

# 华夏回报证券投资基金

**2022 年中期报告**

**2022 年 6 月 30 日**

基金管理人：华夏基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二二年八月三十日

## §1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 8 月 26 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 2022 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	1
§2 基金简介.....	3
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	4
3.1 主要会计数据和财务指标.....	4
3.2 基金净值表现.....	4
§4 管理人报告.....	5
§5 托管人报告.....	10
§6 中期报告财务会计报告（未经审计）.....	11
6.1 资产负债表.....	11
6.2 利润表.....	12
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	13
6.4 报表附注.....	15
§7 投资组合报告.....	38
7.1 期末基金资产组合情况.....	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	39
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	42
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	43
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.....	43
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.....	44
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.....	44
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.....	44
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	44
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	44
7.12 投资组合报告附注.....	44
§8 基金份额持有人信息.....	45
§9 开放式基金份额变动.....	45
§10 重大事件揭示.....	46
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	48
§12 备查文件目录.....	49

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华夏回报证券投资基金	
基金简称	华夏回报混合	
基金主代码	002001	
交易代码	002001(前端)	002002(后端)
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2003 年 9 月 5 日	
基金管理人	华夏基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	9,356,487,820.12 份	
基金合同存续期	不定期	

注：投资者通过中国内地的销售机构申购基金份额时仅可申购 A 类基金份额（002001（前端）、002002（后端）），投资者通过香港的销售机构申购基金份额时仅可申购 H 类基金份额（960002）。

### 2.2 基金产品说明

投资目标	尽量避免基金资产损失，追求每年较高的绝对回报。
投资策略	主要投资策略包括资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略等。在股票投资策略上，本基金股票投资部分主要采取价值型投资策略。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为绝对回报标准，为同期一年期定期存款利率。
风险收益特征	本基金在证券投资基金中属于中等风险的品种，其长期平均的预期收益和风险高于债券基金，低于股票基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	华夏基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李彬
	联系电话	400-818-6666
	电子邮箱	service@ChinaAMC.com
客户服务电话	400-818-6666	95566
传真	010-63136700	010-66594942
注册地址	北京市顺义区安庆大街甲3号院	北京市西城区复兴门内大街1号
办公地址	北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座8层	北京市西城区复兴门内大街1号
邮政编码	100033	100818
法定代表人	杨明辉	刘连舸

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
----------------	--------

登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.ChinaAMC.com
基金中期报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	华夏基金管理有限公司	北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 8 层

## §3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	-44,482,397.08
本期利润	-466,731,374.20
加权平均基金份额本期利润	-0.0495
本期加权平均净值利润率	-3.64%
本期基金份额净值增长率	-3.28%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022年6月30日)
期末可供分配利润	-59,236,002.57
期末可供分配基金份额利润	-0.0063
期末基金资产净值	13,115,594,494.58
期末基金份额净值	1.402
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022年6月30日)
基金份额累计净值增长率	1,549.97%

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

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

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

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	4.78%	0.47%	0.12%	0.00%	4.66%	0.47%
过去三个	5.10%	0.62%	0.37%	0.00%	4.73%	0.62%

月						
过去六个月	-3.28%	0.75%	0.74%	0.00%	-4.02%	0.75%
过去一年	-17.77%	0.97%	1.50%	0.00%	-19.27%	0.97%
过去三年	35.53%	1.06%	4.50%	0.00%	31.03%	1.06%
自基金合同生效起至今	1,549.97%	1.02%	44.42%	0.00%	1,505.55%	1.02%

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

华夏回报证券投资基金

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

(2003 年 9 月 5 日至 2022 年 6 月 30 日)



## §4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

华夏基金管理有限公司成立于 1998 年 4 月 9 日，是经中国证监会批准成立的首批全国性基金管理公司之一。公司总部设在北京，在北京、上海、深圳、成都、南京、杭州、广州和青岛设有分公司，在香港、深圳、上海设有子公司。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、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，以及特定客户资产管理人、保险资金投资管理人，香港子公司是首批 RQFII 基金管理人。华夏基金是业务领域最广泛的基金管理公司之一。

华夏基金是境内 ETF 基金资产管理规模最大的基金管理公司之一，在 ETF 基金管理方面积累了丰富的经验，形成了覆盖大盘蓝筹、宽基指数、中小创指数、主题指数、行业指数、Smart Beta 策略、海外市场指数、信用债指数、商品指数等较为完整的产品线。

华夏基金以深入的投资研究为基础，尽力捕捉市场机会，为投资人谋求良好的回报。根据银河证券基金研究中心《中国基金业绩评价报告》，截至 2022 年 6 月 30 日，华夏基金旗下多只产品近 1 年同类排名领先（基金排名不作为产品未来表现的保证），其中：

主动权益产品：在偏股型基金(股票上限 95%)(A 类)中华夏兴和混合排序第 1/188、华夏兴华混合(A 类)排序第 16/188；在养老目标日期 FOF(2040)(A 类)中华夏养老 2040 三年持有混合（FOF）排序第 2/14；在定开偏股型基金(A 类)中华夏磐利一年定开混合(A 类)排序第 2/77、华夏磐锐一年定开混合(A 类)排序第 10/77、华夏磐益一年定开混合排序第 11/77、华夏成长精选 6 个月定开混合(A 类)排序第 24/77；在医药医疗健康行业偏股型基金(股票上下限 60%-95%)(A 类)中华夏逸享健康混合(A 类)排序第 9/52；在消费行业偏股型基金(股票上下限 60%-95%)(A 类)中华夏网购精选混合(A 类)排序第 10/53；在偏股型基金(股票上限 80%)(A 类)中华夏经典混合排序第 22/134；在偏股型基金(股票上下限 60%-95%)(A 类)中华夏行业景气混合排序第 29/905、华夏产业升级混合(A 类)排序第 55/905、华夏盛世混合排序第 67/905；在标准股票型基金(A 类)中华夏智胜价值成长股票(A 类)排序第 59/286；在灵活配置型基金(基准股票比例 60%-100%)(A 类)中华夏圆和混合(A 类)排序第 74/436。

