

华宝新飞跃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：华宝基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2023 年 8 月 31 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 08 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。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 01 月 01 日起至 2023 年 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	6
§ 4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
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	10
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内容的真实、准确和完整发表意见	13
§ 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	43
7.1 期末基金资产组合情况	43
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	44
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	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	50
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	51
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	52

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	52
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	52
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	52
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	52
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	52
7.12 投资组合报告附注	53
§ 8 基金份额持有人信息	54
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	54
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	54
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情况	54
§ 9 开放式基金份额变动	54
§ 10 重大事件揭示	55
10.1 基金份额持有人大会决议	55
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	55
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	55
10.4 基金投资策略的改变	55
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	55
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	55
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	55
10.8 其他重大事件	59
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	60
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	60
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	60
§ 12 备查文件目录	60
12.1 备查文件目录	60
12.2 存放地点	61
12.3 查阅方式	61

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华宝新飞跃灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	华宝新飞跃混合
基金主代码	004335
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017 年 2 月 27 日
基金管理人	华宝基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	110,741,036.91 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的前提下，本基金通过大类资产间的灵活配置和多样的投资策略，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金采取积极的大类资产配置策略，通过宏观策略研究，综合考虑宏观经济、国家财政政策、货币政策、产业政策以及市场流动性等方面的因素，对相关资产类别的预期收益进行动态跟踪，决定大类资产配置比例。 本基金采取积极的股票选择策略，将“自上而下”的行业配置策略和“自下而上”的股票精选策略相结合，根据对宏观经济、中观行业和市场风险特征变化的判断，进行投资组合的动态优化，实现基金资产长期稳定增值。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×50%+上证国债指数收益率×50%
风险收益特征	本基金是一只主动投资的混合型基金，其长期平均预期风险和预期收益率低于股票型基金，高于债券型基金、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	华宝基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	周雷
	联系电话	021-38505888
	电子邮箱	xxpl@fsfund.com
客户服务电话	400-700-5588、400-820-5050	021-60637228
传真	021-38505777	021-60635778
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码	200120	100033
法定代表人	黄孔威	田国立

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.fsfund.com
基金中期报告备置地点	基金管理人办公场所和基金托管人办公场所。

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	基金管理人	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼

§ 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-2023 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-2,200,532.87
本期利润	5,965,452.11
加权平均基金份额本期利润	0.0522
本期加权平均净值利润率	2.75%
本期基金份额净值增长率	2.76%
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	96,897,193.80
期末可供分配基金份额利润	0.8750
期末基金资产净值	210,788,443.00
期末基金份额净值	1.9034
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	90.34%

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润等于本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

3. 净值相关数据计算中涉及天数的，包括所有交易日以及季末最后一自然日（如非交易日）。

4. 期末可供分配利润采用资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

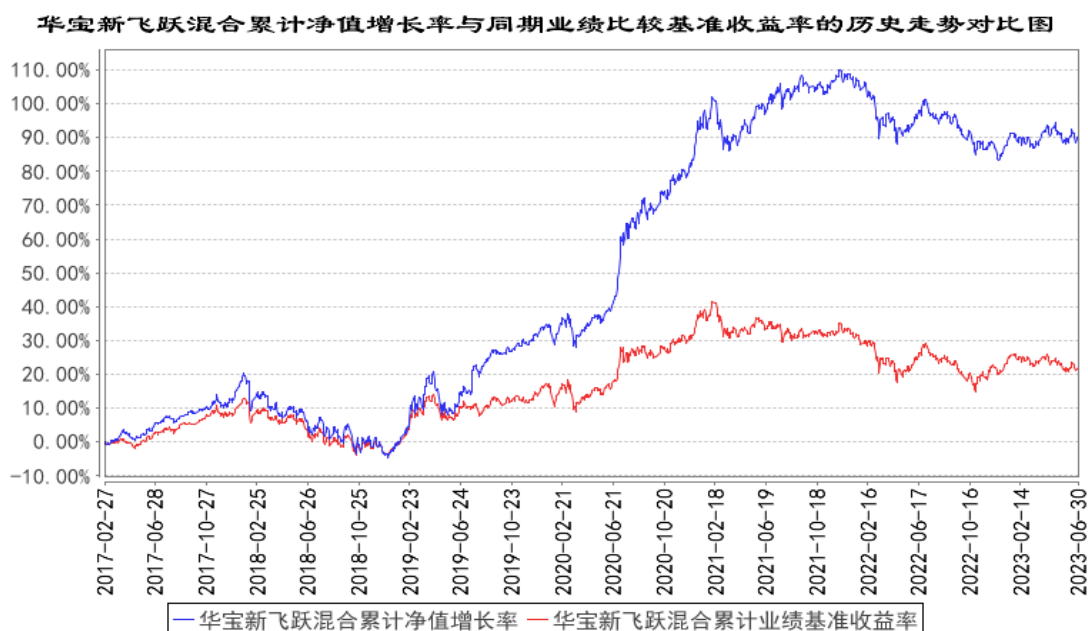
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	1.15%	0.41%	0.81%	0.43%	0.34%	-0.02%

