55	32,822,044.06
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		82,093,391.55	32,822,044.06
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		82,093,391.55	32,822,044.06

6.3 净资产变动表

会计主体：华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
----	---------------------------------------

	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	340,867,359.42	400,694,554.02	741,561,913.44
二、本期期初净资产	340,867,359.42	400,694,554.02	741,561,913.44
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-47,331,811.22	17,646,744.73	-29,685,066.49
（一）、综合收益总额	-	82,093,391.55	82,093,391.55
（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）	-47,331,811.22	-64,446,646.82	-111,778,458.04
其中：1.基金申购款	256,350,602.65	338,396,351.94	594,746,954.59
2.基金赎回款	-303,682,413.87	-402,842,998.76	-706,525,412.63
（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	293,535,548.20	418,341,298.75	711,876,846.95
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	187,487,386.64	104,625,310.53	292,112,697.17
二、本期期初净资产	187,487,386.64	104,625,310.53	292,112,697.17
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-33,937,349.97	13,783,257.72	-20,154,092.25
（一）、综合收益总额	-	32,822,044.06	32,822,044.06
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-33,937,349.97	-19,038,786.34	-52,976,136.31
其中：1.基金申购款	56,759,854.81	35,722,340.15	92,482,194.96
2.基金赎回款	-90,697,204.78	-54,761,126.49	-145,458,331.27
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	153,550,036.67	118,408,568.25	271,958,604.92

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：邹迎光，主管会计工作负责人：朱威，会计机构负责人：朱威

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

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

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

本基金可根据相关法律法规和《基金合同》的约定，参与融资业务。

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

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布和修订的《企业会计准则——基本准则》、各项具体会计准则(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《公开募集证券投资基金信息披露内容与格式准则第 2 号——定期报告的内容与格式》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的《公开募集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》编制，同时在信息披露方面也参考了中国证监会、中国基金业协会发布的基金行业实务操作的其他有关规定。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

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

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

根据财税[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]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[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》、中华人民共和国主席令第四十一号《中华人民共和国增值税法》、中华人民共和国国务院令第 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》及财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税交易，资管产品管理人为纳税人。自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3% 的规定征收率计算缴纳增值税。

(2) 自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，对公募证券投资基金（封闭式证券投资基金、开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入免征增值税；对证券投资基金从证券市场中取得的买卖股票、债券的差价收入，暂不征收企业所得税。

(3) 存款利息收入不征收增值税。

(4) 自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，金融同业往来利息收入免征增值税。

(5) 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附加。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位: 人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	45,923,059.74
等于: 本金	45,918,215.98
加: 应计利息	4,843.76

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	45,923,059.74

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		661,371,743.17	-	664,458,948.16	3,087,204.99
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		661,371,743.17	-	664,458,948.16	3,087,204.99

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	

利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	3,169,413.33	-	-	-
其中：股指期货	3,169,413.33	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	3,169,413.33	-	-	-

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IC2609	中证 500 期货 IC2609 合约	2	3,504,560.00	335,146.67
合计	-	-	-	335,146.67
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	335,146.67
净额	-	-	-	-

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

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 其他资产

无。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-

应付赎回费	6,313.15
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	1,115,937.17
其中：交易所市场	1,115,937.17
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	114,722.86
合计	1,236,973.18

6.4.7.7 实收基金

华夏智胜价值成长股票 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	195,541,461.45	195,541,461.45
本期申购	147,160,035.70	147,160,035.70
本期赎回（以“-”号填列）	-155,637,644.37	-155,637,644.37
本期末	187,063,852.78	187,063,852.78

华夏智胜价值成长股票 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	145,325,897.97	145,325,897.97
本期申购	109,190,566.95	109,190,566.95
本期赎回（以“-”号填列）	-148,044,769.50	-148,044,769.50
本期末	106,471,695.42	106,471,695.42

注：申购含红利再投（如有）、转换入份额（如有），赎回含转换出份额（如有）。

6.4.7.8 未分配利润

华夏智胜价值成长股票 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	192,017,733.45	40,556,987.63	232,574,721.08
本期期初	192,017,733.45	40,556,987.63	232,574,721.08
本期利润	55,928,467.96	-5,698,729.61	50,229,738.35
本期基金份额交易产生的变动数	-12,747,351.73	-793,562.16	-13,540,913.89
其中：基金申购款	165,909,282.54	31,304,581.93	197,213,864.47
基金赎回款	-178,656,634.27	-32,098,144.09	-210,754,778.36
本期已分配利润	-	-	-
本期末	235,198,849.68	34,064,695.86	269,263,545.54

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	138,388,195.85	29,731,637.09	168,119,832.94
本期期初	138,388,195.85	29,731,637.09	168,119,832.94
本期利润	37,551,940.63	-5,688,287.43	31,863,653.20
本期基金份额交易产生的变动数	-45,991,279.06	-4,914,453.87	-50,905,732.93
其中：基金申购款	119,222,067.74	21,960,419.73	141,182,487.47
基金赎回款	-165,213,346.80	-26,874,873.60	-192,088,220.40
本期已分配利润	-	-	-
本期末	129,948,857.42	19,128,895.79	149,077,753.21

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	93,685.40
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	19,293.50
其他	2,719.76
合计	115,698.66

6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	5,876,230,319.67
减：卖出股票成本总额	5,779,038,634.91
减：交易费用	4,800,578.18
买卖股票差价收入	92,391,106.58

6.4.7.11 基金投资收益

无。

6.4.7.12 债券投资收益

6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	27.47
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	186,227.57
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	186,255.04

6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	497,177.63
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	310,900.00
减：应计利息总额	30.19
减：交易费用	19.87
买卖债券差价收入	186,227.57

6.4.7.13 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.14 贵金属投资收益

无。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
股指期货投资收益	638,934.75

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资产生的股利收益	4,480,833.93
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	4,480,833.93

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
1.交易性金融资产	-11,558,043.71
——股票投资	-11,536,263.71
——债券投资	-21,780.00
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	171,026.67
——权证投资	-
——期货投资	171,026.67
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	-11,387,017.04

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
基金赎回费收入	1,087,953.33
合计	1,087,953.33

6.4.7.19 持有基金产生的费用

无。

6.4.7.20 信用减值损失

无。

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
审计费用	22,315.49
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	5,379.22
合计	87,202.08

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

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

本基金本报告期不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
-------	---------

华夏基金管理有限公司	基金管理人
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	基金托管人
中信证券股份有限公司（“中信证券”）	基金管理人的股东
上海华夏财富投资管理有限公司（“华夏财富”）	基金管理人的子公司
中信证券华南股份有限公司（“中信证券（华南）”）	基金管理人第一大股东的子公司
中信证券（山东）有限责任公司（“中信证券（山东）”）	基金管理人第一大股东的子公司
中信期货有限公司（“中信期货”）	基金管理人第一大股东的子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日		上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
中信证券	-	-	58,080.00	-

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 债券交易

无。

6.4.10.1.4 债券回购交易

无。

6.4.10.1.5 基金交易

无。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月 30日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	4,095,101.44	1,293,471.42
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,470,330.47	313,504.37
应支付基金管理人的净管理费	2,624,770.97	979,967.05

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

②基金管理人报酬计算公式为：日基金管理人报酬＝前一日基金资产净值×年费率/当年天数。

③客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用按照代销机构所代销基金的份额保有量作为基数进行计算，从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30 日	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	819,020.27	258,694.26

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

②基金托管费计算公式为：日基金托管费＝前一日基金资产净值×年费率/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期2026年1月1日至2026年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华夏智胜价值成长股票 A	华夏智胜价值成长股 票 C	合计
招商银行	-	72,321.04	72,321.04
华夏基金管理有限公司	-	25,551.35	25,551.35
中信证券	-	3,379.22	3,379.22
华夏财富	-	735.22	735.22
中信证券（山东）	-	668.56	668.56
中信证券（华南）	-	638.79	638.79

中信期货	-	64.27	64.27
合计	-	103,358.45	103,358.45
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华夏智胜价值成长股票 A	华夏智胜价值成长股票 C	合计
华夏基金管理有限公司	-	20,774.48	20,774.48
招商银行	-	8,814.60	8,814.60
华夏财富	-	2,591.53	2,591.53
中信证券	-	1,369.07	1,369.07
中信证券（山东）	-	303.85	303.85
中信证券（华南）	-	249.16	249.16
中信期货	-	6.83	6.83
合计	-	34,109.52	34,109.52

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

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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日
----	----------------------------	---------------------------------

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

注：基金管理人投资本基金相关的费用按基金合同及相关法律文件有关规定支付。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日		上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行活期存款	45,923,059.74	93,685.40	16,102,319.74	27,265.95

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

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2026年1月1日至2026年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
中信证券	001248	华润新能源	新股发行	39,416	398,495.76
中信证券	688820	盛合晶微	新股发行	13,146	258,713.28
中信证券	688808	联讯仪器	新股发行	1,624	132,973.12
中信证券	688785	恒运昌	新股发行	1,155	106,467.90
中信证券	688797	臻宝科技	新股发行	2,070	92,239.20
中信证券	301683	慧谷新材	新股发行	952	74,617.76
中信证券	688811	有研复材	新股发行	8,337	53,440.17