固收与固收+产品：在 QDII 债券型基金(A 类)中华夏大中华信用债券(QDII)(A 类)排序第 1/25；在信用债指数债券型基金(A 类)中华夏亚债中国指数(A 类)排序第 3/13；在利率债指数债券型基金(A 类)中华夏中债 3-5 年政金债指数(A 类)排序第 7/98；在中短期纯债债券型基金(A 类)中华夏中短债债券(A 类)排序第 21/84；在长期纯债债券型基金(A 类)中华夏鼎航债券(A 类)排序第 28/642；在偏债型基金(A 类)中华夏磐泰混合（LOF）(A 类)排序第 32/350、华夏睿磐泰盛混合排序第 36/350、华夏永康添福混合(A 类)排序第 46/350、华夏睿磐泰利混合(A 类)排序第 63/350。

指数与量化产品：在 QDII 跨境股票 ETF 基金中华夏纳斯达克 100ETF（QDII）排序第 4/19；在规模指数股票 ETF 基金中华夏中证 1000ETF 排序第 3/116、华夏中证 500ETF 排序第 18/116；在主题指数股票 ETF 联接基金(A 类)中华夏中证四川国改 ETF 联接(A 类)排序第 3/60、华夏中证央企 ETF 联接(A 类)排序第 15/60；在行业指数股票 ETF 联接基金(A 类)中华夏中证全指房地产 ETF 联接(A 类)

排序第 4/24、华夏中证银行 ETF 联接(A 类)排序第 6/24；在行业指数股票 ETF 基金中华夏中证全指房地产 ETF 排序第 7/41、华夏中证银行 ETF 排序第 10/41；在规模指数股票 ETF 联接基金(A 类)中华夏中证 500ETF 联接(A 类)排序第 15/80；在主题指数股票 ETF 基金中华夏中证新能源 ETF 排序第 14/169、华夏中证四川国改 ETF 排序第 17/169、华夏中证新能源汽车 ETF 排序第 24/169。

在证券时报主办的第十七届中国基金业明星基金奖评选活动上，在最具含金量、最能体现基金公司综合实力的“年度十大明星基金公司奖”评选中，华夏基金凭借在多项业务中的优异中长期表现，成功获奖。此外，凭借 QDII 基金的良好业绩表现，以及在境内外市场的持续布局，华夏基金还获得“三年海外投资明星基金公司奖”。

在客户服务方面，2022 年上半年，华夏基金继续以客户需求为导向，努力提高客户使用的便利性和服务体验：（1）华夏基金直销上线北京银行、广发银行快捷等支付方式，拓展支付渠道的同时交易额度也得到进一步提升，满足客户支付需求；（2）华夏基金管家客户端优化资料上传、定投收益展示等功能，增加客户操作便利性；（3）与兰州银行、九江银行、晋商银行、九州证券等代销机构合作，拓展更加丰富的客户理财渠道；（4）开展“压岁钱手账”、“基金视力表”、“与干饭人灵魂相认”、“童言童语话理财”、“FOF 产品不是小透明”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		
季新星	本基金的基金经理	2021-11-02	-	13 年	硕士。曾任申万菱信基金管理有限公司权益投资部研究员、申万菱信消费增长混合型证券投资基金基金经理、申万菱信新动力混合型证券投资基金基金经理。2020 年 7 月加入华夏基金管理有限公司。
阳琨	本基金的基金经理、公司投资总监、投委会成员	2021-11-02	-	27 年	硕士。曾任宝盈基金基金经理助理，益民基金投资部部门经理，中国对外经济贸易信托投资有限公司财务部部门经理等。2006 年 8 月加入华夏基金管理有限公司。历任策略研究员、股票投资部副总经理、兴和证券投资基金基金经理（2009 年 1 月 1 日至 2012 年 1 月 12 日期间）、兴华证券投



					<p>资基金基金经理（2007年6月12日至2013年4月11日期间）、华夏盛世精选混合型证券投资基金基金经理（2009年12月18日至2015年9月1日期间）、华夏大盘精选证券投资基金基金经理（2015年9月1日至2017年5月2日期间）、华夏大中华企业精选灵活配置混合型证券投资基金（QDII）基金经理（2016年1月20日至2018年10月11日期间）、华夏新时代灵活配置混合型证券投资基金（QDII）基金经理（2018年5月30日至2019年7月15日期间）等。</p>
--	--	--	--	--	---

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《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，本基金管理人旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易共有54次，其中3次为投资策略需要所致，为不同基金经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易，有关基金经理已根据公司管理要

求提供决策依据；其余均为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。

#### 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

2022 年上半年，国内股票市场波动较大。年初受到俄乌冲突及国内疫情反复的影响，加上投资者担心成长股估值偏高，股票市场出现了单边下跌，跌速较快且幅度较深。在 5 月份以后，随着国内疫情得到较好控制，加上国家稳经济的政策渐次出台，投资者情绪明显修复，市场也出现了快速的反弹。截至上半年期末，沪深 300 指数和创业板指数均相较前期的低点有了明显反弹。以新能源车、光伏等成长类股票在本轮反弹中表现较突出，新能源车及光伏电池的销售在今年上半年显著超出市场预期，给投资者较强的信心，板块内个股估值提升明显。一季度相对抗跌的价值类股票在二季度反弹中相对平淡，投资者对国内房地产市场投资能否在近期企稳恢复的信心仍显不足。一年多以来受益于商品价格上涨的煤炭、有色金属类资源类股票也有较大的涨幅，但波动较大。上半年海外股票市场在经济出现滞涨现象的压力下普遍表现不佳，美联储承认前期低估了通胀的压力，并明确提高了加息的力度。海外投资者预期大幅下调，市场担心各央行较快的加息步伐可能导致发达经济体进入衰退阶段。

本基金在 2022 年一季度降低了组合股票持仓，以防御经济下行的风险。因此在二季度后半期的市场反弹中仓位略显不足，组合选股也偏重下行风险的考量，对成长性较好但波动性较大的股票略显谨慎，基金净值整体表现一般。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2022 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.402 元，本报告期份额净值增长率为-3.28%，同期业绩比较基准增长率为 0.74%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

经过上半年的先跌后涨之后，我们预期国内股票市场转向震荡。一方面国内经济环境在度过上半年疫情的考验后，在三季度可能迎来环比改善的机会。但成长类股票的快速反弹已经部分体现了投资者对新能源车、光伏等行业成长性的乐观预期。从实体经济的角度看，企业收入及盈利的全面好转需要一个过程。客观地说，在复杂的国际国内经济环境下，稳增长的道路仍是错综复杂的。另一方面，海外主要经济体面临的经济挑战仍比较严峻，俄乌冲突以及新冠疫情给全球通胀带来明显的压力。以美国为例，美联储大幅调高了加息及缩表的政策预期。较高的资金利率是对抗通胀的一种方法，但也可能带来对需求的压制，从而对资产价格带来不利影响。二季度，海外市场主要股票指数都出现了较明显的下跌。展望未来，我们认为国内股票市场可能会进入震荡期，需要消化市场反弹后明显上升的估值水平，并等待企业盈利情况的进一步验证。从行业结构上看，我们依旧看好

