新华鑫动力灵活配置混合型证券投资基金

2023 年中期报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：新华基金管理股份有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二三年八月三十日

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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 8 月 29 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 2023 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
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遵规守信情况的说明 11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 11
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 13
5 托管人报告 14
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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 半年度财务会计报告（未经审计） 14
6.1 资产负债表 14
6.2 利润表 16
6.3 净资产（基金净值）变动表 17
6.4 报表附注 18
7 投资组合报告 42
7.1 期末基金资产组合情况 42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 43
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 44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 49
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 49
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 49
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 49
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 49
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 49
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 49
7.12 本报告期投资基金情况 50
7.13 投资组合报告附注 50
8 基金份额持有人信息 51

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 51
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 52
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 52
9 开放式基金份额变动 52
10 重大事件揭示 53
10.1 基金份额持有人大会决议 53
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 53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 53
10.4 基金投资策略的改变 53
10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件 53
10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况 53
10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 53
10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况 54
10.9 其他重大事件 56
11 影响投资者决策的其他重要信息 58
12 备查文件目录 58
12.1 备查文件目录 58
12.2 存放地点 58
12.3 查阅方式 58

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	新华鑫动力灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	新华鑫动力灵活配置混合	
基金主代码	002083	
交易代码	002083	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 6 月 8 日	
基金管理人	新华基金管理股份有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	973,157,045.64 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	新华鑫动力灵活配置混合 A	新华鑫动力灵活配置混合 C
下属分级基金的交易代码	002083	002084
报告期末下属分级基金的份额总额	572,409,422.17 份	400,747,623.47 份

2.2 基金产品说明

投资目标	综合运用多种投资策略，在严格控制基金资产净值下行风险的基础上，力争持续实现超越业绩基准的超额收益。
投资策略	投资策略方面，本基金将以资产配置策略为基础，采取积极的股票投资策略和稳健的债券投资策略。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×60%＋中国债券总指数收益率×40%。
风险收益特征	本基金为混合型基金，属于证券投资基金中的中等预期风险、中等预期收益品种，预期风险和预期收益低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。

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		新华基金管理股份有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	齐岩	秦一楠
	联系电话	010-68779688	010-66060069
	电子邮箱	qiyan@ncfund.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		4008198866	95599
传真		010-68779528	010-68121816
注册地址		重庆市江北区聚贤岩广场6号	北京市东城区建国门内大街69

	力帆中心2号楼19层	号
办公地址	重庆市江北区聚贤岩广场6号力帆中心2号楼19层	北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座F9
邮政编码	400010	100031
法定代表人	于春玲	谷澍

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.ncfund.com.cn
基金中期报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公地

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	新华基金管理股份有限公司	重庆市江北区聚贤岩广场 6 号力帆中心 2 号楼 19 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（2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日）**	
	新华鑫动力灵活配置混合 A	新华鑫动力灵活配置混合 C
本期已实现收益	-117,392,359.20	-81,871,624.13
本期利润	-106,832,651.60	-73,096,939.46
加权平均基金份额本期利润	-0.1809	-0.1786
本期加权平均净值利润率	-7.87%	-7.83%
本期基金份额净值增长率	-7.36%	-7.41%
3.1.2 期末数据和指标	**报告期末(2023 年 6 月 30 日)**	
	新华鑫动力灵活配置混合 A	新华鑫动力灵活配置混合 C
期末可供分配利润	344,630,381.33	235,480,520.72
期末可供分配基金份额利润	0.6021	0.5876
期末基金资产净值	1,272,326,382.34	883,942,819.71
期末基金份额净值	2.2228	2.2057
3.1.3 累计期末指标	**报告期末(2023 年 6 月 30 日)**	
	新华鑫动力灵活配置混合 A	新华鑫动力灵活配置混合 C

基金份额累计净值增长率	122.28%	120.57%

注：1、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；

2、以上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（例如基金申购费赎回费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、对期末可供分配利润，采用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（为期末余额，不是当期发生数）。

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

新华鑫动力灵活配置混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	5.62%	1.26%	0.82%	0.51%	4.80%	0.75%
过去三个月	-2.73%	1.38%	-2.67%	0.49%	-0.06%	0.89%
过去六个月	-7.36%	1.28%	0.00%	0.50%	-7.36%	0.78%
过去一年	-34.00%	1.63%	-8.09%	0.59%	-25.91%	1.04%
过去三年	63.08%	2.25%	-2.57%	0.71%	65.65%	1.54%
自基金合同生效起至今	122.28%	1.72%	17.70%	0.69%	104.58%	1.03%

注：1、本基金股票投资部分的业绩比较基准采用沪深 300 指数，债券投资部分的业绩比较基准采用中国债券总指数，复合业绩比较标准为 60%×沪深 300 指数+40%×中国债券总指数。

2、本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

新华鑫动力灵活配置混合 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	5.61%	1.26%	0.82%	0.51%	4.79%	0.75%
过去三个月	-2.76%	1.38%	-2.67%	0.49%	-0.09%	0.89%
过去六个月	-7.41%	1.28%	0.00%	0.50%	-7.41%	0.78%
过去一年	-34.07%	1.63%	-8.09%	0.59%	-25.98%	1.04%
过去三年	62.54%	2.25%	-2.57%	0.71%	65.11%	1.54%
自基金合同生效起至今	120.57%	1.72%	17.70%	0.69%	102.87%	1.03%

注：1、本基金股票投资部分的业绩比较基准采用沪深 300 指数，债券投资部分的业绩比较基准采用中国债券总指数，复合业绩比较标准为 60%×沪深 300 指数+40%×中国债券总指数。

2、本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

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

新华鑫动力灵活配置混合型证券投资基金

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

（2016 年 6 月 8 日至 2023 年 6 月 30 日）

新华鑫动力灵活配置混合 A

新华鑫动力灵活配置混合 C

注：报告期内本基金的各项投资比例符合基金合同的有关规定。

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

新华基金管理股份有限公司经中国证券监督管理委员会批复，于 2004 年 12 月 9 日注册成立。注册地为重庆市，是我国西部首家基金管理公司。

截至 2023 年 6 月 30 日，新华基金管理股份有限公司旗下管理着四十八只开放式基金，即新华优选分红混合型证券投资基金、新华优选成长混合型证券投资基金、新华泛资源优势灵活配置混合型证券投资基金、新华钻石品质企业混合型证券投资基金、新华行业周期轮换混合型证券投资基金、新华中小市值优选混合型证券投资基金、新华灵活主题混合型证券投资基金、新华优选消费混合型证券投资基金、新华纯债添利债券型发起式证券投资基金、新华行业轮换灵活配置混合型证券投资基金、新华趋势领航混合型证券投资基金、新华安享惠金定期开放债券型证券投资基金、新华壹诺宝货币市场基金、新华增怡债券型证券投资基金、新华鑫益灵活配置混合型证券投资基金、新华鑫利灵活配置混合型证券投资基金、新华中证环保产业指数证券投资基金、新华活期添利货币市场基金、新华增盈回报债券型证券投资基金、新华策略精选股票型证券投资基金、新华万银多元策略灵活配置混合型证券投资基金、新华稳健回报灵活配置混合型发起式证券投资基金、新华战略新兴产

业灵活配置混合型证券投资基金、新华鑫回报混合型证券投资基金、新华积极价值灵活配置混合型证券投资基金、新华科技创新主题灵活配置混合型证券投资基金、新华鑫动力灵活配置混合型证券投资基金、新华双利债券型证券投资基金、新华丰利债券型证券投资基金、新华外延增长主题灵活配置混合型证券投资基金、新华红利回报混合型证券投资基金、新华鑫泰灵活配置混合型证券投资基金、新华安享多裕定期开放灵活配置混合型证券投资基金、新华恒稳添利债券型证券投资基金、新华鑫日享中短债债券型证券投资基金、新华聚利债券型证券投资基金、新华鼎利债券型证券投资基金、新华沪深 300 指数增强型证券投资基金、新华安享惠泽 39 个月定期开放债券型证券投资基金、新华精选成长主题 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）、新华景气行业混合型证券投资基金、新华安享惠融 88 个月定期开放债券型证券投资基金、新华安康多元收益一年持有期混合型证券投资基金、新华利率债债券型证券投资基金、新华行业龙头主题股票型证券投资基金、新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合型证券投资基金、新华中证云计算 50 交易型开放式指数证券投资基金、新华中债 1-5 年农发行债券指数证券投资基金。