中信证券	301669	高特电子	新股发行	5,455	38,621.40
中信证券	001312	福恩股份	新股发行	1,333	24,500.54
上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位： 股/张）	总金额
中信证券	688775	影石创新	新股发行	2,158	102,008.66
中信证券	688583	思看科技	新股发行	1,742	58,287.32
中信证券	688755	汉邦科技	新股发行	2,023	46,063.71
中信证券	301662	宏工科技	新股发行	1,429	38,011.40
中信证券	603257	中国瑞林	新股发行	780	16,005.60
中信证券	603124	江南新材	新股发行	879	9,264.66

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配事项。

6.4.12 期末（2026 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
301666	大普微	2026-04-08	6 个月	新发流通受限	46.08	463.33	1,220	56,217.60	565,262.60	-
001248	华润新能源	2026-06-24	6 个月	新发流通受限	10.11	10.11	27,592	278,955.12	278,955.12	-
688808	联讯仪器	2026-04-16	6 个月	新发流通受限	81.88	1,584.33	163	13,346.44	258,245.79	-
688820	盛合晶微	2026-04-13	6 个月	新发流通受限	19.68	141.49	1,315	25,879.20	186,059.35	-

001399	惠科股份	2026-06-16	6 个月	新发流通受限	10.12	27.73	4,457	45,104.84	123,592.61	-
688818	电科蓝天	2026-02-03	6 个月	新发流通受限	9.47	70.14	1,717	16,259.99	120,430.38	-
001248	华润新能源	2026-06-24	1 个月内 (含)	新发流通受限	10.11	10.11	11,824	119,540.64	119,540.64	-
301682	宏明电子	2026-03-18	6 个月	新发流通受限	69.66	160.06	714	49,737.24	114,282.84	-
688797	臻宝科技	2026-06-16	6 个月	新发流通受限	44.56	468.67	207	9,223.92	97,014.69	-
688781	视涯科技	2026-03-18	6 个月	新发流通受限	22.68	47.61	1,300	29,484.00	61,893.00	-
688712	北芯生命	2026-01-28	6 个月	新发流通受限	17.52	35.92	1,500	26,280.00	53,880.00	-
688785	恒运昌	2026-01-20	6 个月	新发流通受限	92.18	463.15	116	10,692.88	53,725.40	-
688813	泰金新能	2026-03-24	6 个月	新发流通受限	26.28	172.09	234	6,149.52	40,269.06	-
688635	长进光子	2026-05-20	6 个月	新发流通受限	40.98	308.19	128	5,245.44	39,448.32	-
001257	盛龙股份	2026-03-24	6 个月	新发流通受限	7.82	20.74	1,743	13,630.26	36,149.82	-
603459	红板科技	2026-03-31	6 个月	新发流通受限	17.70	84.32	330	5,841.00	27,825.60	-
001365	天海电子	2026-05-11	6 个月	新发流通受限	27.19	31.31	719	19,549.61	22,511.89	-
688811	有研新材	2026-04-01	6 个月	新发流通受限	6.41	24.13	834	5,345.94	20,124.42	-
301696	三瑞智能	2026-03-31	6 个月	新发流通受限	24.68	86.80	216	5,330.88	18,748.80	-

001237	惠康科技	2026-05-15	6 个月	新发流通受限	53.26	58.74	285	15,179.10	16,740.90	-
301669	高特电子	2026-06-02	6 个月	新发流通受限	7.08	28.40	546	3,865.68	15,506.40	-
301687	新广益	2025-12-24	6 个月	新发流通受限	21.93	77.78	195	4,276.35	15,167.10	-
001393	维通利	2026-05-08	6 个月	新发流通受限	30.38	38.99	387	11,757.06	15,089.13	-
301531	春光集团	2026-04-28	6 个月	新发流通受限	13.30	51.56	290	3,857.00	14,952.40	-
301599	理奇智能	2026-04-22	6 个月	新发流通受限	13.91	32.47	433	6,023.03	14,059.51	-
601112	振石股份	2026-01-21	6 个月	新发流通受限	11.18	17.59	750	8,385.00	13,192.50	-
301680	固德电材	2026-02-27	6 个月	新发流通受限	58.00	112.16	117	6,786.00	13,122.72	-
301683	慧谷新材	2026-03-24	6 个月	新发流通受限	78.38	121.77	96	7,524.48	11,689.92	-
688816	易思维	2026-02-04	6 个月	新发流通受限	55.95	57.10	177	9,903.15	10,106.70	-
603407	长裕集团	2026-04-29	6 个月	新发流通受限	13.86	73.46	137	1,898.82	10,064.02	-
301513	尚水智能	2026-04-10	6 个月	新发流通受限	26.66	50.96	138	3,679.08	7,032.48	-
603435	嘉德利	2026-05-15	6 个月	新发流通受限	15.76	46.71	104	1,639.04	4,857.84	-
603352	至信股份	2026-01-08	6 个月	新发流通受限	21.88	25.52	112	2,450.56	2,858.24	-
603293	埃泰克	2026-04-09	6 个月	新发流通受限	33.49	33.93	72	2,411.28	2,442.96	-

001312	福恩股份	2026-04-14	6 个月	新发流通受限	18.38	16.78	134	2,462.92	2,248.52	-
603284	林平发展	2026-02-03	6 个月	新发流通受限	37.88	34.87	46	1,742.48	1,604.02	-
001220	世盟股份	2026-01-27	6 个月	新发流通受限	28.00	27.78	57	1,596.00	1,583.46	-

注：①根据中国证监会《上市公司证券发行注册管理办法》，基金参与上市公司向特定对象发行股票所获得的股票，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。

②基金还可作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

③根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

④基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的设定限售期的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的风险管理政策是使基金投资风险可测、可控、可承担。本基金管理人建立了由风险管理委员会、督察长、法律部、合规部、稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的多层次风险管理架构体系。风险管理团队在识别、衡量投资风险后，通过正式报告的方式，将分析结果及时传达给

基金经理、投资总监、投资决策委员会和风险管理委员会，协助制定风险控制决策，实现风险管理目标。

本基金管理人主要通过定性分析和定量分析的方法，估测各种金融工具风险可能产生的损失。本基金管理人从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重性；从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用的金融工具特征，通过特定的风险量化指标、模型和日常的量化报告，参考压力测试结果，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时对各种风险进行监督、检查和评估，并制定相应决策，将风险控制在预期可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指由于基金所投资债券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息，债券发行人信用评级降低导致债券价格下降，或基金在交易过程中发生交收违约，而造成基金资产损失的可能性。

本基金管理人通过信用分析团队建立了内部评级体系和交易对手库，对发行人及债券投资进行内部评级，对交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度，以控制可能出现的信用风险。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是在市场或持有资产流动性不足的情况下，基金管理人可能无法迅速、低成本地调整基金投资组合，从而对基金收益造成不利影响。

本基金管理人通过限制投资集中度来管理投资品种变现的流动性风险。除在“6.4.12 期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限制的情况外，本基金所投资的证券均能及时变现。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

在日常运作中，本基金的流动性安排能够与基金合同约定的申购赎回安排以及投资者的申购赎回规律相匹配。

在资产端，本基金主要投资于基金合同约定的具有良好流动性的金融工具。基金管理人持续监测本基金持有资产的市场交易量、交易集中度等涉及资产流动性水平的风险指标，并定期开展压力测试，详细评估在不同的压力情景下资产变现情况的变化。

在负债端，基金管理人持续监测本基金开放期内投资者历史申赎、投资者类型和结构变化等数据，审慎评估不同市场环境可能带来的投资者潜在赎回需求，当市场环境或投资者结构发生变化时，及时调整组合资产结构及比例，预留充足现金头寸，保持基金资产可变现规模和期限与负债赎回规模和期限的匹配。

如遭遇极端市场情形或投资者非预期巨额赎回情形，基金管理人将采用本基金合同约定的赎回申请处理方式及其他各类流动性风险管理工具，控制极端情况下的潜在流动性风险。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指由于市场变化或波动所引起的资产损失的可能性，本基金管理人通过监测组合敏感性指标来衡量市场风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率变动引起组合中资产特别是债券投资的市场价格变动，从而影响基金投资收益的风险。

本基金管理人定期对组合中债券投资部分面临的利率风险进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

截至本期末，综合考虑利率债、信用债、同业存单、资产支持证券等资产占基金资产净值的比例，利率变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险为除市场利率和外汇汇率以外的市场因素（单个证券发行主体自身经营情况或证券市场整体波动）发生变动时导致基金资产发生损失的风险。

本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险。此外，本基金管理人对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法进行风险度量和分析，以对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 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	664,458,948.16	93.34	692,913,769.42	93.44
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	664,458,948.16	93.34	692,983,951.22	93.45

注：①本表中交易性金融资产-债券投资科目仅包含可转换公司债券和可交换公司债券等。

②由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位：人民币元)	
		本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
	-5%	-42,800,375.30	-33,710,014.09
	+5%	42,800,375.30	33,710,014.09

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026 年 6 月 30 日
第一层次	662,063,836.11
第二层次	398,495.76
第三层次	1,996,616.29
合计	664,458,948.16

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券等投资，若出现交易不活跃（包括重大事项停牌、境内证券涨跌停等导致的交易不活跃）和非公开发行等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。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

截至 2026 年 6 月 30 日止，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，其账面价值与公允价值差异很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元			
序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	664,458,948.16	90.17
	其中：股票	664,458,948.16	90.17
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	54,219,141.80	7.36
8	其他各项资产	18,193,246.02	2.47
9	合计	736,871,335.98	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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	4,119,422.50	0.58
B	采矿业	19,481,783.92	2.74
C	制造业	478,018,712.57	67.15