智能电动车产业链、绿色能源产业链、半导体产业链以及军工产业链中优质公司的成长机会。

我们将继续坚持回报系列基金的风格特征，在注重净值波动风险的前提下，努力把握市场机会。我们将主要通过个股选择创造超额收益，争取以个股的确定性对抗市场的不确定性，争取以专业投资为持有人提供理想的回报。

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

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》及本基金的基金合同等规定，本基金本报告期实施利润分配 1 次，符合相关法规及基金合同的规定。

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

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

## §5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在华夏回报证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回

价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

## §6 中期报告财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：华夏回报证券投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	798,590,988.44	1,832,783,286.85
结算备付金		3,335,631.27	5,273,357.61
存出保证金		817,647.75	1,058,893.45
交易性金融资产	6.4.7.2	10,917,870,070.57	11,489,848,081.34
其中：股票投资		5,855,158,214.54	7,312,148,813.18
基金投资		-	-
债券投资		5,062,711,856.03	4,177,699,268.16
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	1,500,167,808.21	491,421,327.71
应收清算款		-	72,384.29
应收股利		-	-
应收申购款		2,063,743.50	4,901,264.41
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	71,289,794.98
资产总计		13,222,845,889.74	13,896,648,390.64
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2021 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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		50,740,012.69	-
应付赎回款		19,265,724.03	15,342,643.97
应付管理人报酬		15,723,729.12	17,940,723.86
应付托管费		2,620,621.53	2,990,120.65
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		78,863.73	78,727.76
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	18,822,444.06	19,532,029.38
负债合计		107,251,395.16	55,884,245.62
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	9,356,487,820.12	9,444,816,091.35
未分配利润	6.4.7.8	3,759,106,674.46	4,395,948,053.67
净资产合计		13,115,594,494.58	13,840,764,145.02
负债和净资产总计		13,222,845,889.74	13,896,648,390.64

注：①报告截止日 2022 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.402 元，基金份额总额 9,356,487,820.12 份。

②以下比较数据已根据本年《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>》中的资产负债表格式的要求进行列示：2021 年年度报告资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目的“本期末”余额合并列示在 2022 年中期报告资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额，2021 年年度报告资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在 2022 年中期报告资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额。

## 6.2 利润表

会计主体：华夏回报证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-355,169,702.86	432,447,537.65
1.利息收入		4,162,210.81	76,145,042.29
其中：存款利息收入	6.4.7.9	2,322,364.23	2,973,187.05
债券利息收入		-	68,429,821.41

资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		1,839,846.58	4,742,033.83
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		61,635,392.01	1,082,648,342.17
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-76,134,458.91	1,037,764,841.50
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	80,022,029.49	5,919,388.36
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	-	-
股利收益	6.4.7.14	57,747,821.43	38,964,112.31
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	-422,248,977.12	-731,261,063.00
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	1,281,671.44	4,915,216.19
<b>减：二、营业总支出</b>		111,561,671.34	147,890,402.15
1.管理人报酬		95,498,226.63	120,640,954.18
2.托管费		15,916,371.10	20,106,825.66
3.销售服务费		-	-
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		-	346,221.65
其中：卖出回购金融资产支出		-	346,221.65
6.信用减值损失	6.4.7.17	-	-
7.税金及附加		216.72	420.69
8.其他费用	6.4.7.18	146,856.89	6,795,979.97
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-466,731,374.20	284,557,135.50
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-466,731,374.20	284,557,135.50
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-466,731,374.20	284,557,135.50

注：以下比较数据已根据本年《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>》中的利润表格式的要求进行列示：2021 年中期报告利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在 2022 年中期报告利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：华夏回报证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合 收益 (若有)	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产 (基金净值)	9,444,816,091.35	-	4,395,948,053.67	13,840,764,145.02
二、本期期初净资产 (基金净值)	9,444,816,091.35	-	4,395,948,053.67	13,840,764,145.02
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-88,328,271.23	-	-636,841,379.21	-725,169,650.44
(一)、综合收益总额	-	-	-466,731,374.20	-466,731,374.20
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)	-88,328,271.23	-	-28,820,541.24	-117,148,812.47
其中: 1.基金申购款	642,314,385.94	-	235,535,492.08	877,849,878.02
2.基金赎回款	-730,642,657.17	-	-264,356,033.32	-994,998,690.49
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动 (净值减少以“-”号填列)	-	-	-141,289,463.77	-141,289,463.77
四、本期期末净资产 (基金净值)	9,356,487,820.12	-	3,759,106,674.46	13,115,594,494.58
项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合 收益 (若有)	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产 (基金净值)	7,957,194,040.08	-	8,348,062,996.12	16,305,257,036.20
二、本期期初净资产 (基金净值)	7,957,194,040.08	-	8,348,062,996.12	16,305,257,036.20
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	537,962,478.90	-	-165,202,371.26	372,760,107.64
(一)、综合收益总额	-	-	284,557,135.50	284,557,135.50
(二)、本期基金	537,962,478.90	-	529,763,656.04	1,067,726,134.94

份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）				
其中：1.基金申购款	2,303,247,469.32	-	2,295,981,411.51	4,599,228,880.83
2.基金赎回款	-1,765,284,990.42	-	-1,766,217,755.47	-3,531,502,745.89
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-979,523,162.80	-979,523,162.80
四、本期期末净资产（基金净值）	8,495,156,518.98	-	8,182,860,624.86	16,678,017,143.84

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：杨明辉，主管会计工作负责人：朱威，会计机构负责人：朱威

