

新华积极价值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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
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.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
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.....	12
5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	12
6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	14
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	17
7 投资组合报告	34
7.1 期末基金资产组合情况.....	34
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	34
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.....	35
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.....	46
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.....	46
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.....	47
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.....	47
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.....	47
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	47
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	47
7.12 本报告期投资基金情况.....	47
7.13 投资组合报告附注.....	47
8 基金份额持有人信息	49

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	49
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	49
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	49
9 开放式基金份额变动	50
10 重大事件揭示	50
10.1 基金份额持有人大会决议	50
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	50
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	50
10.4 基金投资策略的改变	50
10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件	51
10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况	51
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	51
10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况	51
10.9 其他重大事件	53
11 影响投资者决策的其他重要信息	55
12 备查文件目录	55
12.1 备查文件目录	55
12.2 存放地点	55
12.3 查阅方式	55

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	新华积极价值灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	新华积极价值灵活配置混合
基金主代码	001681
交易代码	001681
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 12 月 21 日
基金管理人	新华基金管理股份有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	33,730,463.97 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	主要投资于价值相对低估且具有良好成长性的中小市值股票，追求基金资产长期稳定的增值和收益，在合理风险限度内，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，本基金将以大类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	60%×中证 500 指数收益率+40%×中国债券总指数收益率
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	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	齐岩	郭明
	联系电话	010-68779688	010-66105799
	电子邮箱	qiyan@ncfund.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4008198866	95588
传真		010-68779528	010-66105798
注册地址		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55 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55 号
邮政编码		400010	100140

法定代表人	于春玲	陈四清
-------	-----	-----

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）
本期已实现收益	-1,608,190.27
本期利润	1,143,318.96
加权平均基金份额本期利润	0.0339
本期加权平均净值利润率	2.39%
本期基金份额净值增长率	2.44%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	13,205,253.96
期末可供分配基金份额利润	0.3915
期末基金资产净值	46,935,717.93
期末基金份额净值	1.3915
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	39.15%

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

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	3.07%	2.10%	-0.36%	0.55%	3.43%	1.55%
过去三个月	-2.93%	1.87%	-2.82%	0.49%	-0.11%	1.38%
过去六个月	2.44%	1.49%	1.81%	0.47%	0.63%	1.02%
过去一年	-22.51%	1.55%	-3.51%	0.57%	-19.00%	0.98%
过去三年	-10.51%	1.55%	3.62%	0.71%	-14.13%	0.84%
自基金合同生效起至今	39.15%	1.41%	-8.17%	0.84%	47.32%	0.57%

注：1、本基金合同生效日为 2015 年 12 月 21 日。

2、本基金股票投资部分的业绩比较基准为： $60\% \times$ 中证 500 指数收益率 $+40\% \times$ 中国债券总指数收益率。

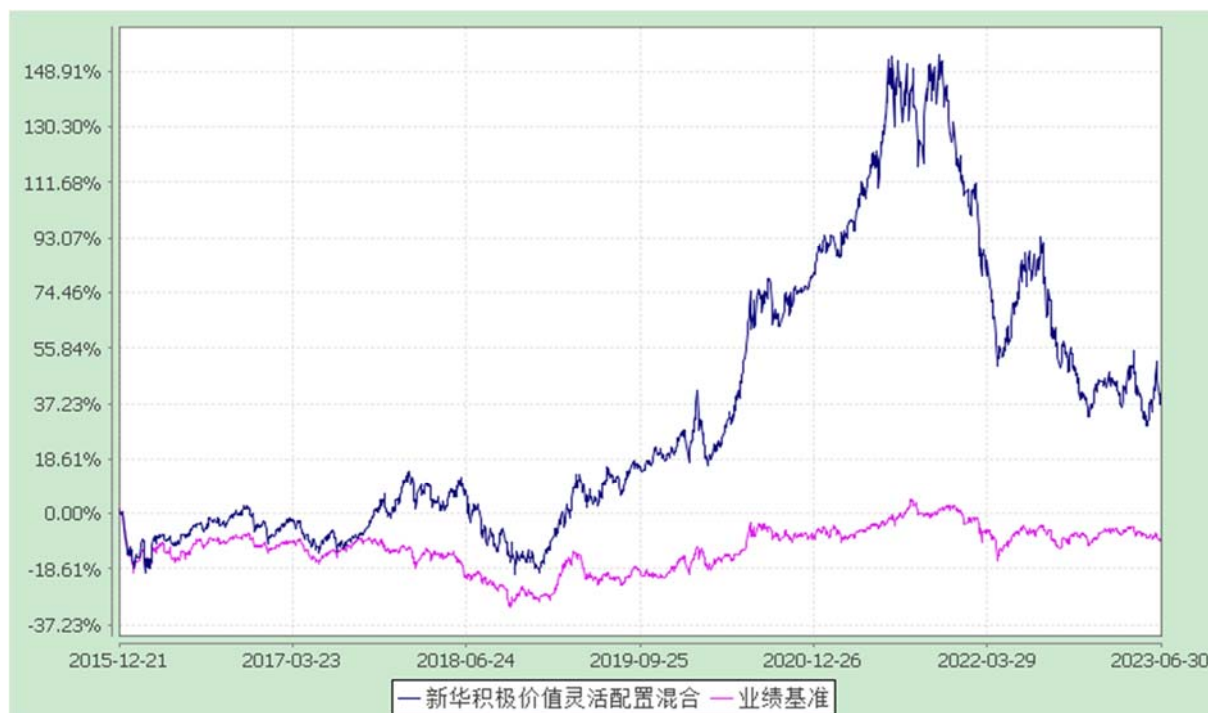
3、本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

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

新华积极价值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

(2015 年 12 月 21 日至 2023 年 6 月 30 日)



- 注：1、本基金合同生效日为 2015 年 12 月 21 日。
- 2、本报告期末本基金各项资产配置比例符合合同约定。

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		
王永明	本基金基金经理，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基金经理、新华中小市值优选混合型证券投资基金基金经理、新华安康多元收益一年持有期混合型证券投资基金基金经理。	2019-10-24	-	25	经济学博士，历任西南证券资产管理部研究员、恒泰证券研发中心经理、上海名禹资产管理有限公司研究总监、上海尚阳投资管理有限公司投资总监。

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合规守信情况的说明

本报告期，新华基金管理股份有限公司作为新华积极价值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》、《新华积极价值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