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,809,699.78	0.68
E	建筑业	2,097,865.00	0.29
F	批发和零售业	20,436,937.96	2.87
G	交通运输、仓储和邮政业	9,843,356.00	1.38
H	住宿和餐饮业	70,161.00	0.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	62,081,518.38	8.72
J	金融业	26,503,492.10	3.72
K	房地产业	6,679,096.00	0.94
L	租赁和商务服务业	8,493,716.00	1.19
M	科学研究和技术服务业	7,703,926.00	1.08
N	水利、环境和公共设施管理业	8,411,960.95	1.18
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	3,510,386.00	0.49
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	2,196,914.00	0.31
S	综合	-	-
	合计	664,458,948.16	93.34

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

7.3.1 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	300919	中伟新材	180,900	7,914,375.00	1.11
2	688536	思瑞浦	20,000	7,281,800.00	1.02
3	688127	蓝特光学	66,144	6,455,654.40	0.91
4	002379	宏桥控股	395,800	5,845,966.00	0.82
5	688498	源杰科技	2,990	5,639,140.00	0.79
6	688235	百济神州	21,300	5,423,193.00	0.76
7	688279	峰昭科技	23,800	5,341,672.00	0.75
8	688311	盟升电子	202,600	5,306,094.00	0.75
9	688002	睿创微纳	34,061	5,268,896.09	0.74

10	300604	长川科技	15,300	5,223,726.00	0.73
11	688778	厦钨新能	92,600	5,037,440.00	0.71
12	000829	天音控股	629,100	4,906,980.00	0.69
13	601601	中国太保	171,800	4,899,736.00	0.69
14	688486	龙迅股份	75,900	4,825,722.00	0.68
15	002738	中矿资源	81,500	4,807,685.00	0.68
16	300073	当升科技	99,700	4,789,588.00	0.67
17	301479	弘景光电	79,370	4,778,074.00	0.67
18	605222	起帆电缆	194,000	4,524,080.00	0.64
19	688063	派能科技	84,900	4,522,623.00	0.64
20	002544	普天科技	238,000	4,336,360.00	0.61
21	688388	嘉元科技	97,523	4,291,012.00	0.60
22	301090	华润材料	647,900	4,062,333.00	0.57
23	300775	三角防务	183,200	4,037,728.00	0.57
24	002281	光迅科技	15,200	3,905,488.00	0.55
25	002497	雅化集团	182,700	3,721,599.00	0.52
26	603162	海通发展	413,208	3,706,475.76	0.52
27	603986	兆易创新	4,506	3,672,390.00	0.52
28	300672	国科微	12,400	3,658,000.00	0.51
29	002487	大金重工	62,000	3,594,140.00	0.50
30	301041	金百泽	104,400	3,523,500.00	0.49
31	002810	山东赫达	141,800	3,502,460.00	0.49
32	688275	万润新能	26,600	3,392,830.00	0.48
33	300223	北京君正	13,500	3,360,150.00	0.47
34	002023	海特高新	252,900	3,277,584.00	0.46
35	300861	美畅股份	129,500	3,262,105.00	0.46
36	300976	达瑞电子	40,900	3,257,685.00	0.46
37	002400	省广集团	500,800	3,160,048.00	0.44
38	688008	澜起科技	10,100	3,129,990.00	0.44
39	300492	华图山鼎	91,000	3,125,850.00	0.44

40	300936	中英科技	28,000	3,088,400.00	0.43
41	002998	优彩资源	473,000	3,079,230.00	0.43
42	601126	四方股份	47,800	3,020,960.00	0.42
43	002803	吉宏股份	116,300	3,005,192.00	0.42
44	301377	鼎泰高科	5,400	2,974,860.00	0.42
45	600176	中国巨石	39,800	2,900,624.00	0.41
46	001314	亿道信息	46,900	2,898,420.00	0.41
47	605056	咸亨国际	176,800	2,828,800.00	0.40
48	300553	集智股份	45,800	2,811,662.00	0.39
49	300785	值得买	73,900	2,709,913.00	0.38
50	300308	中际旭创	2,080	2,641,600.00	0.37
51	002384	东山精密	10,000	2,623,500.00	0.37
52	002008	大族激光	17,400	2,611,914.00	0.37
53	301316	慧博云通	66,300	2,610,894.00	0.37
54	002947	恒铭达	34,100	2,593,305.00	0.36
55	301387	光大同创	27,800	2,569,276.00	0.36
56	600418	江淮汽车	99,400	2,567,502.00	0.36
57	001389	广合科技	10,700	2,538,575.00	0.36
58	603083	剑桥科技	9,900	2,523,213.00	0.35
59	002222	福晶科技	27,100	2,500,788.00	0.35
60	000408	藏格矿业	35,900	2,488,588.00	0.35
61	002716	湖南白银	306,900	2,482,821.00	0.35
62	002328	新朋股份	337,700	2,478,718.00	0.35
63	002772	众兴菌业	217,100	2,466,256.00	0.35
64	600916	中国黄金	360,500	2,465,820.00	0.35
65	301556	托普云农	41,600	2,431,936.00	0.34
66	000975	山金国际	142,400	2,420,800.00	0.34
67	301603	乔锋智能	16,700	2,401,460.00	0.34
68	300548	长芯博创	8,600	2,390,800.00	0.34
69	300206	理邦仪器	195,400	2,389,742.00	0.34

70	600338	西藏珠峰	156,700	2,388,108.00	0.34
71	688059	华锐精密	11,900	2,376,549.00	0.33
72	688041	海光信息	6,400	2,369,920.00	0.33
73	002756	永兴材料	41,200	2,333,568.00	0.33
74	002841	视源股份	67,000	2,313,510.00	0.32
75	688025	杰普特	4,900	2,303,000.00	0.32
76	601869	长飞光纤	4,200	2,292,780.00	0.32
77	301130	西点药业	95,000	2,278,100.00	0.32
78	600683	京投发展	197,700	2,273,550.00	0.32
79	688503	聚和材料	17,100	2,269,170.00	0.32
80	688521	芯原股份	6,100	2,263,954.00	0.32
81	001337	四川黄金	61,400	2,250,924.00	0.32
82	300502	新易盛	3,700	2,245,900.00	0.32
83	688469	芯联集成	209,100	2,218,551.00	0.31
84	301189	奥尼电子	37,460	2,207,517.80	0.31
85	000338	潍柴动力	80,300	2,188,175.00	0.31
86	002092	中泰化学	568,900	2,178,887.00	0.31
87	688766	普冉股份	2,800	2,146,480.00	0.30
88	605299	舒华体育	160,100	2,137,335.00	0.30
89	688256	寒武纪	1,339	2,136,441.45	0.30
90	300774	倍杰特	198,600	2,134,950.00	0.30
91	688655	迅捷兴	38,900	2,083,484.00	0.29
92	300059	东方财富	101,600	2,070,608.00	0.29
93	688522	纳睿雷达	100,660	2,015,213.20	0.28
94	688630	芯碁微装	3,600	1,977,804.00	0.28
95	002916	深南电路	4,300	1,968,970.00	0.28
96	688385	复旦微电	27,300	1,946,217.00	0.27
97	300715	凯伦股份	117,700	1,937,342.00	0.27
98	300911	亿田智能	90,700	1,927,375.00	0.27
99	600791	京能置业	218,000	1,905,320.00	0.27

100	600714	金瑞矿业	92,000	1,888,760.00	0.27
101	601778	晶科科技	435,500	1,872,650.00	0.26
102	001313	粤海饲料	262,900	1,863,961.00	0.26
103	600722	金牛化工	227,700	1,848,924.00	0.26
104	300953	震裕科技	13,760	1,839,712.00	0.26
105	000533	顺钠股份	192,900	1,834,479.00	0.26
106	600986	浙文互联	261,800	1,827,364.00	0.26
107	301608	博实结	36,143	1,816,547.18	0.26
108	301086	鸿富瀚	8,660	1,812,364.80	0.25
109	688677	海泰新光	17,884	1,808,608.92	0.25
110	600230	沧州大化	137,900	1,795,458.00	0.25
111	688309	恒誉环保	29,000	1,765,520.00	0.25
112	000592	平潭发展	261,500	1,749,435.00	0.25
113	300207	欣旺达	91,000	1,728,090.00	0.24
114	600183	生益科技	9,800	1,699,320.00	0.24
115	601872	招商轮船	96,400	1,693,748.00	0.24
116	002130	沃尔核材	89,200	1,691,232.00	0.24
117	002237	恒邦股份	115,000	1,689,350.00	0.24
118	600309	万华化学	24,500	1,676,045.00	0.24
119	300055	万邦达	258,500	1,662,155.00	0.23
120	600026	中远海能	91,500	1,641,510.00	0.23
121	301429	森泰股份	104,600	1,639,082.00	0.23
122	688693	锆威特	15,700	1,632,015.00	0.23
123	600875	东方电气	56,400	1,622,628.00	0.23
124	688757	胜科纳米	24,300	1,620,810.00	0.23
125	601688	华泰证券	78,200	1,612,484.00	0.23
126	600801	华新建材	103,100	1,608,360.00	0.23
127	000776	广发证券	68,300	1,598,220.00	0.22
128	603619	中曼石油	85,100	1,592,221.00	0.22
129	300750	宁德时代	4,000	1,572,040.00	0.22