#### 6.4 报表附注

##### 6.4.1 基金基本情况

华夏回报证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监基金字[2003]86号《关于同意华夏回报证券投资基金设立的批复》核准，由基金发起人华夏基金管理有限公司依照《证券投资基金管理暂行办法》（于2004年9月16日废止，由《中华人民共和国证券投资基金法》取代）、《开放式证券投资基金试点办法》（已废止）等有关规定和《华夏回报证券投资基金基金契约》（于2004年10月15日改为《华夏回报证券投资基金基金合同》）发起，并于2003年9月5日募集成立。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集3,796,885,823.40元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道验字（2003）第112号验资报告予以验证。有关基金设立等文件已按规定向中国证监会备案。本基金的基金管理人为华夏基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。根据基金管理人2015年7月2日刊登的《华夏基金管理有限公司关于修订华夏回报证券投资基金基金合同的公告》，本基金自2015年7月2日起增加H类基金份额类别。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《华夏回报证券投资基金基金合同》等有关规定，本基金的投资范围限于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发行上市的股票（含存托凭证）、债券、权证、资产支持证券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。其中债券包括国债、金融债、企业（公司）债（包括可转债）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》、各项具体会计准则及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会发布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》和中国证监会、中国基金业协会允许的如财务报表附注 6.4.4 所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

除下述变更后的会计政策外,本基金报告期所采用的其他会计政策、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

根据《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》、《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》(统称“新金融工具准则”)、《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》的规定和相关法律法规的要求,本基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。根据衔接规定,对可比期间信息不予调整,首日执行新金融工具准则的累积影响数调整本报告期期初未分配利润。

新金融工具准则改变了金融资产的分类和计量方式,将金融工具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。本基金考虑自身业务模式,以及金融资产的合同现金流特征进行上述分类。于 2021 年 12 月 31 日及 2022 年 1 月 1 日,本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

新金融工具准则要求对于以摊余成本计量的金融资产,以预期信用损失为基础确认损失准备。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。

于 2021 年 12 月 31 日,银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、交易性金融

资产、卖出回购金融资产款等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”或“应付利息”科目中。于 2022 年 1 月 1 日，根据新金融工具准则下的计量类别，将上述应计利息分别转入银行存款、结算备付金、存出保证金、交易性金融资产、买入返售金融资产、卖出回购金融资产款等科目项下列示，同时以摊余成本法计量的金融资产按照预期信用损失为基准，计提损失准备 0.00 元，对本基金期初未分配利润无影响。

于 2022 年 1 月 1 日，本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下：

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、应收利息、应收证券清算款和应收申购款，金额分别为 1,832,783,286.85 元、5,273,357.61 元、1,058,893.45 元、491,421,327.71 元、71,289,794.98 元、72,384.29 元和 4,901,264.41 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、其他资产-应收利息、应收清算款和应收申购款，金额分别为 1,832,993,840.58 元、5,275,967.91 元、1,059,417.60 元、491,530,122.94 元、0.00 元、72,384.29 元和 4,901,264.41 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 11,489,848,081.34 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 11,560,815,392.91 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 15,342,643.97 元、17,940,723.86 元、2,990,120.65 元、18,874,402.37 元和 657,627.01 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、其他负债-应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 15,342,643.97 元、17,940,723.86 元、2,990,120.65 元、18,874,402.37 元和 657,627.01 元。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 6.4.6 税项

根据财税[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]103 号《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81 号《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公

司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]125 号《财政部、国家税务总局、证监会关于内地与香港基金互认有关税收政策的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《财政部、国家税务总局关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《财政部、国家税务总局关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 以发行基金方式募集资金不属于增值税征收范围，不征收增值税。

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

(3) 基金买卖股票、债券的差价收入免征增值税，暂不征收企业所得税。

(4) 存款利息收入不征收增值税。

(5) 国债、地方政府债利息收入，金融同业往来利息收入免征增值税。

(6) 对基金取得的债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

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

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

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

缴纳印花税。

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

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

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位:人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
活期存款	798,590,988.44
等于: 本金	798,459,340.37
加: 应计利息	131,648.07
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	798,590,988.44

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位:人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	5,008,604,239.29	-	5,855,158,214.54	846,553,975.25
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	11,072.74	30,880,552.74	11,047,480.00
	银行间市场	4,964,765,056.08	67,924,803.29	-858,556.08
	合计	4,984,587,056.08	67,935,876.03	5,062,711,856.03
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-

其他	-	-	-	-
合计	9,993,191,295.37	67,935,876.03	10,917,870,070.57	856,742,899.17

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

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	1,500,167,808.21	-
合计	1,500,167,808.21	-

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 2022 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	500,000.00
应付赎回费	72,526.68
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	18,040,821.44
其中：交易所市场	18,020,621.51
银行间市场	20,199.93
应付利息	-
预提费用	209,095.94
合计	18,822,444.06

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额

上年度末	9,444,816,091.35	9,444,816,091.35
本期申购	642,314,385.94	642,314,385.94
本期赎回（以“-”号填列）	-730,642,657.17	-730,642,657.17
本期末	9,356,487,820.12	9,356,487,820.12

#### 6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	125,100,145.20	4,270,847,908.47	4,395,948,053.67
本期利润	-44,482,397.08	-422,248,977.12	-466,731,374.20
本期基金份额交易产生的变动数	1,435,713.08	-30,256,254.32	-28,820,541.24
其中：基金申购款	-3,414,801.92	238,950,294.00	235,535,492.08
基金赎回款	4,850,515.00	-269,206,548.32	-264,356,033.32
本期已分配利润	-141,289,463.77	-	-141,289,463.77
本期末	-59,236,002.57	3,818,342,677.03	3,759,106,674.46

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	2,283,329.79
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	32,334.16
其他	6,700.28
合计	2,322,364.23

#### 6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	4,481,312,522.88
减：卖出股票成本总额	4,545,701,639.44
减：交易费用	11,745,342.35
买卖股票差价收入	-76,134,458.91

#### 6.4.7.11 债券投资收益

##### 6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期

	2022年1月1日至2022年6月30日
债券投资收益——利息收入	75,154,586.57
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	4,867,442.92
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	80,022,029.49

#### 6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	6,551,110,054.13
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	6,496,503,608.41
减：应计利息总额	49,690,827.75
减：交易费用	48,175.05
买卖债券差价收入	4,867,442.92

#### 6.4.7.12 资产支持证券投资收益

无。

#### 6.4.7.13 衍生工具收益

##### 6.4.7.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

##### 6.4.7.13.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

#### 6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资产生的股利收益	57,747,821.43
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	57,747,821.43

#### 6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
1.交易性金融资产	-422,248,977.12
——股票投资	-427,535,967.37
——债券投资	5,286,990.25
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
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	-422,248,977.12

#### 6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
基金赎回费收入	1,281,671.44
基金申购费收入	-
合计	1,281,671.44

#### 6.4.7.17 信用减值损失

无。

#### 6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
审计费用	49,588.57
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	19,160.95
银行间账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	146,856.89