上半年, 尽管国内无风险收益率不断下行, 但权益市场却面临着赚钱效应缺乏、增量资金不足、海外资金流入趋缓等问题。虽然与智能化创新浪潮相关的通讯、传媒、计算机表现强势、涨幅较大, 但市值权重较高的传统周期股和大消费板块表现疲弱, 投资者风险偏好处于历史低位, 股票市场呈现较为显著的结构分化和存量博弈的特征。上半年本基金坚持以“性价比”为导向, 自上而下和自下而上相结合, 一方面。重点增配了与 AI 相关的投资方向和标的。另一方面, 自下而上挖掘了一些被市场忽视、低估的传统产业的优质公司, 并取得一定收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2023 年 6 月 30 日, 本基金份额净值为 1.3915 元, 本报告期份额净值增长率为 2.44%, 同期比较基准的增长率为 1.81%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年, 尽管权益市场仍面临着诸如外部环境压力、内需不足等困难和挑战, 但在上半年的反复调整中, 市场对此已有充分定价, 反应市场情绪的股债收益差已经重回历史低位。且海外面临美联储加息进入尾声, 国内已经对扩大内需提出了一系列的政策措施, 并提出活跃资本市场, 提振投资者信心等, 对投资者的预期起到较强的指引, 市场情绪出现改善, 两极分化的结构有所修复。此外, 生成式人工智能作为近十年来最为重要的科技创新, 虽然目前应用还在初期阶段, 行业格局尚不清晰, 但其令人惊艳的智能化水平和未来巨大的应用前景已经得到业界共识, 未来有望成为重要的生产力工具, 我们战略看好其长期发展趋势, 并将持续研究和跟踪。下半年, 我们将继续坚持以“性价比”为核心, 既要重视长期趋势, 也要关注阶段性的边际变化, 努力降低和减少回撤, 为持有人创造超额收益。

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

本报告期内，本基金未进行利润分配。

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

本基金自 2023 年 1 月 1 日起至 2023 年 2 月 8 日，连续 22 个工作日基金资产净值低于五千万元；自 2023 年 2 月 16 日起至 2023 年 3 月 31 日，连续 32 个工作日基金资产净值低于五千万元；自 2023 年 4 月 25 日起至 2023 年 6 月 16 日，连续 36 个工作日基金资产净值低于五千万元。

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，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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，本基金的管理人——新华基金管理股份有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现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真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对新华基金管理股份有限公司编制和披露的本基金 2023 年中期报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

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：新华积极价值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	3,370,590.81	4,269,080.03
结算备付金		291,233.68	89,230.93
存出保证金		34,487.43	33,041.00
交易性金融资产	6.4.7.2	44,116,819.14	42,656,942.88
其中：股票投资		44,116,144.03	42,656,289.19
基金投资		-	-
债券投资		675.11	653.69
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		570,349.07	-
应收股利		-	-
应收申购款		13,061.19	24,120.89
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		48,396,541.32	47,072,415.73
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		827,716.23	683,596.78
应付赎回款		22,751.55	13,681.96
应付管理人报酬		39,378.01	39,184.87
应付托管费		9,844.51	9,796.19
应付销售服务费		-	-
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	6.4.7.7	561,133.09	777,490.29
负债合计		1,460,823.39	1,523,750.09
净资产：			
实收基金	6.4.7.8	33,730,463.97	33,531,808.80
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.9	13,205,253.96	12,016,856.84
净资产合计		46,935,717.93	45,548,665.64
负债和净资产总计		48,396,541.32	47,072,415.73

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.3915 元，基金份额总额 33,730,463.97 份。

6.2 利润表

会计主体：新华积极价值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		1,499,726.71	-19,516,098.11
1.利息收入		11,057.66	22,912.30
其中：存款利息收入	6.4.7.10	11,057.66	22,912.30
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）		-1,293,710.73	-22,398,183.29
其中：股票投资收益	6.4.7.11	-1,439,904.61	-22,752,769.81
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.12	0.72	38,733.77
资产支持证券投资收益	6.4.7.13	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	146,193.16	315,852.75
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	2,751,509.23	2,836,369.84
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	30,870.55	22,803.04
减：二、营业总支出		356,407.75	501,264.70
1. 管理人报酬		237,499.41	329,165.68

2. 托管费		59,374.78	82,291.39
3. 销售服务费		-	-
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		-	0.18
8. 其他费用	6.4.7.19	59,533.56	89,807.45
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,143,318.96	-20,017,362.81
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,143,318.96	-20,017,362.81
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		1,143,318.96	-20,017,362.81

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：新华积极价值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）	33,531,808.80	-	12,016,856.84	45,548,665.64
二、本期期初净资产（基金净值）	33,531,808.80	-	12,016,856.84	45,548,665.64
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	198,655.17	-	1,188,397.12	1,387,052.29
（一）、综合收益总额	-	-	1,143,318.96	1,143,318.96
（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）	198,655.17	-	45,078.16	243,733.33
其中：1.基金申购款	5,687,986.12	-	2,468,959.10	8,156,945.22
2.基金赎回	-5,489,330.95	-	-2,423,880.94	-7,913,211.89

款				
(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)	33,730,463.97	-	13,205,253.96	46,935,717.93
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)	38,697,222.65	-	51,058,436.48	89,755,659.13
二、本期期初净资产(基金净值)	38,697,222.65	-	51,058,436.48	89,755,659.13
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-4,945,113.44	-	-24,201,457.88	-29,146,571.32
(一)、综合收益总额	-	-	-20,017,362.81	-20,017,362.81
(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)	-4,945,113.44	-	-4,184,095.07	-9,129,208.51
其中：1.基金申购款	5,030,867.01	-	4,499,157.67	9,530,024.68
2.基金赎回款	-9,975,980.45	-	-8,683,252.74	-18,659,233.19
(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)	33,752,109.21	-	26,856,978.60	60,609,087.81