130	688392	骄成超声	6,800	1,544,824.00	0.22
131	600999	招商证券	72,700	1,533,970.00	0.22
132	300236	上海新阳	11,600	1,525,400.00	0.21
133	000603	盛达资源	65,600	1,515,360.00	0.21
134	002371	北方华创	1,695	1,499,329.20	0.21
135	600113	浙江东日	44,800	1,486,464.00	0.21
136	688313	仕佳光子	8,000	1,477,200.00	0.21
137	300409	道氏技术	73,600	1,466,848.00	0.21
138	688981	中芯国际	9,200	1,461,144.00	0.21
139	688372	伟测科技	7,855	1,461,030.00	0.21
140	688678	福立旺	59,900	1,447,783.00	0.20
141	688615	合合信息	12,800	1,447,680.00	0.20
142	603259	药明康德	11,500	1,431,865.00	0.20
143	688231	隆达股份	38,860	1,427,327.80	0.20
144	688559	海目星	16,900	1,418,248.00	0.20
145	688012	中微公司	3,000	1,405,500.00	0.20
146	300855	图南股份	44,800	1,400,448.00	0.20
147	603737	三棵树	57,800	1,392,980.00	0.20
148	688262	国芯科技	32,200	1,392,006.00	0.20
149	601061	中信金属	129,200	1,391,484.00	0.20
150	300373	扬杰科技	8,800	1,383,624.00	0.19
151	601995	中金公司	38,100	1,377,315.00	0.19
152	000534	万泽股份	50,200	1,373,472.00	0.19
153	301598	博科测试	27,700	1,371,704.00	0.19
154	300408	三环集团	8,200	1,368,580.00	0.19
155	002126	银轮股份	27,400	1,364,520.00	0.19
156	002745	木林森	108,000	1,355,400.00	0.19
157	000933	神火股份	63,600	1,348,320.00	0.19
158	000892	欢瑞世纪	403,600	1,343,988.00	0.19
159	600941	中国移动	15,600	1,343,628.00	0.19

160	002415	海康威视	39,200	1,340,640.00	0.19
161	002028	思源电气	7,700	1,332,100.00	0.19
162	002342	巨力索具	125,400	1,317,954.00	0.19
163	300476	胜宏科技	3,800	1,316,434.00	0.18
164	000932	华菱钢铁	378,800	1,314,436.00	0.18
165	002518	科士达	24,500	1,312,955.00	0.18
166	300843	胜蓝股份	8,400	1,312,500.00	0.18
167	601398	工商银行	185,500	1,311,485.00	0.18
168	601212	白银有色	257,700	1,309,116.00	0.18
169	603057	紫燕食品	57,900	1,291,170.00	0.18
170	603588	高能环境	66,400	1,274,880.00	0.18
171	002270	华明装备	67,500	1,272,375.00	0.18
172	301345	涛涛车业	5,500	1,270,500.00	0.18
173	300427	红相股份	189,200	1,269,532.00	0.18
174	601318	中国平安	26,400	1,260,336.00	0.18
175	300033	同花顺	5,200	1,253,200.00	0.18
176	600016	民生银行	385,700	1,241,954.00	0.17
177	601033	永兴股份	92,500	1,239,500.00	0.17
178	300661	圣邦股份	8,600	1,233,928.00	0.17
179	002001	新和成	43,400	1,233,428.00	0.17
180	002402	和而泰	47,600	1,229,508.00	0.17
181	002197	证通电子	212,600	1,220,324.00	0.17
182	603200	上海洗霸	28,000	1,214,080.00	0.17
183	300450	先导智能	29,700	1,209,384.00	0.17
184	688700	东威科技	13,500	1,206,900.00	0.17
185	300395	菲利华	9,000	1,203,570.00	0.17
186	000792	盐湖股份	39,700	1,198,543.00	0.17
187	601567	三星电气	80,000	1,195,200.00	0.17
188	688776	国光电气	19,400	1,189,996.00	0.17
189	603659	璞泰来	41,000	1,186,130.00	0.17

190	002478	常宝股份	191,800	1,185,324.00	0.17
191	300602	飞荣达	23,100	1,182,720.00	0.17
192	300136	信维通信	9,900	1,180,575.00	0.17
193	002969	嘉美包装	83,300	1,172,864.00	0.16
194	601208	东材科技	16,200	1,146,798.00	0.16
195	601211	国泰海通	62,700	1,141,140.00	0.16
196	301353	普莱得	68,090	1,130,974.90	0.16
197	301390	经纬股份	35,000	1,129,100.00	0.16
198	301519	舜禹股份	103,499	1,122,964.15	0.16
199	688110	东芯股份	5,500	1,120,350.00	0.16
200	000657	中钨高新	11,700	1,119,924.00	0.16
201	002463	沪电股份	7,300	1,115,440.00	0.16
202	603799	华友钴业	23,000	1,109,980.00	0.16
203	002532	天山铝业	103,300	1,108,409.00	0.16
204	000923	河钢资源	88,900	1,103,249.00	0.15
205	600739	辽宁成大	108,700	1,098,957.00	0.15
206	688023	安恒信息	29,800	1,094,256.00	0.15
207	300766	每日互动	51,100	1,093,540.00	0.15
208	301200	大族数控	3,000	1,081,950.00	0.15
209	002819	东方中科	48,400	1,081,740.00	0.15
210	600704	物产中大	228,200	1,077,104.00	0.15
211	300407	凯发电气	99,000	1,069,200.00	0.15
212	601939	建设银行	110,700	1,066,041.00	0.15
213	601857	中国石油	122,700	1,065,036.00	0.15
214	601766	中国中车	204,500	1,063,400.00	0.15
215	601988	中国银行	180,000	1,029,600.00	0.14
216	300813	泰林生物	53,800	1,027,042.00	0.14
217	002475	立讯精密	14,400	1,013,760.00	0.14
218	002587	奥拓电子	129,400	1,010,614.00	0.14
219	600601	方正科技	72,900	1,008,936.00	0.14

220	300371	汇中股份	103,000	1,007,340.00	0.14
221	600075	新疆天业	248,900	1,005,556.00	0.14
222	003816	中国广核	257,000	1,004,870.00	0.14
223	301061	匠心家居	28,600	1,003,002.00	0.14
224	300620	光库科技	2,600	983,320.00	0.14
225	001218	丽臣实业	44,538	982,508.28	0.14
226	001360	南矿集团	55,200	976,488.00	0.14
227	300986	志特新材	56,900	975,835.00	0.14
228	000807	云铝股份	44,000	974,160.00	0.14
229	600988	赤峰黄金	36,800	968,576.00	0.14
230	300980	祥源新材	32,900	967,589.00	0.14
231	300970	华绿生物	52,820	965,549.60	0.14
232	688173	希荻微	50,000	957,000.00	0.13
233	002080	中材科技	10,600	954,000.00	0.13
234	301087	可孚医疗	20,000	953,000.00	0.13
235	600489	中金黄金	52,600	949,430.00	0.13
236	000959	首钢股份	270,300	948,753.00	0.13
237	688236	春立医疗	65,300	944,238.00	0.13
238	301002	崧盛股份	24,300	937,980.00	0.13
239	300290	ST 荣科	139,900	930,335.00	0.13
240	300837	浙矿股份	39,100	929,016.00	0.13
241	603836	海程邦达	116,620	921,298.00	0.13
242	002414	高德红外	69,400	920,244.00	0.13
243	688061	灿瑞科技	18,300	908,961.00	0.13
244	603061	金海通	1,800	903,996.00	0.13
245	688513	苑东生物	20,300	892,388.00	0.13
246	002043	兔宝宝	80,000	886,400.00	0.12
247	002929	润建股份	13,200	882,816.00	0.12
248	301571	国科天成	13,500	879,930.00	0.12
249	600773	西藏城投	68,100	876,447.00	0.12

250	301391	卡莱特	15,200	867,920.00	0.12
251	688334	西高院	47,800	867,092.00	0.12
252	300947	德必集团	68,000	867,000.00	0.12
253	301589	诺瓦星云	5,800	864,084.00	0.12
254	300418	昆仑万维	21,400	863,704.00	0.12
255	002886	沃特股份	30,700	862,363.00	0.12
256	301192	泰祥股份	45,500	859,950.00	0.12
257	301166	优宁维	33,300	858,807.00	0.12
258	301665	泰禾股份	40,400	846,784.00	0.12
259	603926	铁流股份	47,800	845,582.00	0.12
260	605060	联德股份	14,900	845,426.00	0.12
261	301600	慧翰股份	9,219	842,616.60	0.12
262	301219	腾远钴业	15,000	822,000.00	0.12
263	301113	雅艺科技	54,800	817,068.00	0.11
264	688361	中科飞测	1,900	817,000.00	0.11
265	300921	南凌科技	39,900	810,369.00	0.11
266	300663	科蓝软件	121,466	808,963.56	0.11
267	688653	康希通信	46,300	804,694.00	0.11
268	000686	东北证券	95,700	803,880.00	0.11
269	300571	平治信息	17,600	803,616.00	0.11
270	600549	厦门钨业	9,300	792,360.00	0.11
271	000166	申万宏源	179,400	789,360.00	0.11
272	603312	西典新能	22,800	774,744.00	0.11
273	301371	敷尔佳	29,700	772,200.00	0.11
274	603096	新经典	57,500	769,350.00	0.11
275	002712	思美传媒	184,000	763,600.00	0.11
276	301510	固高科技	23,900	763,127.00	0.11
277	301272	英华特	23,000	757,620.00	0.11
278	002353	杰瑞股份	4,900	747,250.00	0.10
279	300658	延江股份	65,200	745,236.00	0.10