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项



截至财务报表批准日，本基金无资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

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

本基金本报告期不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华夏基金管理有限公司	基金管理人
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人
中信证券股份有限公司（“中信证券”）	基金管理人的股东

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 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021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	297,235,311.14	3.73%	813,538,226.83	18.10%

###### 6.4.10.1.2 权证交易

无。

###### 6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
中信证券	-	-	338,896.70	100.00%

###### 6.4.10.1.4 债券回购交易

无。

###### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期

	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
中信证券	276,807.22	4.26%	276,807.22	1.54%
关联方名称	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
中信证券	757,641.92	19.93%	757,641.92	5.17%

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月 30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30 日
当期发生的基金应支付的管理费	95,498,226.63	120,640,954.18
其中：支付销售机构的客户维护费	23,077,094.52	29,711,399.89

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 1.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

②基金管理人报酬计算公式为：日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×1.50%/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 2022年1月1日至2022年6月 30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30 日
当期发生的基金应支付的托管费	15,916,371.10	20,106,825.66

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 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

②基金托管费计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.25%/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

无。

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		上年度可比期间	
	2022年1月1日至2022年6月30日		2021年1月1日至2021年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行活期存款	798,590,988.44	2,283,329.79	833,212,485.47	2,938,278.76

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

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期					
2022年1月1日至2022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	600938	中国海油	新股发行	120,005	1,296,054.00
中信证券	688223	晶科能源	新股发行	213,000	1,065,000.00
中信证券	688326	经纬恒润	新股发行	6,832	826,672.00
中信证券	301200	大族数控	新股发行	8,566	655,812.96
中信证券	688302	海创药业	新股发行	13,082	561,479.44
中信证券	301109	军信股份	新股发行	12,250	426,422.50
中信证券	301302	华如科技	新股发行	4,651	241,991.53
中信证券	688150	莱特光电	新股发行	5,626	124,053.30
中信证券	688290	景业智能	新股发行	3,040	103,025.60

中信证券	603132	金徽股份	新股发行	1,342	14,493.60
中信证券	603191	望变电气	新股发行	1,149	13,627.14
中信证券	603209	兴通股份	新股发行	595	12,804.40
中信证券	001266	宏英智能	新股发行	247	9,536.67
中信证券	603215	比依股份	新股发行	575	7,187.50
中信证券	603051	鹿山新材	新股发行	272	7,014.88
上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 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	688819	天能股份	网下申购	28,382	1,186,083.78
中信证券	688660	电气风电	网下申购	51,238	278,734.72
中信证券	688276	百克生物	网下申购	3,486	126,716.10
中信证券	688617	惠泰医疗	网下申购	1,673	124,571.58
中信证券	688575	亚辉龙	网下申购	3,435	50,838.00
中信证券	300982	苏文电能	网下申购	3,170	50,181.10
中信证券	300993	玉马遮阳	网下申购	4,097	49,573.70
中信证券	688315	诺禾致源	网下申购	3,711	47,352.36
中信证券	300997	欢乐家	网下申购	9,279	45,838.26
中信证券	688607	康众医疗	网下申购	1,890	43,866.90
中信证券	300930	屹通新材	网下申购	3,220	42,214.20
中信证券	603529	爱玛科技	网下申购	1,019	28,389.34
中信证券	688690	纳微科技	网下申购	3,477	28,059.39
中信证券	300966	共同药业	网下申购	2,858	23,549.92
中信证券	688565	力源科技	网下申购	2,464	23,136.96
中信证券	688226	威腾电气	网下申购	2,693	17,289.06
中信证券	600916	中国黄金	网下申购	3,371	16,821.29
中信证券	605060	联德股份	网下申购	883	13,765.97
中信证券	605488	福莱新材	网下申购	416	8,498.88
中信证券	001208	华菱线缆	网下申购	1,754	6,437.18
中信证券	003040	楚天龙	网下申购	1,101	5,086.62
中信证券	601279	英利汽车	网下申购	2,004	4,148.28

注：本期“网上申购”和“网下申购”两种发行方式合并披露为“新股发行”。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

##### 6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日 (场外)	每 10 份基 金份 额分 红数	现金形式发 放总额	再投资形式 发放总额	利润分配合计	备注
1	2022-01-13	2022-01-13	0.150	46,528,460.13	94,761,003.64	141,289,463.77	-
合计			0.150	46,528,460.13	94,761,003.64	141,289,463.77	-

6.4.12 期末（2022 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券 代码	证券 名称	成功 认购日	受限期	流 通 受 限 类 型	认 购 价 格	期 末 估 值 单 价	数 量 ( 股)	期 末 成 本 总 额	期 末 估 值 总 额	备 注
688052	纳芯微	2022-04-14	6 个月	新发 流 通 受 限	230.00	350.81	6,090	1,400,700.00	2,136,432.90	-
600938	中国海油	2022-04-14	6 个月	新发 流 通 受 限	10.80	15.86	84,004	907,243.20	1,332,303.44	-
688120	华海清科	2022-05-30	6 个月	新发 流 通 受 限	136.66	217.12	4,822	658,974.52	1,046,952.64	-
688153	唯捷创芯	2022-04-01	6 个月	新发 流 通 受 限	66.60	44.24	7,674	511,088.40	339,497.76	-

688322	奥比中光	2022-06-30	1 个月内(含)	新发流通受限	30.99	30.99	8,529	264,313.71	264,313.71	-
301139	元道通信	2022-06-30	1 个月内(含)	新发流通受限	38.46	38.46	5,085	195,569.10	195,569.10	-
688150	莱特光电	2022-03-10	6 个月	新发流通受限	22.05	19.60	5,626	124,053.30	110,269.60	-
688283	坤恒顺维	2022-02-08	6 个月	新发流通受限	33.80	45.41	1,595	53,911.00	72,428.95	-
301236	软通动力	2022-03-08	6 个月	新发流通受限	72.88	31.38	2,076	100,865.92	65,144.88	含 证 券 送 配
301219	腾远钴业	2022-03-10	6 个月	新发流通受限	173.98	87.82	578	55,847.58	50,759.96	含 证 券 送 配
301200	大族数控	2022-02-18	6 个月	新发流通受限	76.56	51.92	857	65,611.92	44,495.44	-
301206	三元	2022-01-26	6 个月	新发	109.30	45.69	945	68,859.00	43,177.05	含 证 券