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

新华积极价值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证监许可【2015】1493 号文《关于准予新华积极价值灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》注册募集，由新华基金管理股份有限公司发起募集的契约型开放式混合型证券投资基金，存续期不限定。于 2015 年 11 月 20 日通过新华基金管理股份有限公司的直销中心和取得基金代销业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务代理协议代为办理基金销售业务的代销机构公开发售，发行期限：2015 年 11 月 20 日至 2015 年 12 月 17 日。首次募集资金总额 494,979,346.03 元，其中募集资金产生利息 87,737.90 元，并经瑞华会计师事务所瑞华验字[2015] 01360029 号验资报告予以验证。2015 年 12 月 21 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，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《新华积极价值灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》及《新华积极价值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、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。本基金股票的投资比例为 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%，现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如法律法规或中国证监会允许，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。本基金的业绩比较基准为： $60\% \times \text{中证 500 指数收益率} + 40\% \times \text{中国债券总指数收益率}$ 。

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，按照财政部颁布的企业会计准则及其应用指南和解释、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他有关规定（统称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《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>》、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》、《新华积极价值灵活配置混

合型证券投资基金基金合同》和财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协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基金净值变动情况等有关信息。

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

本基金本报告期采用的会计政策、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

本基金本报告期内无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无会计差错更正。

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	3,370,590.81
等于：本金	3,370,250.03
加：应计利息	340.78
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	3,370,590.81

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		42,073,597.23	-	44,116,144.03	2,042,546.80
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	600.00	0.95	675.11	74.16
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	600.00	0.95	675.11	74.16
	资产支持证券	-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		42,074,197.23	0.95	44,116,819.14	2,042,620.96

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

本基金本报告期末无买入返售金融资产余额。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

本基金本期末无债权投资。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

本基金本期末无其他债权投资。

6.4.7.7 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	3.48
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	507,039.23
其中：交易所市场	507,039.23
银行间市场	-
应付利息	-
账户维护费	4,500.00
中国证券报	24,795.19
审计费	24,795.19
合计	561,133.09

6.4.7.8 实收基金

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（份）	账面金额
上年度末	33,531,808.80	33,531,808.80
本期申购	5,687,986.12	5,687,986.12
本期赎回（以“-”号填列）	-5,489,330.95	-5,489,330.95
本期末	33,730,463.97	33,730,463.97

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.9 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
上年度末	23,802,591.85	-11,785,735.01	12,016,856.84
本期利润	-1,608,190.27	2,751,509.23	1,143,318.96
本期基金份额交易产生的变动数	145,393.12	-100,314.96	45,078.16
其中：基金申购款	3,917,017.84	-1,448,058.74	2,468,959.10
基金赎回款	-3,771,624.72	1,347,743.78	-2,423,880.94
本期已分配利润	-	-	-

本期末	22,339,794.70	-9,134,540.74	13,205,253.96
-----	---------------	---------------	---------------

6.4.7.10 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	9,121.60
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	1,936.06
其他	-
合计	11,057.66

注：结算备付金利息收入包括存出保证金利息收入。

6.4.7.11 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	154,786,354.89
减：卖出股票成本总额	155,810,385.02
减：交易费用	415,874.48
买卖股票差价收入	-1,439,904.61

6.4.7.12 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	0.72
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	0.72

6.4.7.13 资产支持证券投资收益

6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.16 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	146,193.16
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	146,193.16

6.4.7.17 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	2,751,509.23
——股票投资	2,751,488.53
——债券投资	20.70
——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	2,751,509.23

6.4.7.18 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	30,855.93
补差费收入	14.62
合计	30,870.55

6.4.7.19 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	24,795.19
信息披露费	-
证券出借违约金	-
银行汇划费	943.18
中国证券报	24,795.19
账户维护费	9,000.00
合计	59,533.56

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，本基金并无需要作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金从 2023 年 8 月 21 日起，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
中国工商银行股份有限公司	基金托管人
新华基金管理股份有限公司	基金管理人、基金发起人

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	51,316,682.82	16.60%	41,169,708.71	6.34%

6.4.10.1.2 权证交易

本报告期及上年度可比期间，本基金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

本报告期及上年度可比期间，本基金均无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

本报告期及上年度可比期间，本基金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	37,528.42	15.85%	33,930.59	6.69%
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	30,107.98	5.97%	7,562.15	1.25%

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	237,499.41	329,165.68
其中：支付销售机构的客户维护费	110,242.57	154,761.63

注：1、本基金的管理费按前一日基金资产净值 1.00%年费率计提。管理费的计算方法为：每日基金管理费=前一日基金资产净值×1.00%÷当年天数。

2、客户维护费是指基金管理人与基金销售机构在基金销售协议中约定的依据销售机构销售基金的保有量提取一定比例的客户维护费，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 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	59,374.78	82,291.39

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。

6.4.10.3 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		上年度可比期间	
	2023年1月1日至2023年6月30日		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
中国工商银行股份有限公司	3,370,590.81	9,121.60	5,763,083.20	17,425.72

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在报告期内未参与关联方承销证券。

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

截止报告期期末，本基金未持有因认购新发/增发证券产生的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

截至报告期期末，本基金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

报告期末，本基金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

报告期末，本基金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未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

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023年6月30日	上年末 2022年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	675.11	653.69
未评级	0.00	0.00
合计	675.11	653.69

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同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	3,370,590.81	-	-	-	3,370,590.81

结算备付金	291,233.68	-	-	-	291,233.68
存出保证金	34,487.43	-	-	-	34,487.43
交易性金融资产	0.00	675.11	0.00	44,116,144.03	44,116,819.14
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	-	-	-	570,349.07	570,349.07
应收股利	-	-	-	0.00	0.00
应收申购款	-	-	-	13,061.19	13,061.19
递延所得税资产	-	-	-	0.00	0.00
其他资产	-	-	-	0.00	0.00
资产总计	3,696,311.92	675.11	0.00	44,699,554.29	48,396,541.32
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	-	-	-	827,716.23	827,716.23
应付赎回款	-	-	-	22,751.55	22,751.55
应付管理人报酬	-	-	-	39,378.01	39,378.01
应付托管费	-	-	-	9,844.51	9,844.51
应付销售服务费	-	-	-	0.00	0.00
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	-	-	-	561,133.09	561,133.09
负债总计	0.00	0.00	0.00	1,460,823.39	1,460,823.39
利率敏感度缺口	3,696,311.92	675.11	0.00	43,238,730.90	46,935,717.93
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	4,269,080.03	-	-	-	4,269,080.03
结算备付金	89,230.93	-	-	-	89,230.93
存出保证金	33,041.00	-	-	-	33,041.00
交易性金融资产	0.00	653.69	0.00	42,656,289.19	42,656,942.88
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	-	-	-	0.00	0.00
应收股利	-	-	-	0.00	0.00
应收申购款	-	-	-	24,120.89	24,120.89
递延所得税资产	-	-	-	0.00	0.00
其他资产	-	-	-	0.00	0.00
资产总计	4,391,351.96	653.69	0.00	42,680,410.08	47,072,415.73
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	-	-	-	683,596.78	683,596.78
应付赎回款	-	-	-	13,681.96	13,681.96
应付管理人报酬	-	-	-	39,184.87	39,184.87
应付托管费	-	-	-	9,796.19	9,796.19
应付销售服务费	-	-	-	0.00	0.00
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	-	-	-	777,490.29	777,490.29
负债总计	0.00	0.00	0.00	1,523,750.09	1,523,750.09
利率敏感度缺口	4,391,351.96	653.69	0.00	41,156,659.99	45,548,665.64