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		
栾超	本基金基金经理，联席权益投资总监、研究部总监，新华鑫益灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华优选成长混合型证券投资基金基金经理、新华泛资源优势灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华景气行业混合型证券投资基金基金经理、新华鑫泰灵活配置混合型证券投资基	2022-10-26	-	11	经济学硕士，历任中邮创业基金管理股份有限公司研究员、基金经理助理、基金经理。

	金基金经理、新华科技创新主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理。				
崔古昕	本基金基金经理，新华科技创新主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理。	2023-01-03	-	11	计算机工程硕士，历任量宇私募股权基金股权投资部投资经理，新华基金管理股份有限公司研究部研究员、总监助理、基金经理助理。
张大江	本基金基金经理助理。	2021-11-12	2023-01-08	8	统计学硕士，历任北京银建期货经纪有限公司研究员、北京嘉鑫控股集团研究部经理/总经理助理、冀东国际贸易集团有限公司期货部经理。2017 年 8 月加入新华基金，现任新华鑫动力灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理。

注：1、首任基金经理，任职日期指基金合同生效日，离任日期指公司作出决定之日。

2、非首任基金经理，任职日期和离任日期均指公司作出决定之日。

3、证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》、《基金从业人员管理规则》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期末不存在基金经理同时兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期，新华基金管理股份有限公司作为新华鑫动力灵活配置混合型证券投资基金的管理人按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《新华鑫动力灵活配置混合型证券投资基金基金合同》以及其它有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上为持有人谋求最大利益。运作整体合法合规，无损害基金持有人利益的行为。

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

根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》（2011 年修订），公

司制定了《新华基金管理股份有限公司公平交易管理制度》。制度的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等所有投资管理活动，同时包括授权、研究分析、投资决策、交易执行等投资管理活动相关的各个环节。

场内交易，投资指令统一由交易部下达，并且启动交易系统公平交易模块。根据公司制度，严格禁止不同投资组合之间互为对手方的交易，严格控制不同投资组合之间的同日反向交易。

场外交易中，对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等交易，交易部根据各投资组合经理申报的满足价格条件的数量进行比例分配。如有异议，由交易部报投资总监、督察长、金融工程部和监察稽核部，再次进行审核并确定最终分配结果。如果督察长认为有必要，可以召开风险管理委员会会议，对公平交易的结果进行评估和审议。对于银行间市场交易、固定收益平台、交易所大宗交易，投资组合经理以该投资组合的名义向交易部下达投资指令，交易部向银行间市场或交易对手询价、成交确认，并根据“时间优先、价格优先”的原则保证各投资组合获得公平的交易机会。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期，公司对不同组合不同时间段的同向交易价差进行了溢价率样本的采集，通过平均溢价率、买入/卖出溢价率以及利益输送金额等多个层面来判断不同投资组合之间在某一时间段是否存在违反公平交易原则的异常情况，未发现重大异常情况，且不存在报告期内所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边成交量超过该证券当日成交量的 5%的情况。

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

2023 年上半年我国经济维持了复苏趋势。资本市场上，A 股市场震荡分化。分行业看，AI 成为是市场最大的热点，计算机、通信、传媒、电子等表现强势。与此同时，“中特估”成为市场的另一条主线。而前些年热点的行业如医药、新能源等在今年出现调整。

在上半年的投资过程中，本基金投资上仍然聚焦新能源行业，在行业内进一步优化均衡了组合的配置。我们重点投资了受益于成本下降 IRR 提升的光伏储能、行业排产提升的电动车以及受益于钢材价格下降的风电等行业。与此同时，我们积极关注钙钛矿、氢能、换电等新的技术进步带来的产业变革，在新技术、新应用上增加了持仓。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2023 年 6 月 30 日，本基金 A 类份额净值为 2.2228 元，本报告期份额净值增长率为-7.36%，同期比较基准的增长率为 0.00%；本基金 C 类份额净值为 2.2057 元，本报告期份额净值增长率为

-7.41%，同期比较基准的增长率为 0.00%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年我们认为经济仍将延续复苏的趋势，股票市场行业间分化继续，投资中持仓结构重于仓位。下半年市场主旋律仍有望是科技创新的成长方向，但随着经济逐步复苏，顺周期板块有望迎来阶段性戴维斯双击的机会。

从过去两年历史表现来看，新能源行业于 2021 年三四季度见顶，尽管 2022 年兑现了较好的业绩，但估值已经提前出现了折价。如果以 2021 年三季度为新能源行业调整的起点，整个板块已经经历了两年的调整，行业主流公司当年的估值已经回到 20-30 倍的合理估值区间，已经没有过多的估值溢价。投资中，我们一方面将继续在前期重点看好的方向上寻找个股机会，包括光储、新能源汽车、风电等行业。与此同时，景气度和增速依然是我们寻找新方向的核心判断依据，我们关注各个板块中增速较快的细分行业如充电桩、电改、汽车智能化等方向。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。本基金管理人设有估值小组，负责对各类投资品种的估值方法、估值模型等进行研究和论证，组织制定和适时修订估值政策和程序，指导和监督整个估值流程。本报告期内，参与估值流程各方之间不存在直接的重大利益冲突。 本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中债金融估值中心有限公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配。

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

本报告期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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—新华基金管理股份有限公司 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为, 新华基金管理股份有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认为，新华基金管理股份有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：新华鑫动力灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资　产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	188,986,303.34	155,466,684.29
结算备付金		2,124,009.95	10,473,290.13
存出保证金		965,290.81	840,416.68
交易性金融资产	6.4.7.2	1,947,874,287.31	2,278,009,447.51

其中：股票投资		1,947,874,287.31	2,278,009,447.51
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		33,799,379.01	9,097,056.89
应收股利		-	-
应收申购款		1,244,901.44	2,844,098.25
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		2,174,994,171.86	2,456,730,993.75
负债和净资产	**附注号**	**本期末 2023 年 6 月 30 日**	**上年度末 2022 年 12 月 31 日**
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	23,585,913.55
应付赎回款		6,120,857.38	9,737,258.16
应付管理人报酬		2,589,291.90	3,136,096.64
应付托管费		431,548.66	522,682.77
应付销售服务费		70,946.83	84,331.09
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.5	9,512,325.04	7,594,433.63
负债合计		18,724,969.81	44,660,715.84
净资产：			
实收基金	6.4.7.6	973,157,045.64	1,008,264,595.33
其他综合收益		-	-
未分配利润		1,183,112,156.41	1,403,805,682.58
净资产合计		2,156,269,202.05	2,412,070,277.91
负债和净资产总计		2,174,994,171.86	2,456,730,993.75

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，A 类基金份额净值 2.2228 元，基金份额 572,409,422.17 份，C 类基金份额净值 2.2057 元，基金份额 400,747,623.47 份。

6.2 利润表

会计主体：新华鑫动力灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		**-159,432,353.77**	**136,879,163.74**
1.利息收入		1,350,070.58	1,023,573.64
其中：存款利息收入	6.4.7.8	1,350,070.58	1,023,573.64
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		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-181,058,647.76	-143,871,945.82
其中：股票投资收益	6.4.7.9	-190,494,346.92	-156,551,566.40
基金投资收益	6.4.7.10	-	-
债券投资收益	6.4.7.11	529,925.67	2,610,742.68
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益	6.4.7.14	8,905,773.49	10,068,877.90
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	19,334,392.27	273,900,367.37
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	941,831.14	5,827,168.55
减：二、营业总支出		**20,497,237.29**	**26,706,393.19**
1．管理人报酬		17,061,935.67	22,253,089.15
2．托管费		2,843,655.94	3,708,848.10
3．销售服务费		463,153.85	608,312.56
4．投资顾问费		-	-
5．利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失		-	-
7．税金及附加		4.10	17.31
8．其他费用	6.4.7.17	128,487.73	136,126.07
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		**-179,929,591.06**	**110,172,770.55**
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		**-179,929,591.06**	**110,172,770.55**
五、其他综合收益的税后净额		**-**	**-**

六、综合收益总额		**-179,929,591.06**	**110,172,770.55**

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：新华鑫动力灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目		**本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 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）	1,008,264,595.33	-	1,403,805,682.58	2,412,070,277.91
二、本期期初净资产（基金净值）	1,008,264,595.33	-	1,403,805,682.58	2,412,070,277.91
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-35,107,549.69	-	-220,693,526.17	-255,801,075.86
（一）、综合收益总额	-	-	-179,929,591.06	-179,929,591.06
（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）	-35,107,549.69	-	-40,763,935.11	-75,871,484.80
其中：1.基金申购款	286,713,492.35	-	379,361,395.64	666,074,887.99
2.基金赎回款	-321,821,042.04	-	-420,125,330.75	-741,946,372.79
（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）	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	973,157,045.64	-	1,183,112,156.41	2,156,269,202.05
项目		**上年度可比期间 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）	1,143,377,165.60	-	2,514,004,155.33	3,657,381,320.93