	生物			流通受限						券送配
301150	中一科技	2022-04-14	6 个月	新发流通受限	163.56	82.76	404	43,997.64	33,435.04	含证券送配
301109	军信股份	2022-04-06	6 个月	新发流通受限	34.81	16.14	1,838	42,642.25	29,665.32	含证券送配
301302	华如科技	2022-06-16	6 个月	新发流通受限	52.03	56.42	466	24,245.98	26,291.72	-
301268	铭利达	2022-03-29	6 个月	新发流通受限	28.50	34.87	641	18,268.50	22,351.67	-
301139	元道通信	2022-06-30	6 个月	新发流通受限	38.46	38.46	566	21,768.36	21,768.36	-
301122	采纳股份	2022-01-19	6 个月	新发流通受限	50.31	70.37	301	15,143.31	21,181.37	-
301102	兆讯传媒	2022-03-15	6 个月	新发流通	39.88	31.09	642	25,602.96	19,959.78	-

				受限						
301162	国能日新	2022-04-19	6 个月	新发流通受限	45.13	54.11	334	15,073.42	18,072.74	-
301123	奕东电子	2022-01-14	6 个月	新发流通受限	37.23	25.39	656	24,422.88	16,655.84	-
301103	何氏眼科	2022-03-14	6 个月	新发流通受限	42.50	32.02	507	16,575.00	16,234.14	含 证 券 送 配
301286	侨源股份	2022-06-06	6 个月	新发流通受限	16.91	19.79	784	13,257.44	15,515.36	-
301248	杰创智能	2022-04-13	6 个月	新发流通受限	39.07	29.87	472	18,441.04	14,098.64	-
301212	联盛化学	2022-04-07	6 个月	新发流通受限	29.67	33.28	416	12,342.72	13,844.48	-
301298	东利机械	2022-05-27	6 个月	新发流通受限	12.68	20.83	634	8,039.12	13,206.22	-



301148	嘉戎技术	2022-04-14	6 个月	新发流通受限	38.39	23.90	516	19,809.24	12,332.40	-
301259	艾布鲁	2022-04-18	6 个月	新发流通受限	18.39	24.94	483	8,882.37	12,046.02	-
301097	天益医疗	2022-03-25	6 个月	新发流通受限	52.37	47.83	249	13,040.13	11,909.67	-
301220	亚香股份	2022-06-15	6 个月	新发流通受限	35.98	39.15	285	10,254.30	11,157.75	-
301237	和顺科技	2022-03-16	6 个月	新发流通受限	56.69	41.86	261	14,796.09	10,925.46	-
301196	唯科科技	2022-01-04	6 个月	新发流通受限	64.08	37.52	271	17,365.68	10,167.92	-
301125	腾亚精工	2022-05-27	6 个月	新发流通受限	22.49	27.42	327	7,354.23	8,966.34	-
301163	宏德	2022-04-11	6 个月	新发	26.27	32.33	277	7,276.79	8,955.41	-

	股份			流通受限						
301130	西点药业	2022-02-16	6 个月	新发流通受限	22.55	37.70	237	5,344.35	8,934.90	-
301135	瑞德智能	2022-04-01	6 个月	新发流通受限	31.98	26.26	338	10,809.24	8,875.88	-
301181	标榜股份	2022-02-11	6 个月	新发流通受限	40.25	30.59	257	10,344.25	7,861.63	-
301228	实朴检测	2022-01-21	6 个月	新发流通受限	20.08	20.34	373	7,489.84	7,586.82	-
301279	金道科技	2022-04-06	6 个月	新发流通受限	31.20	22.81	296	9,235.20	6,751.76	-

注：①本基金通过大宗交易方式受让的原上市公司大股东减持或者特定股东减持的股份，在受让后 6 个月内，不得转让所受让的股份。本基金所认购非公开发行股份，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股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市

之日起 6 个月。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根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于 6 个月的限售期。

⑤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。

## 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	合计
银行存款	798,590,988.44	-	-	798,590,988.44
结算备付金	3,335,631.27	-	-	3,335,631.27
结算保证金	817,647.75	-	-	817,647.75
债券投资	2,918,109,960.14	2,144,601,895.89	-	5,062,711,856.03
资产支持证券	-	-	-	-
买入返售金融资产	1,500,167,808.21	-	-	1,500,167,808.21
应收直销申购款	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-
上年度末 2021 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	合计
银行存款	1,832,783,286.85	-	-	1,832,783,286.85
结算备付金	5,273,357.61	-	-	5,273,357.61
结算保证金	1,058,893.45	-	-	1,058,893.45
债券投资	1,668,746,268.16	2,508,953,000.00	-	4,177,699,268.16
资产支持证券	-	-	-	-
买入返售金融资产	491,421,327.71	-	-	491,421,327.71
应收直销申购款	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-

注：本表所示为本基金生息资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

## 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率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 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
	利率下降 25 个基点	13,554,517.17	13,393,320.92
	利率上升 25 个基点	-13,470,834.17	-13,288,298.04

## 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 2022 年 6 月 30 日		上年度末 2021 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	5,855,158,214.54	44.64	7,312,148,813.18	52.83
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	30,880,552.74	0.24	1,268.16	0.00
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	5,886,038,767.28	44.88	7,312,150,081.34	52.83

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 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
	-5%	-294,099,495.76	-405,193,896.85
	+5%	294,099,495.76	405,193,896.85

#### 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 2022 年 6 月 30 日
第一层次	5,879,928,669.21
第二层次	5,032,312,954.46
第三层次	5,628,446.90
合计	10,917,870,070.57

#### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券等投资，若出现交易不活跃（包括重大事项停牌、境内证券涨跌停等导致的交易不活跃）和非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。本基金政策以报告期初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 2022 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	5,855,158,214.54	44.28
	其中：股票	5,855,158,214.54	44.28
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	5,062,711,856.03	38.29
	其中：债券	5,062,711,856.03	38.29
	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	1,500,167,808.21	11.35
	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	801,926,619.71	6.06
8	其他各项资产	2,881,391.25	0.02
9	合计	13,222,845,889.74	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	31,178,945.00	0.24
B	采矿业	1,332,303.44	0.01
C	制造业	3,994,851,382.46	30.46
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	20,496,192.15	0.16
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	46,227,283.00	0.35
G	交通运输、仓储和邮政业	175,011,410.70	1.33
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	633,100,300.08	4.83
J	金融业	96,466,187.83	0.74
K	房地产业	852,121,991.90	6.50
L	租赁和商务服务业	19,959.78	0.00
M	科学研究和技术服务业	7,586.82	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	4,328,437.24	0.03
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	16,234.14	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	5,855,158,214.54	44.64