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

假设	其他市场变量不变，市场利率上升或下降 25 个基点
----	---------------------------

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
	市场利率上升 25.00 bp	-5.63	-6.24
	市场利率下降 25.00 bp	5.69	6.31

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	44,116,144.03	93.99	42,656,289.19	93.65
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	675.11	0.00	653.69	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	44,116,819.14	93.99	42,656,942.88	93.65

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%	475,454.60	392,617.52
	沪深 300 指数下降 1%	-475,454.60	-392,617.52

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	44,116,819.14
第二层次	-
第三层次	-
合计	44,116,819.14

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

本基金于本报告期末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

无。

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	44,116,144.03	91.16
	其中：股票	44,116,144.03	91.16
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	675.11	0.00
	其中：债券	675.11	0.00
	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	3,661,824.49	7.57
8	其他各项资产	617,897.69	1.28
9	合计	48,396,541.32	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	32,466.74	0.07
C	制造业	26,267,364.54	55.96
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	77,030.45	0.16
E	建筑业	3,295,488.95	7.02
F	批发和零售业	54,366.08	0.12
G	交通运输、仓储和邮政业	51,689.68	0.11
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,584,773.26	24.68
J	金融业	30,227.34	0.06
K	房地产业	12,579.84	0.03
L	租赁和商务服务业	24,893.63	0.05
M	科学研究和技术服务业	123,829.37	0.26
N	水利、环境和公共设施管理业	109,591.75	0.23
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	650,010.00	1.38
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	1,801,832.40	3.84
S	综合	-	-
	合计	44,116,144.03	93.99

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

报告期末本基金未持有港股通投资股票。

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	688111	金山办公	6,690	3,159,151.80	6.73
2	002230	科大讯飞	37,900	2,575,684.00	5.49
3	000977	浪潮信息	48,600	2,357,100.00	5.02
4	600498	烽火通信	105,000	2,138,850.00	4.56

5	300394	天孚通信	19,200	2,051,136.00	4.37
6	300251	光线传媒	212,600	1,719,934.00	3.66
7	300496	中科创达	17,200	1,657,220.00	3.53
8	688036	传音控股	11,176	1,642,872.00	3.50
9	688246	嘉和美康	36,195	1,515,484.65	3.23
10	002568	百润股份	40,900	1,486,715.00	3.17
11	601390	中国中铁	185,000	1,402,300.00	2.99
12	688389	普门科技	59,400	1,395,306.00	2.97
13	601138	工业富联	50,300	1,267,560.00	2.70
14	600720	祁连山	111,000	1,262,070.00	2.69
15	002463	沪电股份	48,900	1,023,966.00	2.18
16	688665	四方光电	10,885	1,013,611.20	2.16
17	000032	深桑达 A	29,400	967,260.00	2.06
18	002271	东方雨虹	33,800	921,388.00	1.96
19	688320	禾川科技	19,077	919,892.94	1.96
20	603986	兆易创新	7,500	796,875.00	1.70
21	688256	寒武纪	4,159	781,892.00	1.67
22	688048	长光华芯	8,079	763,627.08	1.63
23	300188	美亚柏科	36,600	760,914.00	1.62
24	688030	山石网科	34,076	730,248.68	1.56
25	688302	海创药业	13,627	723,866.24	1.54
26	688080	映翰通	14,164	692,619.60	1.48
27	002607	中公教育	138,300	650,010.00	1.38
28	300638	广和通	23,760	538,876.80	1.15
29	300502	新易盛	7,500	509,775.00	1.09
30	688687	凯因科技	16,931	499,464.50	1.06
31	601689	拓普集团	6,000	484,200.00	1.03
32	688008	澜起科技	8,279	475,380.18	1.01
33	688176	亚虹医药	40,191	469,832.79	1.00
34	002050	三花智控	15,300	462,978.00	0.99
35	601618	中国中冶	112,300	445,831.00	0.95
36	601068	中铝国际	83,100	445,416.00	0.95
37	688382	益方生物	31,540	431,782.60	0.92
38	300418	昆仑万维	8,100	326,268.00	0.70
39	301021	英诺激光	2,899	75,779.86	0.16
40	688121	卓然股份	1,742	65,150.80	0.14
41	301038	深水规院	3,458	62,555.22	0.13
42	301188	力诺特玻	3,450	58,926.00	0.13
43	301133	金钟股份	2,178	57,847.68	0.12
44	301149	隆华新材	4,947	51,646.68	0.11
45	301090	华润材料	3,788	47,804.56	0.10
46	301033	迈普医学	1,076	47,300.96	0.10
47	301032	新柴股份	5,124	45,859.80	0.10
48	301072	中捷精工	1,802	45,140.10	0.10