二、本期期初净资产（基金净值）	1,143,377,165.60	-	2,514,004,155.33	3,657,381,320.93
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	10,125,719.36	-	206,031,737.75	216,157,457.11
（一）、综合收益总额	-	-	110,172,770.55	110,172,770.55
（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）	10,125,719.36	-	95,858,967.20	105,984,686.56
其中：1.基金申购款	865,150,656.81	-	1,622,258,039.72	2,487,408,696.53
2.基金赎回款	-855,024,937.45	-	-1,526,399,072.52	-2,381,424,009.97
（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）	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	1,153,502,884.96	-	2,720,035,893.08	3,873,538,778.04

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：于春玲，主管会计工作负责人：于春玲，会计机构负责人：徐端骞

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

新华鑫动力灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可［2015］2104 号文核准，由新华基金管理股份有限公司作为发起人，于 2016 年 5 月 3 日至 2016 年 6 月 3 日向社会公开募集，设立募集期间募集及利息结转的基金份额共计 619,212,900.64 份，有效认购户数为 6474 户，并经瑞华会计师事务所（特殊普通合伙）瑞华验字[2016]01360032 号验资报告予以验证。2016 年 6 月 8 日办理基金备案手续，基金合同正式生效。本基金为契约型开放式证券投资基金，存续期不限定，本基金管理人为新华基金管理股份有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《新华鑫动力灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》及《新华鑫动力灵活配置混合型

证券投资基金基金合同》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（包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票）、权证、债券资产（国债、金融债、企业债、公司债、中小企业私募债券、次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款等、现金及到期日在一年以内的政府债券，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(但须符合中国证监会相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：股票投资占基金资产的比例为 0-95%，中小企业私募债占基金资产净值的比例不高于 20%，权证投资占基金资产净值的比例为 0-3%，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%。

本财务报表由本基金的基金管理人新华基金管理股份有限公司于 2023 年 8 月 29 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营假设为基础编制，根据实际发生的交易和事项，按照财政部发布的《企业会计准则——基本准则》（财政部令第 33 号发布、财政部令第 76 号修订）、于 2006 年 2 月 15 日及其后颁布和修订的 41 项具体会计准则、企业会计准则应用指南、企业会计准则解释及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《新华鑫动力灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注四所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金编制的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的财务状况、经营成果和基金净值变动情况等相关信息。

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

本基金本报告期采用的会计政策、会计估计与上年度会计报表相一致。

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

本基金报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2会计估计变更的说明

本基金报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3差错更正的说明

本基金报告期未发生差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、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[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[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《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《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、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）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。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

（2）对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

（3）对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得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，暂减按 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。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、

红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

（4）基金卖出股票按 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。

（5）本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

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 2023 年 6 月 30 日
活期存款	188,986,303.34
等于：本金	188,943,040.76
加：应计利息	43,262.58
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	188,986,303.34

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2023 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		2,004,314,739.08	-	1,947,874,287.31	-56,440,451.77
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		2,004,314,739.08	-	1,947,874,287.31	-56,440,451.77

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

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.5 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1,160.20
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	9,407,485.89
其中：交易所市场	9,407,485.89
银行间市场	-
应付利息	-
账户维护费	4,500.00
中国证券报	59,507.37
审计费	39,671.58
合计	9,512,325.04

6.4.7.6 实收基金

新华鑫动力灵活配置混合 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额	账面金额

上年度末	598,728,072.89	598,728,072.89
本期申购	111,261,016.77	111,261,016.77
本期赎回（以“-”号填列）	-137,579,667.49	-137,579,667.49
本期末	572,409,422.17	572,409,422.17

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

新华鑫动力灵活配置混合 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	409,536,522.44	409,536,522.44
本期申购	175,452,475.58	175,452,475.58
本期赎回（以“-”号填列）	-184,241,374.55	-184,241,374.55
本期末	400,747,623.47	400,747,623.47

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.7 未分配利润

新华鑫动力灵活配置混合 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	479,750,395.73	358,039,188.74	837,789,584.47
本期利润	-117,392,359.20	10,559,707.60	-106,832,651.60
本期基金份额交易产生的变动数	-17,727,655.20	-13,312,317.50	-31,039,972.70
其中：基金申购款	82,107,908.36	66,647,392.75	148,755,301.11
基金赎回款	-99,835,563.56	-79,959,710.25	-179,795,273.81
本期已分配利润	-	-	-
本期末	344,630,381.33	355,286,578.84	699,916,960.17

新华鑫动力灵活配置混合 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	322,085,821.41	243,930,276.70	566,016,098.11
本期利润	-81,871,624.13	8,774,684.67	-73,096,939.46
本期基金份额交易产生的变动数	-4,733,676.56	-4,990,285.85	-9,723,962.41
其中：基金申购款	126,786,126.50	103,819,968.03	230,606,094.53

基金赎回款	-131,519,803.06	-108,810,253.88	-240,330,056.94
本期已分配利润	-	-	-
本期末	235,480,520.72	247,714,675.52	483,195,196.24

6.4.7.8 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	1,297,736.07
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	52,334.51
其他	-
合计	1,350,070.58

注：结算备付金利息收入包含结算保证金利息收入。

6.4.7.9 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	3,524,242,671.54
减：卖出股票成本总额	3,705,251,344.25
减：交易费用	9,485,674.21
买卖股票差价收入	-190,494,346.92

6.4.7.10 基金投资收益

报告期末，本基金无基金投资收益。

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 2023年1月1日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	1,141.16
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	528,784.51
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	529,925.67

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 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	3,612,104.43
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	3,082,000.00
减：应计利息总额	1,175.38
减：交易费用	144.54
买卖债券差价收入	528,784.51

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

报告期末，本基金无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 贵金属投资收益

报告期末，本基金无贵金属投资收益。

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资产生的股利收益	8,905,773.49
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	8,905,773.49

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
1.交易性金融资产	19,334,392.27
——股票投资	19,334,392.27
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-

——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——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	19,334,392.27

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
基金赎回费收入	937,582.60
补差费收入	4,248.54
合计	941,831.14

6.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
审计费用	39,671.58
信息披露费	-
证券出借违约金	-
银行汇划费	20,308.78
中国证券报	59,507.37
账户维护费	9,000.00
合计	128,487.73

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，本基金未发生需要披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金从 2023 年 8 月 21 日起，管理费率降至 1.20%，托管费率降至 0.20%。

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

本报告期内，本基金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
新华基金管理股份有限公司	基金管理人、基金发起人
中国农业银行股份有限公司	基金托管人
恒泰证券股份有限公司	基金管理人股东

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 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022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
恒泰证券股份有限公司	803,742,805.31	11.71%	94,151,104.07	3.66%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022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
恒泰证券股份有限公司	3,612,104.43	100.00%	-	-

注：本基金上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行债券回购交易。

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 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
恒泰证券股份有限公司	669,289.78	12.35%	669,289.78	7.11%
关联方名称	上年度可比期间 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
恒泰证券股份有限公司	87,679.37	4.36%	7,477.16	0.26%

注：1、上述佣金按合同约定的佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费后的净额列示。

2、上述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

3、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 2023年1月1日至2023年6月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	17,061,935.67	22,253,089.15
其中：支付销售机构的客户维护费	7,330,825.87	9,244,892.11

注：1、基金管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5%的年费率逐日计提确认。计算公式为：每日基金管理费＝前一日基金资产净值×（1.5%÷当年天数）

2、本报告期列示的支付销售机构的客户维护费为本期计提金额。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	2,843,655.94	3,708,848.10

注：基金托管费按前一日的基金资产净值 0.25%的年费率逐日计提确认。

其计算公式为:日托管人报酬=前一日基金资产净值×0.25%/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 2023年1月1日至2023年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	新华鑫动力灵活配置混合 A	新华鑫动力灵活配置混合 C	合计
恒泰证券股份有限公司	-	9,581.73	9,581.73
新华基金管理股份有限公司	-	2,720.68	2,720.68
中国农业银行股份有限公司	-	17,897.35	17,897.35
合计	-	30,199.76	30,199.76
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	新华鑫动力灵活配置混合A	新华鑫动力灵活配置混合C	合计
恒泰证券股份有限公司	-	12,034.65	12,034.65
新华基金管理股份有限公司	-	9,333.88	9,333.88
中国农业银行股份有限公司	-	20,142.83	20,142.83
合计	-	41,511.36	41,511.36