过去三个月	0.49%	0.42%	-1.87%	0.41%	2.36%	0.01%
过去六个月	2.76%	0.40%	0.79%	0.42%	1.97%	-0.02%
过去一年	-5.36%	0.41%	-5.44%	0.49%	0.08%	-0.08%
过去三年	30.95%	0.60%	2.62%	0.60%	28.33%	0.00%
自基金合同生效起至今	90.34%	0.71%	21.82%	0.60%	68.52%	0.11%

注：（1）基金业绩基准：沪深 300 指数收益率×50%+上证国债指数收益率×50%；

（2）净值以及比较基准相关数据计算中涉及天数的，包括所有交易日以及季末最后一自然日（如非交易日）。

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



注：按照基金合同的约定，基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定，截至 2017 年 08 月 27 日，本基金已达到合同规定的资产配置比例。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

华宝基金管理有限公司（公司原名“华宝兴业基金管理有限公司”）于 2003 年 2 月 12 日经中国证监会批准设立，2003 年 3 月 7 日在国家工商总局注册登记并正式开业，是国内首批中外合资基金管理公司。成立之初，公司注册资本为 1 亿元人民币，2007 年经中国证监会批准，公司注册资本增加至 1.5 亿元人民币。2017 年公司名称变更为“华宝基金管理有限公司”。目前公司股东

为华宝信托有限责任公司、美国华平资产管理有限合伙（Warburg Pincus Asset Management, L.P.）和江苏省铁路集团有限公司，持有股权占比分别为 51%、29%、20%。公司在北京和深圳设有分公司，在香港设有子公司——华宝资产管理(香港)有限公司。截至本报告期末（2023 年 06 月 30 日），本公司正在管理运作的公开募集证券投资基金共 139 只。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李栋梁	本基金基金经理、混合资产部总经理	2017-02-27	-	20 年	硕士。曾在国联证券有限责任公司、华宝信托有限责任公司和太平资产管理有限公司从事固定收益的证券研究和投资管理工作。2010 年 10 月加入华宝基金管理有限公司，先后担任债券分析师、基金经理助理、固定收益部副总经理、混合资产部副总经理等职务，现任混合资产部总经理。2011 年 6 月起任华宝宝康债券投资基金基金经理，2014 年 10 月至 2023 年 3 月任华宝增强收益债券型证券投资基金基金经理，2015 年 10 月至 2017 年 12 月任华宝新价值灵活配置混合型证券投资基金、华宝新机遇灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) 基金经理，2016 年 4 月至 2019 年 6 月任华宝宝鑫纯债一年定期开放债券型证券投资基金基金经理，2016 年 6 月起任华宝可转债债券型证券投资基金基金经理，2016 年 9 月至 2017 年 12 月任华宝新活力灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2016 年 12 月至 2021 年 3 月任华宝新起点灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2017 年 1 月至 2018 年 6 月任华宝新动力一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2017 年 2 月起任华宝新飞跃灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2017 年 3 月至 2018 年 7 月任华宝新回报一年定期开放混合型证券投资基金基金经理，2017 年 3 月至 2018 年 8 月任华宝新优选一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2017 年 6 月至 2019 年 3 月任华宝新优享灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2021 年 4 月起任华宝双债增强债券型证券投资基金基金经理，2022