49	301087	可孚医疗	848	41,806.40	0.09
50	301118	恒光股份	1,466	39,186.18	0.08
51	301049	超越科技	1,758	38,851.80	0.08
52	301079	邵阳液压	1,815	38,695.80	0.08
53	301037	保立佳	2,115	37,689.30	0.08
54	605090	九丰能源	1,526	34,075.58	0.07
55	301027	华蓝集团	2,760	33,920.40	0.07
56	300957	贝泰妮	376	33,418.88	0.07
57	300919	中伟股份	549	33,077.25	0.07
58	001330	博纳影业	3,564	33,073.92	0.07
59	600955	维远股份	1,694	32,914.42	0.07
60	300854	中兰环保	2,026	32,213.40	0.07
61	605020	永和股份	1,190	30,713.90	0.07
62	600927	永安期货	1,859	30,227.34	0.06
63	001311	多利科技	504	28,944.72	0.06
64	301081	严牌股份	2,897	28,825.15	0.06
65	301036	双乐股份	1,535	28,750.55	0.06
66	601921	浙版传媒	3,154	27,408.26	0.06
67	601089	福元医药	1,621	26,422.30	0.06
68	605507	国邦医药	1,202	25,566.54	0.05
69	001338	永顺泰	1,383	25,502.52	0.05
70	603171	税友股份	637	25,467.26	0.05
71	603255	鼎际得	488	24,770.88	0.05
72	001308	康冠科技	867	23,807.82	0.05
73	003031	中瓷电子	171	22,763.52	0.05
74	603281	江瀚新材	725	22,388.00	0.05
75	603206	嘉环科技	1,210	20,872.50	0.04
76	603191	望变电气	1,054	20,500.30	0.04
77	001215	千味央厨	295	19,614.55	0.04
78	301088	戎美股份	1,094	19,549.78	0.04
79	605011	杭州热电	525	18,574.50	0.04
80	301093	华兰股份	531	18,372.60	0.04
81	600935	华塑股份	4,811	18,041.25	0.04
82	603235	天新药业	572	17,937.92	0.04
83	603209	兴通股份	833	17,667.93	0.04
84	605286	同力日升	597	17,265.24	0.04
85	001208	华菱线缆	1,754	16,627.92	0.04
86	601121	宝地矿业	1,973	15,073.72	0.03
87	300926	博俊科技	646	14,754.64	0.03
88	603230	内蒙新华	1,141	14,718.90	0.03
89	001228	永泰运	383	14,718.69	0.03
90	300918	南山智尚	1,063	14,594.99	0.03
91	603070	万控智造	775	14,484.75	0.03
92	300925	法本信息	1,020	14,412.60	0.03

93	605555	德昌股份	822	14,352.12	0.03
94	001339	智微智能	474	14,063.58	0.03
95	001314	亿道信息	330	13,952.40	0.03
96	603057	紫燕食品	549	13,796.37	0.03
97	301069	凯盛新材	539	13,712.16	0.03
98	603051	鹿山新材	272	12,737.76	0.03
99	603097	江苏华辰	560	12,689.60	0.03
100	300917	特发服务	512	12,579.84	0.03
101	605289	罗曼股份	325	12,450.75	0.03
102	603176	汇通集团	1,924	12,313.60	0.03
103	605319	无锡振华	764	12,124.68	0.03
104	601022	宁波远洋	1,150	11,948.50	0.03
105	603170	宝立食品	542	11,522.92	0.02
106	605259	绿田机械	295	11,451.90	0.02
107	001207	联科科技	682	11,403.04	0.02
108	601279	英利汽车	2,004	11,102.16	0.02
109	001218	丽臣实业	490	11,078.90	0.02
110	001317	三羊马	300	11,070.00	0.02
111	001298	好上好	438	10,840.50	0.02
112	001229	魅视科技	324	10,789.20	0.02
113	001319	铭科精技	509	10,668.64	0.02
114	300932	三友联众	689	10,638.16	0.02
115	603162	海通发展	620	10,571.00	0.02
116	603219	富佳股份	739	10,530.75	0.02
117	001260	坤泰股份	484	10,401.16	0.02
118	603215	比依股份	575	10,315.50	0.02
119	603836	海程邦达	662	10,174.94	0.02
120	001288	运机集团	537	10,149.30	0.02
121	603153	上海建科	569	10,099.75	0.02
122	300940	南极光	589	10,018.89	0.02
123	001313	粤海饲料	1,232	9,732.80	0.02
124	605123	派克新材	89	9,669.85	0.02
125	605365	立达信	645	9,662.10	0.02
126	603213	镇洋发展	799	9,532.07	0.02
127	001268	联合精密	409	9,492.89	0.02
128	301046	能辉科技	290	9,483.00	0.02
129	605488	福莱新材	603	9,461.07	0.02
130	001299	美能能源	576	9,394.56	0.02
131	001206	依依股份	629	9,309.20	0.02
132	605086	龙高股份	443	9,205.54	0.02
133	001230	劲旅环境	375	9,191.25	0.02
134	605378	野马电池	394	9,184.14	0.02
135	001222	源飞宠物	607	9,183.91	0.02
136	603190	亚通精工	300	9,180.00	0.02

137	001333	光华股份	362	9,097.06	0.02
138	300950	德固特	429	9,094.80	0.02
139	603130	云中马	400	9,084.00	0.02
140	001238	浙江正特	374	8,800.22	0.02
141	300933	中辰股份	1,117	8,600.90	0.02
142	001231	农心科技	355	8,445.45	0.02
143	001219	青岛食品	460	8,390.40	0.02
144	001366	播恩集团	544	8,388.48	0.02
145	001210	金房能源	373	8,377.58	0.02
146	605189	富春染织	506	8,303.46	0.02
147	605287	德才股份	349	8,271.30	0.02
148	603182	嘉华股份	546	8,255.52	0.02
149	603132	金徽股份	722	8,187.48	0.02
150	001278	一彬科技	343	8,156.54	0.02
151	605567	春雪食品	629	8,070.07	0.02
152	300922	天秦装备	402	8,035.98	0.02
153	001209	洪兴股份	450	8,014.50	0.02
154	001368	通达创智	315	8,007.30	0.02
155	605566	福莱蒾特	348	8,004.00	0.02
156	605033	美邦股份	423	7,910.10	0.02
157	603127	昭衍新药	190	7,771.00	0.02
158	603216	梦天家居	570	7,769.10	0.02
159	300937	药易购	244	7,756.76	0.02
160	603151	邦基科技	471	7,696.14	0.02
161	300952	恒辉安防	340	7,670.40	0.02
162	001336	楚环科技	274	7,666.52	0.02
163	001256	炜冈科技	415	7,636.00	0.02
164	001234	泰慕士	333	7,592.40	0.02
165	603280	南方路机	304	7,472.32	0.02
166	603048	浙江黎明	464	7,470.40	0.02
167	003042	中农联合	356	7,376.32	0.02
168	300945	曼卡龙	474	7,356.48	0.02
169	603065	宿迁联盛	493	7,345.70	0.02
170	002992	宝明科技	117	7,286.76	0.02
171	300948	冠中生态	478	7,222.58	0.02
172	605069	正和生态	790	6,912.50	0.01
173	605577	龙版传媒	588	6,697.32	0.01
174	603150	万朗磁塑	250	6,590.00	0.01
175	300943	春晖智控	382	6,478.72	0.01
176	603291	联合水务	423	6,433.83	0.01
177	300927	江天化学	391	6,400.67	0.01
178	300833	浩洋股份	58	6,346.94	0.01
179	001266	宏英智能	218	6,332.90	0.01
180	605138	盛泰集团	723	6,304.56	0.01