注：基金销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值 0.10%的年费率逐日计提确认。

其计算公式为:日销售服务费=前一日 C 类基金份额的基金资产净值×0.10%/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

本基金本报告期及上年度可比期间，均未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

报告期内基金管理人未发生运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.10.4.2 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

报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.10.5 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 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022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
中国农业银行股份有限公司	188,986,303.34	1,297,736.07	359,742,991.61	997,285.88

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期内未参与关联方承销证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

6.4.10.7.1 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期间无利润分配事项。

6.4.12 期末（2023 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
688515	裕太微	2023-02-01	1-6 个月(含)	新股锁定期内	92.00	162.75	4,183.00	384,836.00	680,783.25	-
301395	仁信新材	2023-06-21	1 个月内(含)	新股未上市	26.68	26.68	5,196.00	138,629.28	138,629.28	含10%限售 6 个月股票
688249	晶合集成	2023-04-24	1-6 个月(含)	新股锁定	19.86	18.06	7,405.00	147,063.30	133,734.30	-

				期内						
301292	海科新源	2023-06-29	1 个月内(含)	新股未上市	19.99	19.99	5,824.00	116,421.76	116,421.76	含10%限售6个月股票
688472	阿特斯	2023-06-02	1-6 个月(含)	新股锁定期内	11.10	17.04	6,261.00	69,497.10	106,687.44	-
688443	智翔金泰	2023-06-13	1-6 个月(含)	新股锁定期内	37.88	29.49	3,033.00	114,890.04	89,443.17	-
301358	湖南裕能	2023-02-01	1-6 个月(含)	新股锁定期内	23.77	42.89	2,023.00	48,086.71	86,766.47	-
301202	朗威股份	2023-06-28	1 个月内(含)	新股未上市	25.82	25.82	3,060.00	79,009.20	79,009.20	含10%限售6个月股票
688469	中芯集成	2023-04-28	1-6 个月(含)	新股锁定期内	5.69	5.41	13,800.00	78,522.00	74,658.00	-
301260	格力博	2023-01-20	1-6 个月(含)	新股锁定期内	30.85	23.63	3,121.00	96,282.85	73,749.23	-
301261	恒工精密	2023-06-29	1 个月内(含)	新股未上市	36.90	36.90	1,973.00	72,803.70	72,803.70	含10%限售6个月股票
688361	中科飞测	2023-05-12	1-6 个月(含)	新股锁定期内	23.60	64.67	831.00	19,611.60	53,740.77	-
688531	日联科技	2023-03-24	1-6 个月(含)	新股锁定期内	152.38	135.97	346.00	52,723.48	47,045.62	-
301325	曼恩斯特	2023-05-04	1-6 个月(含)	新股锁定期内	76.80	107.95	364.00	27,955.20	39,293.80	-
688146	中船特气	2023-04-13	1-6 个月(含)	新股锁定期内	36.15	38.13	1,011.00	36,547.65	38,549.43	-
001286	陕西能源	2023-03-31	1-6 个月(含)	新股锁定	9.60	9.41	3,767.00	36,163.20	35,447.47	-

				期内						
001287	中电港	2023-03-30	1-6 个月(含)	新股锁定期内	11.88	21.02	1,386.00	16,465.68	29,133.72	-
688576	西山科技	2023-05-30	1-6 个月(含)	新股锁定期内	135.80	120.41	240.00	32,592.00	28,898.40	-
301246	宏源药业	2023-03-10	1-6 个月(含)	新股锁定期内	50.00	30.71	931.00	46,550.00	28,591.01	-
688352	颀中科技	2023-04-11	1-6 个月(含)	新股锁定期内	12.10	12.07	2,361.00	28,568.10	28,497.27	-
301310	鑫宏业	2023-05-26	1-6 个月(含)	新股锁定期内	67.28	65.43	409.00	27,517.52	26,760.87	-
688582	芯动联科	2023-06-21	1-6 个月(含)	新股锁定期内	26.74	40.68	648.00	17,327.52	26,360.64	-
301293	三博脑科	2023-04-25	1-6 个月(含)	新股锁定期内	29.60	71.42	333.00	9,856.80	23,782.86	-
688552	航天南湖	2023-05-08	1-6 个月(含)	新股锁定期内	21.17	23.50	956.00	20,238.52	22,466.00	-
688570	天玛智控	2023-05-29	1-6 个月(含)	新股锁定期内	30.26	25.33	884.00	26,749.84	22,391.72	-
688543	国科军工	2023-06-14	1-6 个月(含)	新股锁定期内	43.67	53.05	410.00	17,904.70	21,750.50	-
301322	绿通科技	2023-02-27	1-6 个月(含)	新股锁定期内	87.30	53.24	392.00	34,219.71	20,870.08	含转增 131 股
688458	美芯晟	2023-05-15	1-6 个月(含)	新股锁定期内	75.00	90.76	221.00	16,575.00	20,057.96	-
688581	安杰思	2023-05-12	1-6 个月(含)	新股锁定期内	125.80	118.03	163.00	20,505.40	19,238.89	-
301383	天键股份	2023-05-31	1-6 个月(含)	新股锁定期内	46.16	35.72	493.00	22,756.88	17,609.96	-
30143	泓淋	2023-0	1-6 个	新股	19.99	16.90	949.00	18,970	16,038	-

9	电力	3-10	月(含)	锁定期内				.51	.10	
688623	双元科技	2023-05-31	1-6 个月(含)	新股锁定期内	125.88	86.79	178.00	22,406.64	15,448.62	-
301332	德尔玛	2023-05-09	1-6 个月(含)	新股锁定期内	14.81	13.73	1,122.00	16,616.82	15,405.06	-
301408	华人健康	2023-02-22	1-6 个月(含)	新股锁定期内	16.24	16.95	879.00	14,274.96	14,899.05	-
301397	溯联股份	2023-06-15	1-6 个月(含)	新股锁定期内	53.27	40.20	362.00	19,283.74	14,552.40	-
301419	阿莱德	2023-02-02	1-6 个月(含)	新股锁定期内	24.80	43.85	330.00	8,184.00	14,470.50	-
688334	西高院	2023-06-09	1-6 个月(含)	新股锁定期内	14.16	16.21	888.00	12,574.08	14,394.48	-
688593	新相微	2023-05-25	1-6 个月(含)	新股锁定期内	11.18	14.59	959.00	10,721.62	13,991.81	-
301387	光大同创	2023-04-10	1-6 个月(含)	新股锁定期内	58.32	45.36	307.00	17,904.24	13,925.52	-
301210	金杨股份	2023-06-21	1-6 个月(含)	新股锁定期内	57.88	49.17	281.00	16,264.28	13,816.77	-
688512	慧智微	2023-05-08	1-6 个月(含)	新股锁定期内	20.92	19.16	721.00	15,083.32	13,814.36	-
301382	蜂助手	2023-05-09	1-6 个月(含)	新股锁定期内	23.80	32.84	408.00	9,710.40	13,398.72	-
688443	华曙高科	2023-04-07	1-6 个月(含)	新股锁定期内	26.66	31.50	418.00	11,143.88	13,167.00	-
688629	华丰科技	2023-06-16	1-6 个月(含)	新股锁定期内	9.26	18.59	708.00	6,556.08	13,161.72	-
688620	安凯微	2023-06-15	1-6 个月(含)	新股锁定期内	10.68	12.34	1,016.00	10,850.88	12,537.44	-