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	562,564	1,150,443,380.00	8.77
2	600941	中国移动	7,968,875	482,116,937.50	3.68
3	002304	洋河股份	2,515,479	460,709,978.85	3.51
4	600048	保利发展	24,491,367	427,619,267.82	3.26
5	300750	宁德时代	777,171	415,009,314.00	3.16
6	600383	金地集团	26,974,657	362,539,390.08	2.76
7	600009	上海机场	3,086,621	175,011,410.70	1.33



8	600862	中航高科	5,572,796	156,595,567.60	1.19
9	600456	宝钛股份	2,570,000	152,658,000.00	1.16
10	600406	国电南瑞	5,496,900	148,416,300.00	1.13
11	600438	通威股份	2,470,707	147,896,521.02	1.13
12	300034	钢研高纳	3,219,500	135,798,510.00	1.04
13	002025	航天电器	1,845,151	128,828,442.82	0.98
14	600893	航发动力	2,764,464	125,810,756.64	0.96
15	600887	伊利股份	3,218,000	125,341,100.00	0.96
16	600741	华域汽车	5,387,070	123,902,610.00	0.94
17	600801	华新水泥	5,670,416	110,629,816.16	0.84
18	600585	海螺水泥	3,043,124	107,361,414.72	0.82
19	002179	中航光电	1,684,319	106,651,079.08	0.81
20	601318	中国平安	2,064,304	96,382,353.76	0.73
21	300450	先导智能	1,502,080	94,901,414.40	0.72
22	000893	亚钾国际	2,184,200	75,158,322.00	0.57
23	603986	兆易创新	480,620	68,348,970.20	0.52
24	000792	盐湖股份	2,087,600	62,544,496.00	0.48
25	001979	招商蛇口	4,613,800	61,963,334.00	0.47
26	000887	中鼎股份	2,762,320	50,384,716.80	0.38
27	600153	建发股份	3,536,900	46,227,283.00	0.35
28	603712	七一二	1,347,100	42,433,650.00	0.32
29	000513	丽珠集团	660,300	23,909,463.00	0.18
30	000661	长春高新	100,602	23,482,518.84	0.18
31	300760	迈瑞医疗	68,400	21,422,880.00	0.16
32	300395	菲利华	428,400	19,278,000.00	0.15
33	300498	温氏股份	765,700	16,301,753.00	0.12
34	603477	巨星农牧	620,400	14,877,192.00	0.11
35	300767	震安科技	200,492	11,664,624.56	0.09
36	600163	中闽能源	1,331,147	11,248,192.15	0.09
37	002311	海大集团	172,822	10,371,048.22	0.08
38	600900	长江电力	400,000	9,248,000.00	0.07
39	603486	科沃斯	73,300	8,934,537.00	0.07
40	605117	德业股份	22,400	6,269,536.00	0.05
41	600323	瀚蓝环境	208,507	4,274,393.50	0.03
42	600031	三一重工	200,000	3,812,000.00	0.03
43	002916	深南电路	39,973	3,745,869.83	0.03
44	000012	南玻 A	468,400	3,475,528.00	0.03
45	300685	艾德生物	106,560	3,409,920.00	0.03
46	603587	地素时尚	200,000	3,170,000.00	0.02
47	600111	北方稀土	88,400	3,108,144.00	0.02
48	603529	爱玛科技	58,940	3,087,277.20	0.02
49	688052	纳芯微	6,090	2,136,432.90	0.02
50	300433	蓝思科技	180,000	1,992,600.00	0.02

51	600938	中国海油	84,004	1,332,303.44	0.01
52	688120	华海清科	4,822	1,046,952.64	0.01
53	688153	唯捷创芯	7,674	339,497.76	0.00
54	688322	奥比中光	8,529	264,313.71	0.00
55	301139	元道通信	5,651	217,337.46	0.00
56	688150	莱特光电	5,626	110,269.60	0.00
57	688246	嘉和美康	3,364	89,684.24	0.00
58	300059	东方财富	3,132	79,552.80	0.00
59	688283	坤恒顺维	1,595	72,428.95	0.00
60	301236	软通动力	2,076	65,144.88	0.00
61	301219	腾远钴业	578	50,759.96	0.00
62	301200	大族数控	857	44,495.44	0.00
63	301206	三元生物	945	43,177.05	0.00
64	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.00
65	301150	中一科技	404	33,435.04	0.00
66	301109	军信股份	1,838	29,665.32	0.00
67	301302	华如科技	466	26,291.72	0.00
68	301268	铭利达	641	22,351.67	0.00
69	603833	欧派家居	144	21,697.92	0.00
70	301122	采纳股份	301	21,181.37	0.00
71	301102	兆讯传媒	642	19,959.78	0.00
72	301162	国能日新	334	18,072.74	0.00
73	301123	奕东电子	656	16,655.84	0.00
74	301103	何氏眼科	507	16,234.14	0.00
75	600600	青岛啤酒	152	15,795.84	0.00
76	301286	侨源股份	784	15,515.36	0.00
77	301248	杰创智能	472	14,098.64	0.00
78	301097	天益医疗	286	13,863.27	0.00
79	301212	联盛化学	416	13,844.48	0.00
80	301298	东利机械	634	13,206.22	0.00
81	301148	嘉戎技术	516	12,332.40	0.00
82	301259	艾布鲁	483	12,046.02	0.00
83	001268	联合精密	409	11,337.48	0.00
84	000333	美的集团	187	11,292.93	0.00
85	301220	亚香股份	285	11,157.75	0.00
86	301237	和顺科技	261	10,925.46	0.00
87	301196	唯科科技	271	10,167.92	0.00
88	301125	腾亚精工	327	8,966.34	0.00
89	301163	宏德股份	277	8,955.41	0.00
90	301130	西点药业	237	8,934.90	0.00
91	301135	瑞德智能	338	8,875.88	0.00
92	301181	标榜股份	257	7,861.63	0.00
93	301228	实朴检测	373	7,586.82	0.00