181	002990	盛视科技	164	6,035.20	0.01
182	300956	英力股份	371	5,835.83	0.01
183	301078	孩子王	499	5,703.57	0.01
184	300931	通用电梯	713	5,597.05	0.01
185	002987	京北方	255	5,589.60	0.01
186	003041	真爱美家	351	5,566.86	0.01
187	300942	易瑞生物	443	5,533.07	0.01
188	300958	建工修复	300	5,322.00	0.01
189	301055	张小泉	355	5,051.65	0.01
190	300842	帝科股份	55	5,029.20	0.01
191	301040	中环海陆	241	4,952.55	0.01
192	300955	嘉亨家化	232	4,941.60	0.01
193	300960	通业科技	234	4,874.22	0.01
194	603931	格林达	151	4,597.95	0.01
195	300961	深水海纳	394	4,243.38	0.01
196	003038	鑫铂股份	100	4,146.00	0.01
197	300929	华骐环保	363	4,112.79	0.01
198	003021	兆威机电	40	3,509.20	0.01
199	603155	新亚强	128	3,271.68	0.01
200	300858	科拓生物	202	3,266.34	0.01
201	605337	李子园	160	2,924.80	0.01
202	300853	申昊科技	77	2,702.70	0.01
203	300845	捷安高科	110	2,390.30	0.01
204	003026	中晶科技	60	2,359.80	0.01
205	003020	立方制药	62	2,294.62	0.00
206	605060	联德股份	83	2,279.18	0.00
207	605077	华康股份	80	2,118.40	0.00
208	002983	芯瑞达	81	1,998.27	0.00
209	605298	必得科技	118	1,883.28	0.00
210	003005	竞业达	60	1,841.40	0.00
211	002989	中天精装	101	1,646.30	0.00
212	003027	同兴环保	73	1,522.05	0.00
213	002997	瑞鹄模具	51	1,516.23	0.00
214	003002	壶化股份	90	1,423.80	0.00
215	605118	力鼎光电	78	1,354.86	0.00
216	003028	振邦智能	32	1,337.92	0.00
217	605186	健麾信息	26	1,287.00	0.00
218	605377	华旺科技	70	1,263.50	0.00
219	601702	华峰铝业	88	1,203.84	0.00
220	603439	贵州三力	69	1,177.14	0.00
221	300801	泰和科技	73	1,175.30	0.00
222	300802	矩子科技	48	1,155.36	0.00
223	605100	华丰股份	63	1,110.69	0.00
224	300843	胜蓝股份	51	1,087.83	0.00

225	003000	劲仔食品	84	1,057.56	0.00
226	605258	协和电子	40	1,039.20	0.00
227	003036	泰坦股份	76	1,024.48	0.00
228	605500	森林包装	129	962.34	0.00
229	605177	东亚药业	39	960.96	0.00
230	003037	三和管桩	74	910.20	0.00
231	605058	澳弘电子	38	853.10	0.00
232	600916	中国黄金	71	838.51	0.00
233	605088	冠盛股份	47	806.05	0.00
234	002986	宇新股份	29	799.82	0.00
235	605222	起帆电缆	37	764.42	0.00
236	605166	聚合顺	81	754.92	0.00
237	605183	确成股份	41	742.10	0.00
238	605333	沪光股份	44	727.76	0.00
239	605133	嵘泰股份	18	625.68	0.00
240	605008	长鸿高科	41	584.66	0.00
241	605116	奥锐特	23	581.44	0.00
242	605007	五洲特纸	38	576.08	0.00
243	605005	合兴股份	34	538.22	0.00
244	003029	吉大正元	16	519.20	0.00
245	605066	天正电气	54	508.14	0.00
246	605388	均瑶健康	38	482.98	0.00
247	300846	首都在线	31	475.85	0.00
248	603950	长源东谷	31	463.76	0.00
249	605255	天普股份	28	442.40	0.00
250	605050	福然德	35	432.25	0.00
251	605268	王力安防	42	429.66	0.00
252	003016	欣贺股份	41	414.10	0.00
253	605199	葫芦娃	27	408.78	0.00
254	002998	优彩资源	55	390.50	0.00
255	300857	协创数据	12	315.36	0.00
256	002996	顺博合金	25	302.50	0.00
257	605055	迎丰股份	46	274.16	0.00
258	003015	日久光电	28	265.16	0.00
259	003018	金富科技	27	261.09	0.00
260	605158	华达新材	34	258.40	0.00
261	605001	威奥股份	35	244.65	0.00
262	300849	锦盛新材	21	228.06	0.00
263	605277	新亚电子	14	226.24	0.00
264	603408	建霖家居	17	176.63	0.00
265	600956	新天绿能	20	174.40	0.00
266	003004	声迅股份	6	173.22	0.00
267	300838	浙江力诺	9	164.43	0.00
268	605228	神通科技	17	162.69	0.00

269	003025	思进智能	10	161.50	0.00
270	605068	明新旭腾	6	146.76	0.00
271	300830	金现代	14	133.00	0.00
272	300839	博汇股份	4	53.16	0.00
273	300920	润阳科技	3	51.63	0.00
274	605218	伟时电子	2	31.00	0.00
275	605188	国光连锁	3	25.86	0.00
276	605336	帅丰电器	1	17.20	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	002230	科大讯飞	3,591,438.50	7.88
2	300820	英杰电气	3,452,245.00	7.58
3	000977	浪潮信息	3,241,297.00	7.12
4	300418	昆仑万维	2,859,731.00	6.28
5	688111	金山办公	2,736,098.96	6.01
6	002222	福晶科技	2,734,098.00	6.00
7	600498	烽火通信	2,594,975.00	5.70
8	600050	中国联通	2,536,798.00	5.57
9	000858	五粮液	2,414,867.00	5.30
10	601728	中国电信	2,322,442.00	5.10
11	688041	海光信息	2,267,899.40	4.98
12	002371	北方华创	2,267,726.00	4.98
13	300033	同花顺	2,263,193.00	4.97
14	688677	海泰新光	2,229,647.57	4.90
15	002271	东方雨虹	2,192,563.00	4.81
16	002568	百润股份	2,180,076.00	4.79
17	300496	中科创达	2,091,646.00	4.59
18	300394	天孚通信	2,086,638.00	4.58
19	600641	万业企业	2,034,290.00	4.47
20	002463	沪电股份	1,982,428.60	4.35
21	688012	中微公司	1,972,246.58	4.33
22	300251	光线传媒	1,963,936.00	4.31
23	603986	兆易创新	1,945,453.00	4.27
24	600519	贵州茅台	1,920,999.00	4.22
25	000661	长春高新	1,915,975.00	4.21
26	300182	捷成股份	1,904,686.00	4.18
27	000063	中兴通讯	1,859,283.00	4.08