301360	荣旗科技	2023-04-17	1-6 个月(含)	新股锁定期内	71.88	92.60	134.00	9,631.92	12,408.40	-
301345	涛涛车业	2023-03-10	1-6 个月(含)	新股锁定期内	73.45	46.64	266.00	19,537.70	12,406.24	-
301315	威士顿	2023-06-13	1-6 个月(含)	新股锁定期内	32.29	51.12	226.00	7,297.54	11,553.12	-
301225	恒勃股份	2023-06-08	1-6 个月(含)	新股锁定期内	35.66	33.26	333.00	11,874.78	11,075.58	-
301429	森泰股份	2023-04-10	1-6 个月(含)	新股锁定期内	28.75	21.02	499.00	14,346.25	10,488.98	-
601065	江盐集团	2023-03-31	1-6 个月(含)	新股锁定期内	10.36	11.84	875.00	9,065.00	10,360.00	-
688631	莱斯信息	2023-06-19	1-6 个月(含)	新股锁定期内	25.28	29.87	336.00	8,494.08	10,036.32	-
688479	友车科技	2023-05-04	1-6 个月(含)	新股锁定期内	33.99	29.49	332.00	11,284.68	9,790.68	-
301232	飞沃科技	2023-06-08	1-6 个月(含)	新股锁定期内	72.50	58.42	165.00	11,962.50	9,639.30	-
301355	南王科技	2023-06-02	1-6 个月(含)	新股锁定期内	17.55	16.75	563.00	9,880.65	9,430.25	-
301357	北方长龙	2023-04-11	1-6 个月(含)	新股锁定期内	50.00	48.39	190.00	9,500.00	9,194.10	-
301386	未来电器	2023-03-21	1-6 个月(含)	新股锁定期内	29.99	23.79	378.00	11,336.22	8,992.62	-
301323	新莱福	2023-05-29	1-6 个月(含)	新股锁定期内	39.06	39.36	228.00	8,905.68	8,974.08	-
688429	时创能源	2023-06-20	1-6 个月(含)	新股锁定期内	19.20	25.53	346.00	6,643.20	8,833.38	-
301373	凌玮科技	2023-01-20	1-6 个月(含)	新股锁定	33.73	31.85	277.00	9,343.21	8,822.45	-

				期内						
301170	锡南科技	2023-06-16	1-6 个月(含)	新股锁定期内	34.00	34.93	250.00	8,500.00	8,732.50	-
601133	柏诚股份	2023-03-31	1-6 个月(含)	新股锁定期内	11.66	12.26	664.00	7,742.24	8,140.64	-
301157	华塑科技	2023-03-01	1-6 个月(含)	新股锁定期内	56.50	52.93	150.00	8,475.00	7,939.50	-
301295	美硕科技	2023-06-19	1-6 个月(含)	新股锁定期内	37.40	36.07	215.00	8,041.00	7,755.05	-
300804	广康生化	2023-06-15	1-6 个月(含)	新股锁定期内	42.45	32.97	226.00	9,593.70	7,451.22	-
301337	亚华电子	2023-05-16	1-6 个月(含)	新股锁定期内	32.60	30.37	232.00	7,563.20	7,045.84	-
301428	世纪恒通	2023-05-10	1-6 个月(含)	新股锁定期内	26.35	30.60	229.00	6,034.15	7,007.40	-
001380	华纬科技	2023-05-09	1-6 个月(含)	新股锁定期内	28.84	30.78	170.00	4,902.80	5,232.60	-
603125	常青科技	2023-03-30	1-6 个月(含)	新股锁定期内	25.98	24.53	160.00	4,156.80	3,924.80	-
001282	三联锻造	2023-05-15	1-6 个月(含)	新股锁定期内	27.93	33.03	105.00	2,932.65	3,468.15	-
001360	南矿集团	2023-03-31	1-6 个月(含)	新股锁定期内	15.38	14.87	177.00	2,722.26	2,631.99	-
603137	恒尚节能	2023-04-10	1-6 个月(含)	新股锁定期内	15.90	17.09	139.00	2,210.10	2,375.51	-
001324	长青科技	2023-05-12	1-6 个月(含)	新股锁定期内	18.88	19.60	114.00	2,152.32	2,234.40	-
001367	海森药业	2023-03-30	1-6 个月(含)	新股锁定期内	44.48	39.48	55.00	2,446.40	2,171.40	-
60317	万丰	2023-0	1-6 个	新股	14.58	16.13	122.00	1,778.	1,967.	-

2	股份	4-28	月(含)	锁定期内				76	86	

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

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

本基金本报告期末未持有银行间市场债券正回购。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有交易所市场债券正回购。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期期末参与转融通证券出借业务。

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

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险管理委员会、监察稽核部、相关职能部门和业务部门构成的四级风险管理架构体系。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金管理人通过严格的备选库制度和分散化投资方式防范信用风险。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；在银行间同业市场进行的交易通过交易对手库管理控制相应的信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本报告期末及上年度末，本基金未持有按短期信用评级的债券投资。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本报告期末及上年度末，本基金未持有按短期信用评级的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本报告期末及上年度末，本基金未持有按短期信用评级的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本报告期末及上年度末，本基金未持有按长期信用评级的债券投资。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本报告期末及上年度末，本基金未持有按长期信用评级的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本报告期末及上年度末，本基金未持有按长期信用评级的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。本基金采用分散投资、控制流通受限证券比例等方式防范流动性风险。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易。

除卖出回购金融资产款余额(计息但该利息金额不重大)以外，本基金承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一年以内且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金组合的流动性指标进行持续的监测和分析。本报告期内，本基金资产的投资比例符合基金流动性风险管理的相关规定，流动性风险较低。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	188,986,303.34	-	-	-	188,986,303.34
结算备付金	2,124,009.95	-	-	-	2,124,009.95
存出保证金	965,290.81	-	-	-	965,290.81
交易性金融资产	0.00	0.00	0.00	1,947,874,287.31	1,947,874,287.31
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	0.00	-	-	-	0.00
债权投资	-	-	-	0.00	0.00
其他债权投资	-	-	-	0.00	0.00
其他权益工具投资	-	-	-	0.00	0.00
应收清算款	-	-	-	33,799,379.01	33,799,379.01
应收股利	-	-	-	0.00	0.00
应收申购款	-	-	-	1,244,901.44	1,244,901.44
递延所得税资产	-	-	-	0.00	0.00
其他资产	-	-	-	0.00	0.00
资产总计	192,075,604.10	0.00	0.00	1,982,918,567.76	2,174,994,171.86
负债					
短期借款	-	-	-	0.00	0.00
交易性金融负债	-	-	-	0.00	0.00
衍生金融负债	-	-	-	0.00	0.00
卖出回购金融资产款	0.00	-	-	-	0.00
应付清算款	-	-	-	0.00	0.00
应付赎回款	-	-	-	6,120,857.38	6,120,857.38

应付管理人报酬	-	-	-	2,589,291.90	2,589,291.90
应付托管费	-	-	-	431,548.66	431,548.66
应付销售服务费	-	-	-	70,946.83	70,946.83
应付投资顾问费	-	-	-	0.00	0.00
应交税费	-	-	-	0.00	0.00
应付利润	-	-	-	0.00	0.00
递延所得税负债	-	-	-	0.00	0.00
其他负债	-	-	-	9,512,325.04	9,512,325.04
负债总计	0.00	0.00	0.00	18,724,969.81	18,724,969.81
利率敏感度缺口	192,075,604.10	0.00	0.00	1,964,193,597.95	2,156,269,202.05
上年度末 2022 年 12 月 31 日	**1 年以内**	**1-5 年**	**5 年以上**	**不计息**	**合计**
资产					
银行存款	155,466,684.29	-	-	-	155,466,684.29
结算备付金	10,473,290.13	-	-	-	10,473,290.13
存出保证金	840,416.68	-	-	-	840,416.68
交易性金融资产	0.00	0.00	0.00	2,278,009,447.51	2,278,009,447.51
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	0.00	-	-	-	0.00
债权投资	-	-	-	0.00	0.00
其他债权投资	-	-	-	0.00	0.00
其他权益工具投资	-	-	-	0.00	0.00
应收证券清算款	-	-	-	9,097,056.89	9,097,056.89
应收股利	-	-	-	0.00	0.00
应收申购款	-	-	-	2,844,098.25	2,844,098.25
递延所得税资产	-	-	-	0.00	0.00
其他资产	-	-	-	0.00	0.00
资产总计	166,780,391.10	0.00	0.00	2,289,950,602.65	2,456,730,993.75
负债					
短期借款	-	-	-	0.00	0.00
交易性金融负债	-	-	-	0.00	0.00

衍生金融负债	-	-	-	0.00	0.00
卖出回购金融资产款	0.00	-	-	-	0.00
应付证券清算款	-	-	-	23,585,913.55	23,585,913.55
应付赎回款	-	-	-	9,737,258.16	9,737,258.16
应付管理人报酬	-	-	-	3,136,096.64	3,136,096.64
应付托管费	-	-	-	522,682.77	522,682.77
应付销售服务费	-	-	-	84,331.09	84,331.09
应付投资顾问费	-	-	-	0.00	0.00
应交税费	-	-	-	0.00	0.00
应付利润	-	-	-	0.00	0.00
递延所得税负债	-	-	-	0.00	0.00
其他负债	-	-	-	7,594,433.63	7,594,433.63
负债总计	0.00	0.00	0.00	44,660,715.84	44,660,715.84
利率敏感度缺口	166,780,391.10	0.00	0.00	2,245,289,886.81	2,412,070,277.91