280	300596	利安隆	14,200	745,216.00	0.10
281	002484	江海股份	7,000	735,000.00	0.10
282	301156	美农生物	67,440	733,072.80	0.10
283	688045	必易微	9,052	731,220.56	0.10
284	000623	吉林敖东	41,200	730,476.00	0.10
285	688386	泛亚微透	8,100	727,704.00	0.10
286	600595	中孚实业	129,200	726,104.00	0.10
287	600645	中源协和	42,000	718,620.00	0.10
288	688380	中微半导	10,700	705,237.00	0.10
289	688580	伟思医疗	13,200	703,164.00	0.10
290	688568	中科星图	16,900	700,843.00	0.10
291	301150	中一科技	11,100	700,521.00	0.10
292	600938	中国海油	25,800	700,470.00	0.10
293	301037	保立佳	58,210	698,520.00	0.10
294	603993	洛阳钼业	39,600	694,980.00	0.10
295	688390	固德威	6,400	694,464.00	0.10
296	688525	佰维存储	1,400	692,622.00	0.10
297	601096	宏盛华源	159,400	691,796.00	0.10
298	002064	华峰化学	72,600	688,974.00	0.10
299	601918	新集能源	80,100	688,059.00	0.10
300	300768	迪普科技	49,800	685,746.00	0.10
301	002913	奥士康	10,700	684,158.00	0.10
302	301326	捷邦科技	4,900	682,913.00	0.10
303	603790	雅运股份	32,000	682,880.00	0.10
304	688591	泰凌微	19,800	680,724.00	0.10
305	603515	欧普照明	41,500	678,110.00	0.10
306	300394	天孚通信	2,235	676,489.80	0.10
307	301378	通达海	28,000	671,440.00	0.09
308	300277	汽轮科技	44,600	670,784.00	0.09
309	300711	广哈通信	40,800	669,120.00	0.09

310	000676	智度股份	130,800	668,388.00	0.09
311	001326	联域股份	11,200	664,048.00	0.09
312	688027	国盾量子	1,300	655,213.00	0.09
313	002388	新亚制程	125,000	655,000.00	0.09
314	600971	恒源煤电	94,700	653,430.00	0.09
315	301631	壹连科技	9,060	651,051.60	0.09
316	301180	万祥科技	51,900	650,307.00	0.09
317	301567	贝隆精密	18,500	640,285.00	0.09
318	000708	中信特钢	50,700	639,834.00	0.09
319	300769	德方纳米	9,600	638,400.00	0.09
320	002785	万里石	14,400	638,064.00	0.09
321	300351	永贵电器	38,300	631,950.00	0.09
322	688301	奕瑞科技	5,080	629,920.00	0.09
323	000987	越秀资本	79,100	618,562.00	0.09
324	300971	博亚精工	33,100	617,646.00	0.09
325	688115	思林杰	7,500	616,875.00	0.09
326	600563	法拉电子	3,200	610,560.00	0.09
327	688400	凌云光	9,100	602,420.00	0.08
328	000967	盈峰环境	57,000	600,210.00	0.08
329	688356	键凯科技	7,700	593,516.00	0.08
330	002566	益盛药业	97,700	590,108.00	0.08
331	600201	生物股份	49,600	577,840.00	0.08
332	300580	贝斯特	28,300	569,113.00	0.08
333	301666	大普微	1,220	565,262.60	0.08
334	601233	桐昆股份	26,000	562,900.00	0.08
335	601088	中国神华	14,400	562,176.00	0.08
336	300697	电工合金	37,000	560,550.00	0.08
337	300490	华自科技	41,900	554,337.00	0.08
338	688258	卓易信息	4,600	545,284.00	0.08
339	002624	完美世界	43,700	542,754.00	0.08

340	688196	卓越新能	15,100	542,090.00	0.08
341	000810	创维数字	40,800	540,600.00	0.08
342	601665	齐鲁银行	92,400	533,148.00	0.07
343	002928	华夏航空	76,100	531,939.00	0.07
344	600388	龙净环保	36,300	528,165.00	0.07
345	000035	中国天楹	109,100	526,953.00	0.07
346	688030	山石网科	33,299	525,791.21	0.07
347	688593	新相微	13,500	525,420.00	0.07
348	301358	湖南裕能	6,900	523,503.00	0.07
349	688658	悦康药业	40,700	523,402.00	0.07
350	688228	开普云	6,700	518,178.00	0.07
351	301276	嘉曼服饰	24,200	515,944.00	0.07
352	688378	奥来德	8,300	514,600.00	0.07
353	000157	中联重科	73,800	514,386.00	0.07
354	000060	中金岭南	67,700	512,489.00	0.07
355	601168	西部矿业	18,500	502,090.00	0.07
356	688552	航天南湖	17,800	500,714.00	0.07
357	001336	楚环科技	22,500	495,450.00	0.07
358	301123	奕东电子	4,100	494,952.00	0.07
359	601390	中国中铁	118,100	492,477.00	0.07
360	300049	福瑞医科	12,600	489,888.00	0.07
361	300756	金马游乐	14,580	481,869.00	0.07
362	603091	众鑫股份	9,860	480,872.20	0.07
363	603345	安井食品	5,900	473,121.00	0.07
364	688543	国科军工	11,800	465,510.00	0.07
365	301325	曼恩斯特	13,500	465,075.00	0.07
366	301515	港通医疗	26,400	462,792.00	0.07
367	688130	晶华微	16,400	461,168.00	0.06
368	002534	西子洁能	24,800	460,040.00	0.06
369	002649	博彦科技	56,400	459,096.00	0.06

370	300613	富瀚微	5,700	456,456.00	0.06
371	603829	洛凯股份	27,700	453,449.00	0.06
372	300363	博腾股份	27,600	448,224.00	0.06
373	300540	蜀道装备	11,800	447,220.00	0.06
374	002345	潮宏基	48,500	444,745.00	0.06
375	603105	芯能科技	65,100	443,331.00	0.06
376	688652	京仪装备	2,200	440,374.00	0.06
377	002993	奥海科技	6,000	429,660.00	0.06
378	600487	亨通光电	3,900	426,426.00	0.06
379	688516	奥特维	7,400	424,686.00	0.06
380	002266	浙富控股	83,400	422,004.00	0.06
381	688416	恒烁股份	3,010	421,400.00	0.06
382	688211	中科微至	12,200	419,924.00	0.06
383	002826	易明医药	27,900	419,337.00	0.06
384	603237	五芳斋	33,800	418,444.00	0.06
385	601963	重庆银行	41,400	417,312.00	0.06
386	002859	洁美科技	3,800	416,138.00	0.06
387	605118	力鼎光电	11,900	415,191.00	0.06
388	301295	美硕科技	9,700	409,146.00	0.06
389	688281	华秦科技	8,120	407,867.60	0.06
390	001359	平安电工	3,250	407,062.50	0.06
391	688182	灿勤科技	9,400	404,858.00	0.06
392	600278	东方创业	68,700	403,956.00	0.06
393	603317	天味食品	31,000	403,310.00	0.06
394	600958	东方证券	42,700	403,088.00	0.06
395	301095	广立微	3,400	401,370.00	0.06
396	002458	益生股份	51,570	400,698.90	0.06
397	001248	华润新能源	39,416	398,495.76	0.06
398	000990	诚志股份	48,600	397,548.00	0.06
399	600233	圆通速递	25,200	396,900.00	0.06

400	000893	亚钾国际	9,700	396,633.00	0.06
401	300680	隆盛科技	17,300	393,056.00	0.06
402	301328	维峰电子	5,430	386,616.00	0.05
403	000690	宝新能源	82,100	385,870.00	0.05
404	688220	翱捷科技	3,100	385,392.00	0.05
405	605098	行动教育	7,100	384,536.00	0.05
406	002941	新疆交建	40,700	384,208.00	0.05
407	002131	利欧股份	80,800	383,800.00	0.05
408	600362	江西铜业	8,800	381,040.00	0.05
409	600037	歌华有线	60,600	379,962.00	0.05
410	000001	平安银行	37,700	378,885.00	0.05
411	002648	卫星化学	16,000	375,840.00	0.05
412	002081	金螳螂	86,600	374,978.00	0.05
413	601700	风范股份	85,600	373,216.00	0.05
414	002821	凯莱英	2,300	372,600.00	0.05
415	001230	劲旅环境	24,180	371,404.80	0.05
416	300075	数字政通	36,100	368,942.00	0.05
417	601375	中原证券	92,200	367,878.00	0.05
418	001311	多利科技	22,790	367,602.70	0.05
419	600716	凤凰股份	109,100	366,576.00	0.05
420	600460	士兰微	6,700	366,222.00	0.05
421	301042	安联锐视	5,460	364,182.00	0.05
422	301220	亚香股份	11,200	360,864.00	0.05
423	300337	银邦股份	30,800	359,128.00	0.05
424	603041	美思德	34,600	358,802.00	0.05
425	600519	贵州茅台	300	355,647.00	0.05
426	600577	精达股份	36,100	353,058.00	0.05
427	301117	佳缘科技	15,100	352,585.00	0.05
428	688208	道通科技	13,800	347,622.00	0.05
429	603587	地素时尚	31,100	345,521.00	0.05