28	688036	传音控股	1,857,934.64	4.08
29	300188	美亚柏科	1,847,948.00	4.06
30	688032	禾迈股份	1,825,888.80	4.01
31	002646	天佑德酒	1,591,982.00	3.50
32	688389	普门科技	1,554,587.41	3.41
33	002755	奥赛康	1,511,707.00	3.32
34	688002	睿创微纳	1,492,694.12	3.28
35	300223	北京君正	1,475,639.00	3.24
36	002156	通富微电	1,465,876.00	3.22
37	600702	舍得酒业	1,464,753.00	3.22
38	601318	中国平安	1,461,480.00	3.21
39	600027	华电国际	1,456,136.00	3.20
40	000799	酒鬼酒	1,455,368.00	3.20
41	601888	中国中免	1,445,410.00	3.17
42	688787	海天瑞声	1,427,153.95	3.13
43	688302	海创药业	1,423,954.05	3.13
44	601390	中国中铁	1,417,134.00	3.11
45	688246	嘉和美康	1,397,892.61	3.07
46	600720	祁连山	1,395,292.00	3.06
47	300073	当升科技	1,385,297.00	3.04
48	002709	天赐材料	1,381,690.00	3.03
49	300308	中际旭创	1,377,720.00	3.02
50	000681	视觉中国	1,359,908.00	2.99
51	688223	晶科能源	1,339,938.35	2.94
52	688521	芯原股份	1,297,145.44	2.85
53	688179	阿拉丁	1,260,154.90	2.77
54	300624	万兴科技	1,182,628.00	2.60
55	601618	中国中冶	1,172,898.00	2.58
56	300795	米奥会展	1,154,692.00	2.54
57	300718	长盛轴承	1,026,600.00	2.25
58	002292	奥飞娱乐	1,015,821.00	2.23
59	002384	东山精密	997,818.00	2.19
60	688048	长光华芯	979,218.38	2.15
61	002793	罗欣药业	976,057.00	2.14
62	300811	铂科新材	975,972.00	2.14
63	300364	中文在线	975,554.00	2.14
64	688030	山石网科	975,190.95	2.14
65	688095	福昕软件	969,656.76	2.13
66	000729	燕京啤酒	969,648.00	2.13
67	600559	老白干酒	967,920.00	2.13
68	603985	恒润股份	964,643.00	2.12
69	688382	益方生物	957,512.57	2.10
70	688665	四方光电	957,001.56	2.10
71	600197	伊力特	956,190.00	2.10

72	300782	卓胜微	953,412.00	2.09
73	300667	必创科技	952,866.00	2.09
74	300476	胜宏科技	947,121.00	2.08
75	601800	中国交建	943,879.00	2.07
76	300827	上能电气	939,751.00	2.06
77	000032	深桑达 A	935,853.00	2.05
78	688256	寒武纪	934,140.86	2.05
79	002531	天顺风能	931,500.00	2.05
80	601138	工业富联	930,549.00	2.04
81	603659	璞泰来	925,215.50	2.03
82	300724	捷佳伟创	923,440.00	2.03
83	688080	映翰通	913,057.50	2.00

注：本项“买入金额”均按买入成交金额（成交单价乘以数量）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	300820	英杰电气	3,502,239.00	7.69
2	300073	当升科技	3,394,632.00	7.45
3	002222	福晶科技	3,277,415.00	7.20
4	002371	北方华创	3,135,812.00	6.88
5	688677	海泰新光	3,131,902.28	6.88
6	688041	海光信息	3,004,352.48	6.60
7	002271	东方雨虹	2,669,544.00	5.86
8	000063	中兴通讯	2,456,957.00	5.39
9	002646	天佑德酒	2,411,967.00	5.30
10	300418	昆仑万维	2,399,412.00	5.27
11	000858	五粮液	2,350,150.00	5.16
12	300182	捷成股份	2,340,215.24	5.14
13	300033	同花顺	2,320,091.00	5.09
14	300308	中际旭创	2,271,761.00	4.99
15	688050	爱博医疗	2,184,572.49	4.80
16	000661	长春高新	2,173,088.00	4.77
17	688179	阿拉丁	2,136,712.51	4.69
18	603985	恒润股份	2,119,874.00	4.65
19	600050	中国联通	2,089,811.00	4.59
20	300750	宁德时代	2,062,563.07	4.53
21	688012	中微公司	2,032,848.47	4.46
22	601728	中国电信	2,010,519.00	4.41
23	603198	迎驾贡酒	1,882,584.00	4.13