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同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

本报告期末及上年度末，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的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

本基金的资产与负债均以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

在其他价格风险分析中，本基金管理人主要分析市场价格风险的影响。市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

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 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 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	1,947,874,287.31	90.34	2,278,009,447.51	94.44
交易性金融资产－基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产－贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产－权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,947,874,287.31	90.34	2,278,009,447.51	94.44

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	其他市场变量不变,沪深 300 指数上升或下降 1%		
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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	沪深 300 指数上升 1%	13,379,530.13	18,490,455.86
	沪深 300 指数下降 1%	-13,379,530.13	-18,490,455.86

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 2023 年 6 月 30 日
第一层次	1,945,228,008.63
第二层次	406,863.94
第三层次	2,239,414.74
合计	1,947,874,287.31

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2023 年 6 月 30 日，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

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债， 其账面价值与公允价值相差很小。

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	1,947,874,287.31	89.56

	其中：股票	1,947,874,287.31	89.56
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	191,110,313.29	8.79
8	其他各项资产	36,009,571.26	1.66
9	合计	2,174,994,171.86	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	-	-
B	采矿业	1,023,104.00	0.05
C	制造业	1,816,623,542.21	84.25
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	24,740,825.23	1.15
E	建筑业	28,613,223.15	1.33
F	批发和零售业	44,032.77	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	24,978,162.00	1.16
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	23,219,406.25	1.08
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	28,450,296.00	1.32
M	科学研究和技术服务业	157,912.84	0.01

N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	23,782.86	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,947,874,287.31	90.34

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末无港股通投资股票。

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	300750	宁德时代	776,161	177,577,875.19	8.24
2	300274	阳光电源	987,000	115,113,810.00	5.34
3	002709	天赐材料	2,784,100	114,677,079.00	5.32
4	603063	禾望电气	3,704,634	113,917,495.50	5.28
5	002594	比亚迪	401,468	103,687,140.36	4.81
6	300124	汇川技术	1,545,250	99,220,502.50	4.60
7	688223	晶科能源	6,146,404	86,418,440.24	4.01
8	688599	天合光能	1,973,933	84,109,285.13	3.90
9	603606	东方电缆	1,553,700	76,177,911.00	3.53
10	600732	爱旭股份	2,268,000	69,741,000.00	3.23
11	300724	捷佳伟创	561,800	63,118,230.00	2.93
12	002812	恩捷股份	647,439	62,380,747.65	2.89
13	002335	科华数据	1,655,105	59,501,024.75	2.76
14	603218	日月股份	3,132,656	59,489,137.44	2.76
15	603806	福斯特	1,500,476	55,802,702.44	2.59
16	600522	中天科技	3,406,500	54,197,415.00	2.51
17	688186	广大特材	1,648,723	53,632,959.19	2.49
18	002121	科陆电子	5,613,900	41,149,887.00	1.91
19	300763	锦浪科技	354,400	36,893,040.00	1.71
20	688103	国力股份	606,194	36,317,082.54	1.68
21	300415	伊之密	1,787,342	34,316,966.40	1.59
22	002769	普路通	3,565,200	28,450,296.00	1.32
23	601886	江河集团	3,169,300	28,175,077.00	1.31
24	601816	京沪高铁	4,748,700	24,978,162.00	1.16

25	301031	中熔电气	183,600	24,916,356.00	1.16
26	600452	涪陵电力	1,160,967	24,705,377.76	1.15
27	688800	瑞可达	377,613	23,468,647.95	1.09
28	300496	中科创达	238,100	22,940,935.00	1.06
29	002074	国轩高科	790,200	21,825,324.00	1.01
30	601100	恒立液压	330,500	21,261,065.00	0.99
31	688032	禾迈股份	58,113	20,638,831.95	0.96
32	688022	瀚川智能	468,751	16,935,973.63	0.79
33	300443	金雷股份	358,100	12,694,645.00	0.59
34	300257	开山股份	826,500	12,538,005.00	0.58
35	688261	东微半导	82,986	11,607,251.82	0.54
36	688348	昱能科技	59,427	11,162,173.41	0.52
37	603290	斯达半导	49,000	10,544,800.00	0.49
38	300037	新宙邦	200,700	10,414,323.00	0.48
39	603236	移远通信	165,491	9,550,485.61	0.44
40	688472	阿特斯	62,602	1,141,108.20	0.05
41	688443	智翔金泰	30,329	933,162.53	0.04
42	688515	裕太微	4,183	680,783.25	0.03
43	600685	中船防务	18,300	548,085.00	0.03
44	688409	富创精密	5,000	545,000.00	0.03
45	601669	中国电建	74,500	427,630.00	0.02
46	300569	天能重工	50,000	421,000.00	0.02
47	688400	凌云光	13,111	399,623.28	0.02
48	688819	天能股份	10,000	368,400.00	0.02
49	600348	华阳股份	45,300	358,323.00	0.02
50	601388	怡球资源	124,400	358,272.00	0.02
51	600438	通威股份	10,000	343,100.00	0.02
52	688576	西山科技	2,395	315,642.70	0.01
53	688707	振华新材	10,000	307,900.00	0.01
54	688582	芯动联科	6,476	299,402.44	0.01
55	603612	索通发展	16,100	279,013.00	0.01
56	601958	金钼股份	24,700	275,405.00	0.01
57	300855	图南股份	7,540	266,312.80	0.01
58	601677	明泰铝业	17,700	245,676.00	0.01
59	000975	银泰黄金	20,000	234,000.00	0.01
60	688543	国科军工	4,094	228,607.10	0.01
61	688167	炬光科技	2,014	216,605.70	0.01
62	002532	天山铝业	34,500	206,655.00	0.01
63	688211	中科微至	4,501	203,310.17	0.01
64	688280	精进电动	21,211	192,807.99	0.01
65	301383	天键股份	4,925	183,366.76	0.01
66	688623	双元科技	1,776	162,256.88	0.01
67	688629	华丰科技	7,073	160,957.02	0.01
68	688334	西高院	8,879	157,912.84	0.01

69	601001	晋控煤业	16,600	155,376.00	0.01
70	301397	溯联股份	3,618	152,606.80	0.01
71	301210	金杨股份	2,801	143,168.37	0.01
72	301395	仁信新材	5,196	138,629.28	0.01
73	688620	安凯微	10,157	135,209.66	0.01
74	688249	晶合集成	7,405	133,734.30	0.01
75	301315	威士顿	2,253	132,828.53	0.01
76	301225	恒勃股份	3,324	118,422.57	0.01
77	301292	海科新源	5,824	116,421.76	0.01
78	688631	莱斯信息	3,357	108,400.08	0.01
79	301232	飞沃科技	1,643	99,339.12	0.00
80	688429	时创能源	3,452	98,752.08	0.00
81	301323	新莱福	2,277	97,593.33	0.00
82	301170	锡南科技	2,496	92,283.70	0.00
83	301358	湖南裕能	2,023	86,766.47	0.00
84	688210	统联精密	4,347	84,853.44	0.00
85	301295	美硕科技	2,146	81,770.28	0.00
86	301202	朗威股份	3,060	79,009.20	0.00
87	300804	广康生化	2,257	77,134.83	0.00
88	688469	中芯集成	13,800	74,658.00	0.00
89	301260	格力博	3,121	73,749.23	0.00
90	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	0.00
91	688786	悦安新材	1,513	70,188.07	0.00
92	688361	中科飞测	831	53,740.77	0.00
93	688531	日联科技	346	47,045.62	0.00
94	301325	曼恩斯特	364	39,293.80	0.00
95	688146	中船特气	1,011	38,549.43	0.00
96	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.00
97	001287	中电港	1,386	29,133.72	0.00
98	301246	宏源药业	931	28,591.01	0.00
99	688352	颀中科技	2,361	28,497.27	0.00
100	301310	鑫宏业	409	26,760.87	0.00
101	301293	三博脑科	333	23,782.86	0.00
102	688552	航天南湖	956	22,466.00	0.00
103	688570	天玛智控	884	22,391.72	0.00
104	301322	绿通科技	392	20,870.08	0.00
105	688458	美芯晟	221	20,057.96	0.00
106	688581	安杰思	163	19,238.89	0.00
107	301439	泓淋电力	949	16,038.10	0.00
108	301332	德尔玛	1,122	15,405.06	0.00
109	301408	华人健康	879	14,899.05	0.00
110	301419	阿莱德	330	14,470.50	0.00
111	688593	新相微	959	13,991.81	0.00
112	301387	光大同创	307	13,925.52	0.00