430	688111	金山办公	1,600	340,880.00	0.05
431	601107	四川成渝	69,400	338,672.00	0.05
432	002545	东方铁塔	20,800	337,376.00	0.05
433	301263	泰恩康	16,440	336,855.60	0.05
434	600029	南方航空	65,000	336,700.00	0.05
435	603920	世运电路	7,000	336,280.00	0.05
436	603909	建发合诚	39,400	336,082.00	0.05
437	001286	陕西能源	32,800	332,592.00	0.05
438	603059	倍加洁	13,700	332,225.00	0.05
439	002436	兴森科技	6,500	331,175.00	0.05
440	601156	东航物流	20,500	330,460.00	0.05
441	600363	联创光电	9,200	329,176.00	0.05
442	000937	冀中能源	82,180	327,076.40	0.05
443	002017	东信和平	22,115	323,542.45	0.05
444	603297	永新光学	2,200	323,290.00	0.05
445	301206	三元生物	14,500	322,335.00	0.05
446	603538	美诺华	9,900	322,245.00	0.05
447	688095	福昕软件	5,400	320,922.00	0.05
448	601138	工业富联	4,400	317,460.00	0.04
449	300443	金雷股份	14,700	317,226.00	0.04
450	688561	奇安信	13,200	316,536.00	0.04
451	002645	华宏科技	11,480	315,814.80	0.04
452	605365	立达信	21,800	313,484.00	0.04
453	300876	蒙泰高新	21,700	310,961.00	0.04
454	002148	北纬科技	53,300	309,673.00	0.04
455	002930	宏川智慧	33,500	308,200.00	0.04
456	688166	博瑞医药	8,700	304,587.00	0.04
457	601226	华电科工	47,800	304,008.00	0.04
458	300583	赛托生物	27,000	303,210.00	0.04
459	301229	纽泰格	25,000	303,000.00	0.04

460	000878	云南铜业	18,900	300,132.00	0.04
461	300416	苏试试验	14,700	299,586.00	0.04
462	301173	毓恬冠佳	10,000	297,100.00	0.04
463	001308	康冠科技	14,200	296,212.00	0.04
464	001287	中电港	9,500	295,925.00	0.04
465	688787	海天瑞声	2,200	295,790.00	0.04
466	002151	北斗星通	9,300	295,275.00	0.04
467	301458	钧崑电子	5,000	292,300.00	0.04
468	301335	天元宠物	14,800	290,524.00	0.04
469	301126	达嘉维康	33,900	289,845.00	0.04
470	002212	天融信	48,300	288,834.00	0.04
471	301662	宏工科技	2,835	287,242.20	0.04
472	002714	牧原股份	8,200	286,918.00	0.04
473	688084	晶品特装	5,700	286,596.00	0.04
474	002396	星网锐捷	14,820	284,099.40	0.04
475	301548	崇德科技	3,200	284,064.00	0.04
476	300405	科隆股份	54,700	283,346.00	0.04
477	300171	东富龙	25,600	283,136.00	0.04
478	600639	浦东金桥	30,800	280,896.00	0.04
479	301280	珠城科技	5,540	280,157.80	0.04
480	301668	昊创瑞通	8,500	279,650.00	0.04
481	301227	森鹰窗业	10,980	276,805.80	0.04
482	603969	银龙股份	37,900	275,533.00	0.04
483	301101	明月镜片	10,100	275,124.00	0.04
484	600094	大名城	78,400	271,264.00	0.04
485	301509	金凯生科	8,900	270,649.00	0.04
486	600343	航天动力	9,600	268,992.00	0.04
487	300115	长盈精密	9,600	268,224.00	0.04
488	002875	安奈儿	18,000	267,480.00	0.04
489	001376	百通能源	25,600	266,240.00	0.04

490	600018	上港集团	56,400	266,208.00	0.04
491	603196	璞源材料	10,600	259,064.00	0.04
492	000988	华工科技	1,400	258,454.00	0.04
493	688808	联讯仪器	163	258,245.79	0.04
494	603225	新凤鸣	13,100	257,415.00	0.04
495	603031	安孚科技	4,800	255,600.00	0.04
496	688489	三未信安	11,200	254,240.00	0.04
497	300902	国安达	15,500	254,045.00	0.04
498	688381	帝奥微	4,700	251,450.00	0.04
499	600331	宏达股份	22,800	250,572.00	0.04
500	605058	澳弘电子	6,900	249,504.00	0.04
501	002885	京泉华	6,100	249,246.00	0.04
502	000030	富奥股份	64,400	249,228.00	0.04
503	600510	黑牡丹	33,200	247,672.00	0.03
504	301489	思泉新材	1,500	246,870.00	0.03
505	600919	江苏银行	22,900	246,862.00	0.03
506	603788	宁波高发	17,800	245,640.00	0.03
507	300814	中富电路	1,200	245,400.00	0.03
508	301511	德福科技	1,700	244,545.00	0.03
509	301225	恒勃股份	3,100	244,249.00	0.03
510	603275	众辰科技	6,400	243,648.00	0.03
511	300417	南华仪器	23,500	241,110.00	0.03
512	002979	雷赛智能	4,300	239,854.00	0.03
513	002011	盾安环境	22,600	239,786.00	0.03
514	002104	恒宝股份	23,200	239,192.00	0.03
515	002838	道恩股份	7,800	238,836.00	0.03
516	002996	顺博合金	40,200	237,180.00	0.03
517	603382	海阳科技	13,800	236,670.00	0.03
518	300645	正元智慧	20,100	236,577.00	0.03
519	603699	纽威股份	4,700	236,410.00	0.03

520	603048	浙江黎明	13,300	235,942.00	0.03
521	601699	潞安环能	16,500	235,620.00	0.03
522	601231	环旭电子	7,200	233,280.00	0.03
523	603786	科博达	5,700	233,187.00	0.03
524	300743	天地数码	15,800	230,522.00	0.03
525	300203	聚光科技	16,600	229,578.00	0.03
526	300977	深圳瑞捷	14,800	228,216.00	0.03
527	002865	钧达股份	3,800	226,784.00	0.03
528	600692	亚通股份	41,400	224,802.00	0.03
529	603124	江南新材	1,200	224,376.00	0.03
530	301163	宏德股份	10,100	224,018.00	0.03
531	600361	创新新材	62,200	223,920.00	0.03
532	688515	裕太微	900	223,884.00	0.03
533	300054	鼎龙股份	2,100	222,537.00	0.03
534	601916	浙商银行	84,000	220,920.00	0.03
535	301275	汉朔科技	4,900	220,010.00	0.03
536	301099	雅创电子	2,300	219,650.00	0.03
537	002155	湖南黄金	9,200	219,604.00	0.03
538	600841	动力新科	35,600	217,160.00	0.03
539	002493	荣盛石化	20,100	216,075.00	0.03
540	605099	共创草坪	6,600	212,520.00	0.03
541	600980	北矿科技	11,200	210,000.00	0.03
542	002179	中航光电	4,500	207,900.00	0.03
543	300037	新宙邦	2,200	204,270.00	0.03
544	603409	汇通控股	10,942	200,785.70	0.03
545	688609	九联科技	18,100	199,281.00	0.03
546	603527	众源新材	16,700	199,064.00	0.03
547	688299	长阳科技	11,900	198,849.00	0.03
548	300598	诚迈科技	7,000	198,800.00	0.03
549	000059	华锦股份	52,100	195,375.00	0.03

550	605196	华通线缆	7,400	193,140.00	0.03
551	301135	瑞德智能	11,700	192,699.00	0.03
552	301448	开创电气	4,200	190,596.00	0.03
553	600497	驰宏锌锗	15,700	190,127.00	0.03
554	301517	陕西华达	3,800	188,594.00	0.03
555	688820	盛合晶微	1,315	186,059.35	0.03
556	002574	明牌珠宝	44,800	185,920.00	0.03
557	000596	古井贡酒	2,300	183,540.00	0.03
558	688249	晶合集成	3,100	182,993.00	0.03
559	600346	恒力石化	10,200	180,642.00	0.03
560	001212	中旗新材	3,800	180,044.00	0.03
561	301190	善水科技	11,200	179,536.00	0.03
562	300457	赢合科技	8,500	179,180.00	0.03
563	603778	国晟科技	14,500	178,350.00	0.03
564	002320	海峡股份	28,100	176,187.00	0.02
565	605287	德才股份	4,200	174,258.00	0.02
566	605599	菜百股份	12,700	173,990.00	0.02
567	002812	恩捷股份	2,600	173,966.00	0.02
568	688107	安路科技	3,800	173,280.00	0.02
569	300969	恒帅股份	1,840	172,518.40	0.02
570	300517	海波重科	17,800	167,676.00	0.02
571	603803	瑞斯康达	14,000	164,360.00	0.02
572	300805	电声股份	22,600	163,850.00	0.02
573	603125	常青科技	4,925	161,244.50	0.02
574	300842	帝科股份	1,800	160,506.00	0.02
575	002488	金固股份	17,500	155,925.00	0.02
576	300700	岱勒新材	7,320	155,769.60	0.02
577	002391	长青股份	31,900	155,353.00	0.02
578	300480	光力科技	3,600	153,648.00	0.02
579	300445	康斯特	7,300	151,986.00	0.02