24	300724	捷佳伟创	1,861,355.00	4.09
25	688223	晶科能源	1,804,734.16	3.96
26	600641	万业企业	1,801,680.00	3.96
27	600519	贵州茅台	1,771,001.00	3.89
28	300274	阳光电源	1,762,541.00	3.87
29	000681	视觉中国	1,760,975.00	3.87
30	603919	金徽酒	1,664,494.00	3.65
31	600276	恒瑞医药	1,615,888.00	3.55
32	600027	华电国际	1,602,080.00	3.52
33	000807	云铝股份	1,567,519.82	3.44
34	000977	浪潮信息	1,514,644.00	3.33
35	002755	奥赛康	1,482,935.00	3.26
36	688032	禾迈股份	1,482,126.00	3.25
37	000625	长安汽车	1,467,001.04	3.22
38	000002	万 科 A	1,459,385.00	3.20
39	002230	科大讯飞	1,459,245.00	3.20
40	688139	海尔生物	1,449,015.13	3.18
41	002156	通富微电	1,394,266.00	3.06
42	002594	比亚迪	1,368,534.00	3.00
43	688002	睿创微纳	1,354,697.46	2.97
44	601888	中国中免	1,352,840.00	2.97
45	600702	舍得酒业	1,348,657.00	2.96
46	002709	天赐材料	1,319,617.00	2.90
47	601318	中国平安	1,312,957.00	2.88
48	300795	米奥会展	1,267,137.00	2.78
49	688389	普门科技	1,243,310.84	2.73
50	688787	海天瑞声	1,242,401.41	2.73
51	300347	泰格医药	1,218,632.00	2.68
52	000799	酒鬼酒	1,216,163.00	2.67
53	300223	北京君正	1,212,255.00	2.66
54	600559	老白干酒	1,158,080.00	2.54
55	300624	万兴科技	1,144,446.00	2.51
56	688521	芯原股份	1,108,440.90	2.43
57	601636	旗滨集团	1,090,100.00	2.39
58	300718	长盛轴承	1,089,682.00	2.39
59	002292	奥飞娱乐	1,088,835.00	2.39
60	300229	拓尔思	1,081,860.00	2.38
61	600197	伊力特	1,067,380.00	2.34
62	601360	三六零	1,041,535.00	2.29
63	002384	东山精密	993,379.00	2.18
64	300476	胜宏科技	990,411.00	2.17
65	002531	天顺风能	981,505.00	2.15
66	300782	卓胜微	951,002.00	2.09
67	300679	电连技术	949,284.00	2.08

68	300827	上能电气	946,827.00	2.08
69	688373	盟科药业	942,455.00	2.07
70	000729	燕京啤酒	920,535.00	2.02
71	300811	铂科新材	918,821.00	2.02

注：本项“卖出金额”均按卖出成交金额（成交单价乘以数量）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

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	154,518,751.33
卖出股票的收入（成交）总额	154,786,354.89

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	675.11	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	675.11	0.00

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	128136	立讯转债	6	675.11	0.00

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

本基金合同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

本基金合同尚无国债期货投资政策。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货投资。

7.12 本报告期投资基金情况

7.12.1 投资政策及风险说明

本基金合同尚无投资基金的投资政策。

7.12.2 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

本基金本报告期末无基金投资。

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

"光线传媒的发行人"北京光线传媒股份有限公司"于

(1) 于 2022 年 9 月收到深圳证券交易所因为业绩预告披露的预计净利润与年度报告披露的经审计净利润相比，存在较大差异且盈亏性质发生变化。违反了《创业板股票上市规则（2020 年 12 月修

订)》第 1.4 条、第 5.1.1 条、第 6.2.1 条、第 6.2.5 条的规定, 给予通报批评的处分。

(2) 2023 年 1 月收到中国证券监督管理委员会北京监管局出具的《关于对北京光线传媒股份有限公司采取出具警示函行政监管措施的决定》((2023) 20 号), 公司业绩预告披露不准确, 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、第十七条、第二十二的规定, 根据《上市公司信息披露管理办法(证监会令第 182 号)》第五十二条的规定, 对该公司采取出具警示函的行政监管措施, 并计入资本市场诚信档案。”

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	34,487.43
2	应收清算款	570,349.07
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	13,061.19
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	617,897.69

7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位: 人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
----	------	------	------	--------------

1	128136	立讯转债	675.11	0.00
---	--------	------	--------	------

7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本报告期末本基金前十名股票不存在流通受限的情况。

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

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
3,942	8,556.69	0.00	0.00%	33,730,463.97	100.00%

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	48,231.14	0.14%

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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

注：本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有该只基金份额总量的数量区间为 0 份；该只基金的基金经理持有该只基金份额总量的数量区间为 0 份。

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015 年 12 月 21 日）基金份额总额	494,979,346.03
本报告期期初基金份额总额	33,531,808.80
本报告期基金总申购份额	5,687,986.12
减：本报告期基金总赎回份额	5,489,330.95
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	33,730,463.97

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。

本报告期末未有涉及基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期末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

本报告期内托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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	
恒泰证券	2	51,316,682.82	16.60%	37,528.42	15.85%	-
德邦证券	2	39,904,033.90	12.91%	29,181.76	12.33%	-
中泰证券	2	38,169,644.72	12.35%	27,914.00	11.79%	-
安信证券	1	36,198,382.37	11.71%	33,711.68	14.24%	-
天风证券	4	34,123,539.95	11.04%	24,954.76	10.54%	-
华安证券	2	27,880,672.64	9.02%	20,389.10	8.61%	-
财通证券	2	15,887,166.65	5.14%	11,618.66	4.91%	-
海通证券	1	14,555,549.53	4.71%	13,555.81	5.73%	-
国联证券	2	13,148,215.32	4.25%	9,615.39	4.06%	-
中金财富	3	12,094,728.64	3.91%	8,844.73	3.74%	-
方正证券	1	11,406,578.24	3.69%	8,341.61	3.52%	-
广发证券	3	9,820,980.65	3.18%	7,181.99	3.03%	-
国泰君安	1	2,685,242.60	0.87%	2,501.02	1.06%	-
中信证券	5	1,938,490.40	0.63%	1,417.58	0.60%	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
中山证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	2	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-

西部证券	2	-	-	-	-	-
开源证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
宏源证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	3	-	-	-	-	-

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 56 个交易席位，其中报告期内新增 0 个交易席位，退租 0 个交易席位。

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
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
中金财富	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
中山证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
宏源证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-

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
2	新华积极价值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
3	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
4	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
5	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
6	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
7	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
8	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
9	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
10	新华积极价值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
11	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
12	新华积极价值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
13	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
14	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
15	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
16	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
17	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
18	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

19	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积极价值灵活配置混合型证券投资基金募集的文件
- (二) 关于申请募集新华积极价值灵活配置混合型证券投资基金之法律意见书
- (三) 新华积极价值灵活配置混合型证券投资基金托管协议
- (四) 新华积极价值灵活配置混合型证券投资基金基金合同
- (五) 新华基金管理股份有限公司开放式基金业务规则
- (六) 《新华积极价值灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》（更新）
- (七) 《新华积极价值灵活配置混合型证券投资基金产品资料概要》（更新）
- (八) 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- (九) 基金托管人业务资格批件及营业执照
- (十) 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。

二〇二三年八月三十日