113	688512	慧智微	721	13,814.36	0.00
114	301382	蜂助手	408	13,398.72	0.00
115	688433	华曙高科	418	13,167.00	0.00
116	301360	荣旗科技	134	12,408.40	0.00
117	301345	涛涛车业	266	12,406.24	0.00
118	301290	东星医疗	330	10,576.50	0.00
119	301429	森泰股份	499	10,488.98	0.00
120	601065	江盐集团	875	10,360.00	0.00
121	688479	友车科技	332	9,790.68	0.00
122	301355	南王科技	563	9,430.25	0.00
123	301357	北方长龙	190	9,194.10	0.00
124	301386	未来电器	378	8,992.62	0.00
125	301373	凌玮科技	277	8,822.45	0.00
126	601133	柏诚股份	664	8,140.64	0.00
127	301157	华塑科技	150	7,939.50	0.00
128	301337	亚华电子	232	7,045.84	0.00
129	301428	世纪恒通	229	7,007.40	0.00
130	001380	华纬科技	170	5,232.60	0.00
131	603125	常青科技	160	3,924.80	0.00
132	001282	三联锻造	105	3,468.15	0.00
133	001360	南矿集团	177	2,631.99	0.00
134	603137	恒尚节能	139	2,375.51	0.00
135	001324	长青科技	114	2,234.40	0.00
136	001367	海森药业	55	2,171.40	0.00
137	603172	万丰股份	122	1,967.86	0.00
138	300568	星源材质	71	1,220.49	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	300124	汇川技术	197,802,171.56	8.20
2	688599	天合光能	161,995,548.69	6.72
3	002121	科陆电子	141,438,625.06	5.86
4	603606	东方电缆	116,332,456.31	4.82
5	002709	天赐材料	109,376,104.98	4.53
6	002594	比亚迪	108,598,808.61	4.50
7	002812	恩捷股份	94,125,301.25	3.90
8	603218	日月股份	91,911,740.51	3.81
9	002335	科华数据	89,805,292.43	3.72

10	300274	阳光电源	87,171,094.96	3.61
11	603396	金辰股份	77,337,177.11	3.21
12	300850	新强联	66,370,338.28	2.75
13	300724	捷佳伟创	64,464,566.44	2.67
14	300068	南都电源	64,235,722.00	2.66
15	600732	爱旭股份	63,625,630.80	2.64
16	600522	中天科技	62,712,393.80	2.60
17	603985	恒润股份	62,541,170.90	2.59
18	300118	东方日升	62,334,774.60	2.58
19	688186	广大特材	58,173,059.92	2.41
20	603806	福斯特	57,824,106.40	2.40
21	301155	海力风电	56,821,097.00	2.36
22	688022	瀚川智能	51,583,142.69	2.14
23	601012	隆基绿能	51,244,208.18	2.12

注：本项“买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以数量）填列，不考虑相关费用。

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	002594	比亚迪	222,200,417.78	9.21
2	300274	阳光电源	193,922,453.27	8.04
3	300438	鹏辉能源	139,660,229.82	5.79
4	002121	科陆电子	133,268,267.30	5.53
5	002459	晶澳科技	106,657,745.95	4.42
6	688599	天合光能	106,210,004.55	4.40
7	601689	拓普集团	100,539,137.72	4.17
8	600875	东方电气	97,184,167.00	4.03
9	603606	东方电缆	96,916,616.20	4.02
10	300014	亿纬锂能	92,644,277.80	3.84
11	600522	中天科技	87,881,928.32	3.64
12	002335	科华数据	82,503,469.00	3.42
13	300124	汇川技术	80,670,374.38	3.34
14	002709	天赐材料	76,448,946.56	3.17
15	300068	南都电源	69,973,546.09	2.90
16	002812	恩捷股份	63,925,707.65	2.65
17	603396	金辰股份	61,530,748.00	2.55
18	000625	长安汽车	61,329,787.63	2.54
19	603985	恒润股份	61,187,181.90	2.54
20	301155	海力风电	60,416,456.50	2.50
21	300118	东方日升	55,863,084.04	2.32

22	002756	永兴材料	54,960,156.55	2.28
23	688223	晶科能源	51,381,098.34	2.13
24	300831	派瑞股份	49,104,495.00	2.04
25	000400	许继电气	48,853,481.80	2.03

注：本项“卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以数量）填列，不考虑相关费用。

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

买入股票的成本（成交）总额	3,355,781,791.78
卖出股票的收入（成交）总额	3,524,242,671.54

注：本项“买入股票的成本（成交）总额”与“卖出股票的收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以数量）填列，不考虑相关费用。

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

本基金本报告期尚无股指期货投资政策。

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

根据本基金基金合同，本基金不能投资于国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期未投资国债期货。

7.12 本报告期投资基金情况

7.12.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

7.13 投资组合报告附注

7.13.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否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

1、“爱旭股份”的发行人上海爱旭新能源股份有限公司

公司未能就发放年终奖做出合理预期并审慎做出决策，存货跌价损失测算中可变现净值的确定方法不合理，对限电影响造成损失的性质认定不准确，导致 2022 年 1 月 29 日业绩预告信息披露不准确。此外在 2022 年 4 月 22 日披露的业绩预告更正公告中对补充计提存货跌价损失的原因披露不准确、不完整。上述行为违反了《上市公司信息披露管理办法》（证监会令第 182 号）第三条第一款的规定。对此，上海证监局对公司出具警示函。【沪证监决[2022]286 号】

2、“天合光能”的发行人天合光能股份有限公司 2022 年 12 月 6 日因有关市场传闻事项被上交所下发监管工作函。

3、“东方电缆”的发行人宁波东方电缆股份有限公司，一：违反了《上市公司信息披露管理办法》第二十四条和第二十五条的规定。乐君杰作为东方电缆董事会秘书，未按照《上市公司信息披露管理办法》第四条、第五十一条第二款的规定履行忠实勤勉义务，未及时履行信息披露义务，对宁波东方电缆股份有限公司、乐君杰采取出具警示函的行政监管措施。【行政监管措施决定书[2023]5 号】二：东方电缆股东宁波东方集团有限公司，董事长夏崇耀、袁黎雨因未及时披露公司重大事件,未依法履行其他职责被上海证券交易所通报批评。

本公司对以上证券的投资决策符合法律法规及公司制度的相关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期末本基金投资的其他前十名证券没有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是否超出基金合同规定的备选股票库

本报告期，本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.13.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	965,290.81
2	应收清算款	33,799,379.01
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,244,901.44
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	36,009,571.26

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

新华鑫动力灵活配置混合 A	166,025	3,447.73	774,624.62	0.14%	571,634,797.55	99.86%
新华鑫动力灵活配置混合 C	108,849	3,681.68	311,976.33	0.08%	400,435,647.14	99.92%
合计	274,874	3,540.38	1,086,600.95	0.11%	972,070,444.69	99.89%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	新华鑫动力灵活配置混合 A	248,787.21	0.04%
	新华鑫动力灵活配置混合 C	43,136.35	0.01%
	合计	291,923.56	0.03%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	新华鑫动力灵活配置混合 A	0~10
	新华鑫动力灵活配置混合 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	新华鑫动力灵活配置混合 A	0~10
	新华鑫动力灵活配置混合 C	0
	合计	0~10

9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	新华鑫动力灵活配置混合 A	新华鑫动力灵活配置混合 C
基金合同生效日（2016 年 6 月 8 日）基金份额总额	206,788,092.88	412,424,807.76
本报告期期初基金份额总额	598,728,072.89	409,536,522.44
本报告期基金总申购份额	111,261,016.77	175,452,475.58
减：本报告期基金总赎回份额	137,579,667.49	184,241,374.55
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	572,409,422.17	400,747,623.47

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期本基金未召开基金份额持有人大会。

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

2023 年 2 月 28 日，翟晨曦女士离任公司董事长，于春玲女士代任公司董事长，刘征宇先生由于个人原因不再担任副总经理。2023 年 3 月 23 日，崔凤廷先生担任公司副总经理。2023 年 4 月，公司法定代表人变更为于春玲女士。2023 年 6 月 28 日，于春玲女士担任公司董事长、代任总经理，张宗友先生离任公司联席董事长，崔凤廷先生担任公司董事会秘书。