580	300155	安居宝	38,200	149,744.00	0.02
581	002138	顺络电子	2,000	146,200.00	0.02
582	301031	中熔电气	1,220	145,729.00	0.02
583	002163	海南发展	17,200	143,448.00	0.02
584	601628	中国人寿	4,000	141,400.00	0.02
585	000002	万科 A	47,400	140,304.00	0.02
586	688682	霍莱沃	3,600	140,040.00	0.02
587	300017	网宿科技	10,300	134,003.00	0.02
588	002123	梦网科技	18,200	130,858.00	0.02
589	688779	五矿新能	16,100	130,571.00	0.02
590	301252	同星科技	3,200	129,696.00	0.02
591	001378	德冠新材	7,200	128,952.00	0.02
592	600375	汉马科技	34,000	125,460.00	0.02
593	600326	西藏天路	19,300	124,871.00	0.02
594	001399	惠科股份	4,457	123,592.61	0.02
595	601162	天风证券	36,000	121,320.00	0.02
596	688218	江苏北人	2,200	120,912.00	0.02
597	688818	电科蓝天	1,717	120,430.38	0.02
598	000301	东方盛虹	10,500	120,225.00	0.02
599	605122	四方新材	11,100	119,658.00	0.02
600	300270	中威电子	9,100	118,391.00	0.02
601	688575	亚辉龙	13,500	118,260.00	0.02
602	300649	杭州园林	4,200	117,558.00	0.02
603	600426	华鲁恒升	4,900	117,208.00	0.02
604	600410	华胜天成	7,300	115,559.00	0.02
605	605286	同力天启	4,500	114,705.00	0.02
606	301682	宏明电子	714	114,282.84	0.02
607	002315	焦点科技	4,900	114,072.00	0.02
608	002468	申通快递	7,800	113,568.00	0.02
609	301268	铭利达	7,900	110,442.00	0.02

610	300841	康华生物	2,300	109,388.00	0.02
611	002338	奥普光电	1,900	108,680.00	0.02
612	002077	大港股份	5,600	108,024.00	0.02
613	600740	山西焦化	33,400	106,546.00	0.01
614	688167	炬光科技	300	106,263.00	0.01
615	301201	诚达药业	2,900	105,444.00	0.01
616	688679	通源环境	2,500	105,225.00	0.01
617	001289	龙源电力	6,700	104,721.00	0.01
618	301191	菲菱科思	920	104,466.00	0.01
619	300811	铂科新材	1,100	104,379.00	0.01
620	002466	天齐锂业	1,700	104,244.00	0.01
621	300057	万顺新材	11,500	99,820.00	0.01
622	301096	百诚医药	1,700	97,223.00	0.01
623	688690	纳微科技	2,200	97,020.00	0.01
624	688797	臻宝科技	207	97,014.69	0.01
625	601225	陕西煤业	4,751	96,682.85	0.01
626	600498	烽火通信	1,300	95,680.00	0.01
627	688510	航亚科技	4,000	95,520.00	0.01
628	002732	燕塘乳业	7,600	94,240.00	0.01
629	002324	普利特	7,800	94,146.00	0.01
630	600871	石化油服	44,300	89,929.00	0.01
631	300164	通源石油	11,200	89,600.00	0.01
632	001233	海安集团	2,000	89,400.00	0.01
633	603121	华培动力	7,600	89,300.00	0.01
634	600348	华阳股份	11,600	88,740.00	0.01
635	603171	税友股份	2,200	87,670.00	0.01
636	688651	盛邦安全	2,700	86,994.00	0.01
637	300127	银河磁体	3,100	86,645.00	0.01
638	688626	翔宇医疗	1,900	84,094.00	0.01
639	603127	昭衍新药	2,200	84,084.00	0.01

640	300139	晓程科技	2,300	84,065.00	0.01
641	600158	中体产业	12,400	83,576.00	0.01
642	688017	绿的谐波	200	83,572.00	0.01
643	301502	华阳智能	1,200	83,424.00	0.01
644	002918	蒙娜丽莎	8,300	83,415.00	0.01
645	300823	建科智能	5,700	83,106.00	0.01
646	300069	金利华电	2,600	82,758.00	0.01
647	300857	协创数据	240	81,576.00	0.01
648	300213	佳讯飞鸿	13,400	81,204.00	0.01
649	600654	中安科	29,800	79,268.00	0.01
650	000703	恒逸石化	5,800	78,706.00	0.01
651	300102	乾照光电	3,000	78,120.00	0.01
652	688195	腾景科技	400	77,032.00	0.01
653	688683	莱尔科技	2,000	75,840.00	0.01
654	600547	山东黄金	3,265	75,388.85	0.01
655	002335	科华数据	1,740	73,863.00	0.01
656	002666	德联集团	18,600	73,470.00	0.01
657	002506	协鑫集成	22,700	72,186.00	0.01
658	002988	豪美新材	3,200	70,592.00	0.01
659	301308	江波龙	100	70,380.00	0.01
660	600754	锦江酒店	3,900	70,161.00	0.01
661	603507	振江股份	2,100	69,069.00	0.01
662	600271	航天信息	10,400	68,432.00	0.01
663	603897	长城科技	2,100	68,166.00	0.01
664	301606	绿联科技	1,100	67,122.00	0.01
665	002250	联化科技	4,900	66,983.00	0.01
666	600501	航天晨光	4,200	66,066.00	0.01
667	600188	兖矿能源	3,700	65,749.00	0.01
668	301518	长华化学	2,500	65,500.00	0.01
669	002591	恒大高新	10,700	65,484.00	0.01

670	300234	开尔新材	5,500	64,460.00	0.01
671	301536	星宸科技	500	64,355.00	0.01
672	603988	中电电机	3,900	63,258.00	0.01
673	688205	德科立	300	62,457.00	0.01
674	301359	东南电子	3,900	61,932.00	0.01
675	688781	视涯科技	1,300	61,893.00	0.01
676	688049	炬芯科技	1,300	60,983.00	0.01
677	002156	通富微电	800	60,696.00	0.01
678	603276	恒兴新材	3,900	59,709.00	0.01
679	688758	赛分科技	2,700	59,427.00	0.01
680	603013	亚普股份	3,700	58,423.00	0.01
681	688293	奥浦迈	1,400	58,366.00	0.01
682	688717	艾罗能源	700	57,799.00	0.01
683	002943	宇晶股份	1,300	57,499.00	0.01
684	688712	北芯生命	1,500	53,880.00	0.01
685	688785	恒运昌	116	53,725.40	0.01
686	300535	达威股份	3,900	53,157.00	0.01
687	001221	悍高集团	1,300	52,286.00	0.01
688	002133	广宇集团	21,600	51,624.00	0.01
689	300074	华平股份	14,400	48,960.00	0.01
690	603703	盛洋科技	4,400	48,840.00	0.01
691	688698	伟创电气	900	47,205.00	0.01
692	301552	科力装备	2,000	44,660.00	0.01
693	300651	金陵体育	2,500	44,625.00	0.01
694	301363	美好医疗	2,240	41,059.20	0.01
695	600064	南京高科	5,700	40,641.00	0.01
696	688813	泰金新能	234	40,269.06	0.01
697	002653	海思科	600	39,804.00	0.01
698	688635	长进光子	128	39,448.32	0.01
699	001257	盛龙股份	1,743	36,149.82	0.01

700	301528	多浦乐	430	35,217.00	0.00
701	688286	敏芯股份	300	34,521.00	0.00
702	002452	长高电气	2,700	34,479.00	0.00
703	300628	亿联网络	1,000	33,820.00	0.00
704	601600	中国铝业	4,100	33,702.00	0.00
705	002142	宁波银行	1,100	32,659.00	0.00
706	603337	杰克科技	900	32,607.00	0.00
707	601288	农业银行	5,100	30,957.00	0.00
708	301161	唯万密封	800	30,888.00	0.00
709	603887	城地香江	3,200	29,888.00	0.00
710	300868	杰美特	200	29,342.00	0.00
711	603459	红板科技	330	27,825.60	0.00
712	300539	横河精密	1,300	26,481.00	0.00
713	300941	创识科技	1,900	26,087.00	0.00
714	301636	泽润新能	600	25,266.00	0.00
715	601668	中国建筑	5,700	24,738.00	0.00
716	603216	梦天家居	1,200	24,684.00	0.00
717	001365	天海电子	719	22,511.89	0.00
718	002111	威海广泰	2,500	22,500.00	0.00
719	300285	国瓷材料	200	20,636.00	0.00
720	688811	有研新材	834	20,124.42	0.00
721	002922	伊戈尔	600	19,680.00	0.00
722	300454	深信服	200	19,240.00	0.00
723	301696	三瑞智能	216	18,748.80	0.00
724	601898	中煤能源	1,500	18,270.00	0.00
725	300943	春晖智控	400	17,980.00	0.00
726	001237	惠康科技	285	16,740.90	0.00
727	301339	通行宝	1,620	16,572.60	0.00
728	002161	远望谷	3,000	16,140.00	0.00
729	301669	高特电子	546	15,506.40	0.00

730	301687	新广益	195	15,167.10	0.00
731	001393	维通利	387	15,089.13	0.00
732	603833	欧派家居	500	15,055.00	0.00
733	301531	春光集团	290	14,952.40	0.00
734	300113	顺网科技	800	14,568.00	0.00
735	301599	理奇智能	433	14,059.51	0.00
736	601112	振石股份	750	13,192.50	0.00
737	301680	固德电材	117	13,122.72	0.00
738	301683	慧谷新材	96	11,689.92	0.00
739	002246	北化股份	600	11,280.00	0.00
740	688816	易思维	177	10,106.70	0.00
741	603407	长裕集团	137	10,064.02	0.00
742	000619	海螺新材	1,800	7,920.00	0.00
743	301360	荣旗科技	106	7,259.94	0.00
744	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
745	603511	爱慕股份	500	5,750.00	0.00
746	300428	立中集团	300	5,454.00	0.00
747	301500	飞南资源	200	5,210.00	0.00
748	301580	爱迪特	80	5,146.40	0.00
749	300938	信测标准	100	4,988.00	0.00
750	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
751	000999	华润三九	129	2,901.21	0.00
752	603352	至信股份	112	2,858.24	0.00
753	603293	埃泰克	72	2,442.96	0.00
754	001312	福恩股份	134	2,248.52	0.00
755	001323	慕思股份	110	1,738.00	0.00
756	603284	林平发展	46	1,604.02	0.00
757	001220	世盟股份	57	1,583.46	0.00
758	603939	益丰药房	80	1,438.40	0.00
759	600161	天坛生物	108	1,250.64	0.00