94	301279	金道科技	296	6,751.76	0.00
95	600885	宏发股份	157	6,570.45	0.00
96	601336	新华保险	133	4,281.27	0.00
97	002050	三花智控	48	1,319.04	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	600941	中国移动	499,213,867.55	3.61
2	600048	保利发展	394,204,474.69	2.85
3	600383	金地集团	348,237,943.20	2.52
4	600009	上海机场	156,554,625.80	1.13
5	600741	华域汽车	130,164,480.99	0.94
6	600456	宝钛股份	128,670,462.39	0.93
7	600893	航发动力	126,773,653.08	0.92
8	600862	中航高科	126,163,445.33	0.91
9	300034	钢研高纳	126,128,006.87	0.91
10	300059	东方财富	125,922,127.13	0.91
11	600887	伊利股份	124,826,716.53	0.90
12	300750	宁德时代	124,753,777.64	0.90
13	002025	航天电器	123,630,338.47	0.89
14	600406	国电南瑞	123,199,543.28	0.89
15	600585	海螺水泥	123,075,381.85	0.89
16	600801	华新水泥	122,917,520.53	0.89
17	601318	中国平安	94,725,522.59	0.68
18	300450	先导智能	66,347,411.76	0.48
19	603986	兆易创新	64,198,098.45	0.46
20	000792	盐湖股份	62,523,305.00	0.45

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	601888	中国中免	685,791,925.04	4.95
2	002304	洋河股份	576,111,412.44	4.16
3	300122	智飞生物	556,696,544.77	4.02
4	300015	爱尔眼科	479,215,248.53	3.46
5	600600	青岛啤酒	369,906,930.71	2.67
6	603613	国联股份	196,864,146.50	1.42

7	600570	恒生电子	191,547,015.04	1.38
8	600438	通威股份	180,026,707.30	1.30
9	000858	五粮液	163,658,355.94	1.18
10	300059	东方财富	143,737,091.63	1.04
11	600519	贵州茅台	126,552,997.00	0.91
12	300151	昌红科技	85,267,109.70	0.62
13	002390	信邦制药	79,202,335.37	0.57
14	002594	比亚迪	71,926,106.60	0.52
15	300628	亿联网络	55,841,343.06	0.40
16	000568	泸州老窖	53,916,347.00	0.39
17	002415	海康威视	45,611,019.92	0.33
18	600153	建发股份	38,050,822.57	0.27
19	000596	古井贡酒	36,949,795.18	0.27
20	601799	星宇股份	34,848,398.30	0.25

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	3,516,247,008.17
卖出股票收入（成交）总额	4,481,312,522.88

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

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	409,257,863.01	3.12
2	央行票据	-	-
3	金融债券	4,617,491,852.06	35.21
	其中：政策性金融债	4,617,491,852.06	35.21
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	5,081,588.22	0.04
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	30,880,552.74	0.24
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	5,062,711,856.03	38.60

#### 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

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	220201	22 国开 01	6,200,000	626,557,731.51	4.78
2	210411	21 农发 11	5,000,000	508,258,904.11	3.88
3	180204	18 国开 04	4,700,000	485,016,178.08	3.70
4	210218	21 国开 18	4,700,000	480,364,594.52	3.66
5	210015	21 付息国债 15	4,000,000	409,257,863.01	3.12

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

本基金本报告期末无股指期货投资。

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 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国农业发展银行、国家开发银行出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责、处罚的情况。本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

7.12.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 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	817,647.75
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-

5	应收申购款	2,063,743.50
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,881,391.25

7.12.4 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。

7.12.5 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。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## §8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
1,043,911	8,962.92	50,446,365.73	0.54%	9,306,041,454.39	99.46%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	1,704,800.34	0.02%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2003年9月5日）基金份额总额	3,796,885,823.40
--------------------------	------------------

本报告期期初基金份额总额	9,444,816,091.35
本报告期基金总申购份额	642,314,385.94
减：本报告期基金总赎回份额	730,642,657.17
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	9,356,487,820.12

## §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，桂勇先生担任华夏基金管理有限公司首席信息官，李一梅女士不再兼任。华夏基金管理有限公司已根据法律法规的规定完成财务负责人孙立强先生的有关备案工作。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金所聘用的会计师事务所未发生改变。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人、基金托管人涉及托管业务的部门及其高级管理人员在本报告期内无受稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
长江证券	2	2,505,595,222.57	31.43%	2,333,448.08	35.94%	-
国都证券	1	2,370,393,544.76	29.74%	1,733,472.25	26.70%	-
川财证券	1	1,436,807,118.34	18.03%	1,050,749.49	16.18%	-

广发证券	2	517,620,417.77	6.49%	482,068.89	7.42%	-
中天证券	1	472,668,587.91	5.93%	345,662.97	5.32%	-
兴业证券	2	370,583,642.46	4.65%	271,010.17	4.17%	-
中信证券	4	297,235,311.14	3.73%	276,807.22	4.26%	-

注：①为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择券商的标准，即：

i 经营行为规范。

ii 公司财务状况良好。

iii有良好的内控制度，在业内有良好的声誉。

iv有较强的全方位金融服务能力和水平：能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

v 建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯和服务。

②券商专用交易单元选择程序：

i 本基金管理人根据上述标准进行评估并确定选用的券商。

ii 本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议/证券经纪服务协议。

③除本表列示外，本基金还选择了安信证券、财通证券、德邦证券、东方证券、国泰君安证券、海通证券、恒泰证券、瑞银证券、申万宏源证券、西部证券、西南证券、信达证券、银河证券、招商证券、中国银河证券、中泰证券、中信建投证券、中银国际证券的交易单元作为本基金交易单元，本报告期无股票交易及应付佣金。

④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
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国都证券	1,188.36	100.00%	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发	-	-	-	-	-	-	-	-



证券									
中天 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中信 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华夏回报证券投资基金第 112 次分红公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-01-11
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	中国证监会指定报刊及网站	2022-01-21
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	中国证监会指定报刊及网站	2022-02-12
4	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-02-17
5	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-02-19
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	中国证监会指定报刊及网站	2022-02-23
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	中国证监会指定报刊及网站	2022-03-12
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	中国证监会指定报刊及网站	2022-03-19
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	中国证监会指定报刊及网站	2022-04-02
10	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-04-08
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	中国证监会指定报刊及网站	2022-04-13
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	中国证监会指定报刊及网站	2022-04-16
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	中国证监会指定报刊及网站	2022-06-18
14	华夏基金管理有限公司公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-06-24
15	华夏基金管理有限公司公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-06-25

## §11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

## §12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准基金募集的文件；
- 2、《华夏回报证券投资基金基金合同》；
- 3、《华夏回报证券投资基金托管协议》；
- 4、法律意见书；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照。

### 12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

### 12.3 查阅方式

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

华夏基金管理有限公司

二〇二二年八月三十日