本报告期因第二届董事会任期届满，经公司 2023 年第二次股东大会审议通过，选举于春玲女士、张宗友先生、李磊先生、匡双礼先生、张坤女士、徐经长先生担任公司第三届董事会董事，其中匡双礼先生、张坤女士、徐经长先生为独立董事。卢东亮先生担任非职工监事，王建岭先生、孙义女士担任职工监事。2023 年 7 月 20 日，卢东亮先生担任监事会主席。

本报告期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

本报告期基金管理人与原深圳办公区所租房屋的房东黄淑娴与二房东（承租人）之间存在房屋占用费的纠纷案件，该案件二审判决作出，管理人需支付房屋使用费，二房东收取的房租应当退回。基金管理人专户产品众富 1 号交易对手湖北蕲春农商行对公司发起诉讼，目前该案件已申请撤诉。

本报告期未有涉及基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期未有基金投资策略的改变。

10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

本报告期本基金未持有基金。

10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未有改聘会计师事务所的情况。

10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.7.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人及其高级管理人员未有受稽查或处罚的情况。

10.7.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金托管人及其高级管理人员未有受稽查或处罚的情况。

10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.8.1 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	
东方财富	2	1,038,091,216.58	15.13%	759,160.51	14.01%	-
恒泰证券	2	803,742,805.31	11.71%	669,289.78	12.35%	-
中银国际	2	739,574,081.10	10.78%	540,848.44	9.98%	-
川财证券	1	635,506,447.00	9.26%	464,746.33	8.58%	-
兴业证券	1	568,252,452.05	8.28%	529,212.11	9.77%	-
中信证券	2	435,310,920.90	6.34%	405,406.22	7.48%	-
华福证券	2	370,369,259.72	5.40%	270,850.54	5.00%	-
安信证券	1	365,306,991.60	5.32%	267,146.32	4.93%	-
信达证券	1	278,596,064.65	4.06%	203,737.75	3.76%	-
东吴证券	1	277,100,694.65	4.04%	202,644.73	3.74%	-
华西证券	1	270,110,780.98	3.94%	251,553.71	4.64%	-
国盛证券	2	215,679,054.60	3.14%	157,725.13	2.91%	-
华创证券	2	213,672,916.38	3.11%	156,259.91	2.88%	-
中信建投	1	186,753,264.88	2.72%	136,573.85	2.52%	-
国泰君安	1	172,597,463.45	2.52%	160,745.71	2.97%	-
中金公司	2	140,972,635.12	2.05%	131,288.15	2.42%	-
天风证券	1	91,379,848.00	1.33%	66,825.04	1.23%	-
华泰证券	1	59,116,074.84	0.86%	43,229.69	0.80%	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
山西证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	2	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
中金财富	2	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
新时代证券	2	-	-	-	-	-

注：本基金根据中国证券监督管理委员会《关于加强证券投资基金监管有关问题的通知》（证监基字[1998]29 号）以及《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字

[2007]48 号）的有关规定，本基金共租用 47 个交易席位，其中报告期内新增 5 个交易席位，退租 0 个交易席位。新增席位为：华福证券上海席位、华福证券深圳席位、中金公司深圳席位 1 个、山西证券上海席位 1 个、山西证券深圳席位 1 个。

一、交易席位的分配依据

交易席位的分配以券商实力及其所提供的研究支持为基础，主要考察点包括：

1、经营行为稳健规范，内控制度健全。

2、具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要。

3、具有较强的全方位金融服务能力和水平。

二、交易席位的选择流程

1、研究部根据上述标准考察后确定选用交易席位的券商。

2、与被选中的证券经营机构签订席位租用协议。

三、交易量的分配

交易量的分配以券商所提供的服务及研究支持为基础，主要考察点包括：

1、券商提供独立的或第三方研究报告及服务，包括宏观经济、行业分析、公司研发、市场数据、财经信息、行业期刊、组合分析软件、绩效评估、研讨会、统计信息、交易评估等，用以支持投资决策。

2、以季度为单位对经纪商通过评分的方式进行考核，由基金经理、研究员和交易员分别打分，根据经纪商给投资带来的增值确定经纪商的排名。

考核的内容包括上一季度经纪交易执行情况、提供研究报告数量、研究报告质量和及时性、受邀讲解次数及效果、主动推介次数及效果等。考核结果将作为当期交易量分配的依据，交易量大小和评分高低成正比。

3、交易部负责落实交易量的实际分配工作。

10.8.2 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		回购交易		权证交易	
	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
东方财富	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	3,612,104.43	100.00%	-	-	-	-

中银国际	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
中金财富	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-

10.9 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	新华基金管理股份有限公司新华鑫动力灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告	中国证券报、公司网站、电子信披网站	2023-01-04
2	新华鑫动力灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）	公司网站、电子信披网站	2023-01-05
3	新华鑫动力灵活配置混合型证券投资基金（新华鑫动力灵活配置混合 A）基金产品资料概要	公司网站、电子信披网站	2023-01-05

	（更新）		
4	新华鑫动力灵活配置混合型证券投资基金（新华鑫动力灵活配置混合 C）基金产品资料概要（更新）	公司网站、电子信披网站	2023-01-05
5	新华基金管理股份有限公司旗下全部基金 2022 年 4 季度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、电子信披网站	2023-01-20
6	新华鑫动力灵活配置混合型证券投资基金 2022 年第 4 季度报告	公司网站、电子信披网站	2023-01-20
7	新华基金管理股份有限公司关于公司变更实际控制人的公告	中国证券报、公司网站、电子信披网站	2023-02-08
8	新华基金管理股份有限公司关于调整直销柜台及网上直销交易优惠费率的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、电子信披网站	2023-02-15
9	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加华瑞保险销售有限公司为代销机构并开通相关业务及参加网上费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、电子信披网站	2023-02-21
10	新华基金管理股份有限公司基金行业高级管理人员变更公告	中国证券报、公司网站、电子信披网站	2023-03-02
11	新华基金管理股份有限公司基金行业高级管理人员变更公告	中国证券报、公司网站、电子信披网站	2023-03-02
12	新华基金管理股份有限公司基金行业高级管理人员变更公告	中国证券报、公司网站、电子信披网站	2023-03-24
13	新华基金管理股份有限公司旗下基金年度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、电子信披网站	2023-03-30
14	新华鑫动力灵活配置混合型证券投资基金 2022 年年度报告	公司网站、电子信披网站	2023-03-30
15	新华基金管理股份有限公司关于旗下基金季度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、电子信披网站	2023-04-21
16	新华鑫动力灵活配置混合型证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	公司网站、电子信披网站	2023-04-21
17	新华基金管理股份有限公司关于公司法定代表人变更的公告	中国证券报、公司网站、电子信披网站	2023-04-25
18	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加上海中正达广基金销售有限公司为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、电子信披网站	2023-06-29
19	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加中国人寿保险股份有限公司基金申购、定期定额投资业务费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、电子信披网站	2023-06-30
20	新华基金管理股份有限公司关于公司董事变更的公告	中国证券报、公司网站、电子信披网站	2023-06-30

21	新华基金管理股份有限公司基金行业高级管理人员变更公告	中国证券报、公司网站、电子信披网站	2023-06-30
22	新华基金管理股份有限公司基金行业高级管理人员变更公告	中国证券报、公司网站、电子信披网站	2023-06-30
23	新华基金管理股份有限公司基金行业高级管理人员变更公告	中国证券报、公司网站、电子信披网站	2023-06-30

11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内本基金未有影响投资者决策的其他重要信息。

12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

(一)中国证监会批准新华鑫动力灵活配置混合型证券投资基金募集的文件

(二)关于申请募集新华鑫动力灵活配置混合型证券投资基金之法律意见书

(三)新华鑫动力灵活配置混合型证券投资基金基金合同

(四)新华鑫动力灵活配置混合型证券投资基金托管协议

(五)新华鑫动力灵活配置混合型证券投资基金登记结算服务协议

(六)《新华基金管理股份有限公司开放式基金业务规则》

(七)《新华鑫动力灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》（更新）

（八）《新华鑫动力灵活配置混合型证券投资基金产品资料概要》（更新）

(九)基金管理人业务资格批件、营业执照及公司章程

(十)基金托管人业务资格批件和营业执照

(十一)中国证监会要求的其他文件

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间内免费查阅，也可按工本费购买复印件，或通过本基金管理人网站查阅。

新华基金管理股份有限公司

二〇二三年八月三十日