760	603871	嘉友国际	118	1,204.78	0.00
761	003019	宸展光电	35	1,139.25	0.00
762	603277	银都股份	110	1,097.80	0.00
763	300034	钢研高纳	60	1,028.40	0.00
764	002911	佛燃能源	98	930.02	0.00
765	601128	常熟银行	146	849.72	0.00
766	603858	步长制药	51	744.60	0.00
767	600998	九州通	84	393.96	0.00
768	000567	海德股份	54	322.38	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000923	河钢资源	30,091,207.00	4.06
2	000776	广发证券	27,094,601.00	3.65
3	002371	北方华创	27,093,772.60	3.65
4	002738	中矿资源	24,606,288.00	3.32
5	688235	百济神州	24,478,517.57	3.30
6	300033	同花顺	21,823,740.01	2.94
7	601995	中金公司	20,811,037.00	2.81
8	300604	长川科技	20,504,572.77	2.77
9	002558	巨人网络	20,254,497.00	2.73
10	601688	华泰证券	20,214,154.00	2.73
11	002128	电投能源	19,854,938.00	2.68
12	000166	申万宏源	18,739,644.85	2.53
13	002379	宏桥控股	18,711,048.00	2.52
14	000001	平安银行	18,148,278.00	2.45
15	601668	中国建筑	18,110,168.00	2.44
16	001389	广合科技	17,488,356.00	2.36
17	301328	维峰电子	17,219,272.90	2.32

18	301090	华润材料	17,144,597.00	2.31
19	603979	金诚信	17,052,815.00	2.30
20	300756	金马游乐	17,017,717.00	2.29
21	601336	新华保险	16,640,902.00	2.24
22	002414	高德红外	16,498,093.00	2.22
23	000408	藏格矿业	16,482,590.00	2.22
24	000725	京东方 A	16,287,308.80	2.20
25	600958	东方证券	15,846,873.60	2.14
26	002736	国信证券	15,779,573.00	2.13
27	300919	中伟新材	15,522,796.00	2.09
28	300132	青松股份	15,519,860.00	2.09
29	300308	中际旭创	15,304,122.00	2.06
30	300628	亿联网络	15,286,065.00	2.06
31	688111	金山办公	15,125,535.20	2.04

注：“买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	000776	广发证券	32,628,052.00	4.40
2	002371	北方华创	28,227,301.60	3.81
3	000923	河钢资源	27,646,107.00	3.73
4	601336	新华保险	22,832,232.66	3.08
5	300604	长川科技	22,522,507.00	3.04
6	300033	同花顺	22,046,957.60	2.97
7	000166	申万宏源	21,423,592.94	2.89
8	600378	昊华科技	21,384,579.48	2.88
9	688235	百济神州	20,715,397.79	2.79
10	601668	中国建筑	20,625,759.36	2.78
11	002128	电投能源	20,401,640.00	2.75
12	603379	三美股份	20,310,289.00	2.74

13	002736	国信证券	20,113,275.00	2.71
14	002414	高德红外	20,068,256.00	2.71
15	601995	中金公司	19,642,550.00	2.65
16	000001	平安银行	19,260,213.00	2.60
17	601688	华泰证券	18,768,853.00	2.53
18	301328	维峰电子	18,749,731.70	2.53
19	002738	中矿资源	18,582,601.00	2.51
20	002558	巨人网络	18,534,815.38	2.50
21	603979	金诚信	18,524,854.00	2.50
22	000725	京东方 A	18,209,276.40	2.46
23	001389	广合科技	17,680,650.32	2.38
24	601628	中国人寿	17,657,331.00	2.38
25	300308	中际旭创	17,639,923.00	2.38
26	002850	科达利	17,059,336.00	2.30
27	301589	诺瓦星云	17,052,066.10	2.30
28	300756	金马游乐	16,249,322.00	2.19
29	300428	立中集团	16,243,474.00	2.19
30	300496	中科创达	16,230,364.32	2.19
31	301035	润丰股份	16,218,263.00	2.19
32	000157	中联重科	16,082,874.78	2.17
33	300628	亿联网络	16,000,264.80	2.16
34	000878	云南铜业	15,907,001.00	2.15
35	000408	藏格矿业	15,823,501.00	2.13
36	000933	神火股份	15,661,088.00	2.11
37	301603	乔锋智能	15,632,273.00	2.11
38	300132	青松股份	15,341,302.00	2.07
39	600958	东方证券	15,160,898.32	2.04
40	301536	星宸科技	15,157,768.00	2.04
41	002380	科远智慧	15,002,220.00	2.02
42	002008	大族激光	14,963,330.00	2.02

43	600999	招商证券	14,841,136.00	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。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	5,762,120,077.36
卖出股票收入（成交）总额	5,876,230,319.67

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。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末无国债期货投资。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货投资。

7.12 本报告期投资基金情况

7.12.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

7.13 投资组合报告附注

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

7.13.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同约定的备选股票库。

7.13.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	696,270.94
2	应收清算款	16,934,992.67
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	561,982.41
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	18,193,246.02

7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.13.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基 金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比 例	持有份额	占总份额比 例
华夏智胜价 值成长股票 A	14,034	13,329.33	40,906,750.64	21.87%	146,157,102.14	78.13%

华夏智胜价值成长股票 C	15,799	6,739.14	47,622,142.66	44.73%	58,849,552.76	55.27%
合计	29,833	9,839.29	88,528,893.30	30.16%	205,006,654.90	69.84%

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。

8.2 盈利投资者数量占比

项目	过去一年（2025 年 7 月 1 日-2026 年 6 月 30 日）
盈利投资者数量占比	94.25%

注：盈利投资者数量占比=盈利投资者数量/投资者总数

其中，投资者指指标计算期间持有过基金份额的投资者，盈利投资者指投资者区间净收益不小于零的投资者。

投资者区间净收益=投资者区间收益-基金交易手续费（认申购费、赎回费、转换费等）。其中，区间收益=持有期末市值-持有期初市值+（赎回+转出+非交易过户出）-（认购+申购+定投+转入+非交易过户入）+现金分红

该指标计算时剔除持有期限不满 7 日的交易。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	华夏智胜价值成长股票 A	641,387.21	0.34%
	华夏智胜价值成长股票 C	8,271.11	0.01%
	合计	649,658.32	0.22%

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

8.5 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。

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华夏智胜价值成长股票 A	华夏智胜价值成长股票 C
基金合同生效日（2018 年 3 月 6 日）基金份 额总额	10,903,772.92	-
本报告期期初基金份额总额	195,541,461.45	145,325,897.97
本报告期基金总申购份额	147,160,035.70	109,190,566.95
减：本报告期基金总赎回份额	155,637,644.37	148,044,769.50
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	187,063,852.78	106,471,695.42

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，基金托管人无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期未发生影响基金管理人经营或公募基金运营业务的诉讼。

本报告期内，无涉及基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金所聘用的会计师事务所未发生改变。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人未受到调查或处罚。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人相关从业人员未受到调查或处罚。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的基金托管业务不涉及受调查或处罚等情况。

10.6.4 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。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过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	
兴业证券	1	5,279,955,829.91	45.38%	506,444.74	45.38%	-
国泰海通证券	2	1,763,240,099.92	15.15%	169,077.56	15.15%	-
方正证券	2	1,202,927,823.92	10.34%	115,360.47	10.34%	-
平安证券	1	1,112,111,855.23	9.56%	106,638.45	9.56%	-
国金证券	2	873,289,398.03	7.51%	83,757.00	7.51%	-
广发证券	2	709,201,478.29	6.10%	68,016.97	6.10%	-
中金公司	6	694,773,459.07	5.97%	66,641.98	5.97%	-

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、国海证券、国联民生证券、国信证券、华泰证券、华西证券、江海证券、金元证券、联储证券、上海证券、申万宏源证券、西部证券、招商证券、中泰证券、中信建投证券、中信证券的交易单元作为本基金交易单元，本报告期无股票交易及应付佣金。

⑤本报告期内，本基金租用的券商交易单元未发生变更。

10.7.2 基金租用或者通过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
兴业证券	11,172.00	2.25%	-	-	-	-	-	-
国泰海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	4,219.60	0.85%	-	-	-	-	-	-
平安证券	297,091.01	59.76%	-	-	-	-	-	-
国金证券	74,914.30	15.07%	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	109,780.72	22.08%	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-01-22
2	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	2026-03-26

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	2026-04-03
4	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-04-15
5	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-04-16
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	2026-04-18
7	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-06-04
8	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	2026-06-18
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	2026-06-26

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金本报告期无需要披露的单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予基金转型的文件；
- 2、基金合同；
- 3、托管协议；
- 4、法律意见书；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照。

12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

12.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的住所免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

华夏基金管理有限公司

二〇二六年八月三十一日