					年 5 月起任华宝安宜六个月持有期债券型证券投资基金基金经理，2022 年 11 月起任华宝安悦一年持有期混合型证券投资基金基金经理，2023 年 1 月起任华宝安融六个月持有期债券型证券投资基金基金经理。
唐雪倩	本基金的基金经理助理	2018-01-23	-	8 年	2015 年 7 月加入华宝基金管理有限公司，先后担任分析师、基金经理助理等职务。2018 年 1 月至 2018 年 6 月任华宝新动力一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理，2018 年 1 月至 2018 年 7 月任华宝新回报一年定期开放混合型证券投资基金基金经理助理，2018 年 1 月至 2018 年 8 月任华宝新优选一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理，2019 年 2 月至 2022 年 8 月起任华宝科技先锋混合型证券投资基金基金经理助理，2021 年 8 月至 2021 年 10 月任华宝安享混合型证券投资基金基金经理助理，2021 年 9 月至 2021 年 10 月任华宝安益混合型证券投资基金基金经理助理，2018 年 1 月至 2023 年 4 月任华宝量化对冲策略混合型发起式证券投资基金、华宝新机遇灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)、华宝沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金基金经理助理，2018 年 1 月起任华宝新价值灵活配置混合型证券投资基金、华宝新起点灵活配置混合型证券投资基金、华宝新飞跃灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理，2019 年 7 月起任华宝新活力灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理。2021 年 10 月至 2022 年 6 月任华宝安益混合型证券投资基金基金经理，2021 年 10 月起任华宝安享混合型证券投资基金基金经理，2022 年 6 月起任华宝红利精选混合型证券投资基金基金经理，2022 年 8 月起任华宝高端装备股票型发起式证券投资基金基金经理，2023 年 4 月起任华宝新机遇灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) 基金经理，2023 年 4 月起任华宝未来主导产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

注：1、任职日期以及离任日期均以基金公告为准。

2、证券从业含义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》

的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期内，本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《华宝新飞跃灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋取最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，基金管理人通过严格执行投资决策委员会议事规则、公司股票库管理制度、中央交易室制度、防火墙机制、系统中的公平交易程序、每日交易日结报告、定期基金投资绩效评价等机制，确保所管理的所有投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。同时，基金管理人严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定和公司内部制度要求，分析了本公司旗下所有投资组合之间的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异以及连续四个季度期间内、不同时间窗下同向交易的交易价差；分析结果未发现异常情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金管理人旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 1 次，均为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。

本报告期内，本基金没有发现异常交易行为。

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 年上半年我国国内生产总值突破 59 万亿元，上半年名义 GDP 同比增长 5.4%，实际 GDP 同比增长 5.5%，两年复合平均实际同比增速 4.0%，持平于全年 5% 增长目标所隐含的两年平均增速。今年各季度 GDP 实际同比增速分别为 4.5% 和 6.3%，对应的两年复合平均增速为 4.6% 和 3.3%，单季度环比增速分别为 2.2% 和 0.8%。全国规模以上工业增加值上半年累计同比增长 3.8%，较上年回升了 0.2 个百分点。上半年固定资产投资（不含农户）同比增长 3.8%，较上年回落 1.3 个百分点，其中房地产开发投资的拖累尚未见企稳。社会消费品零售总额上半年累计同比增长 8.2%，

消费持续恢复。外贸方面，上半年实现出口总值 1.66 万亿美元、进口总值 1.25 万亿美元，但累计同比增速为负；上半年出口累计同比增长-3.2%、进口-6.7%，实现贸易顺差 4087 亿美元。通胀方面，上半年 CPI 累计同比上涨 0.7%，较上年末回落 1.3 个百分点；PPI 累计同比-3.1%，涨幅较上年末回落 7.2 个百分点。半年末，社会融资规模存量为 365.5 万亿元，同比增长 9.3%，较上年末回落 0.3 个百分点；广义货币 M2 同比增速为 11.3%，较上年回落 0.5 个百分点。上半年流动性整体宽松、R001 和 R007 均值为 1.69%和 2.25%，2023 年二季度较一季度边际转松、但较 2022 年四季度 R001 和 R007 季度均值分别上行 18BP 和 12BP。货币政策方面，央行实施了一次降准和一次降息。今年上半年，市场呈现债强股弱的格局，沪深 300 指数-0.75%、创业板指-5.61%、中证转债指数 3.37%，中债总财富指数 2.55%。债券收益率先上后下、3 月份以来整体持续下行，国开债期限利差有所压缩，收益率曲线牛平；信用债表现强于利率债，信用利差显著压缩、高等级表现不及中低等级。

基金在上半年维持了股票的投资比例，且股票投资以稳健的品种为主，基金对可转债进行了交易，少量兑现了部分收益。纯债部分持有安全的信用债。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金份额净值增长率为 2.76%，业绩比较基准收益率为 0.79%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，正如 7 月政治局会议指出，疫情防控平稳转段后，经济恢复是一个波浪式发展、曲折式前进的过程。一大重要变化是，提及要切实防范化解重点领域风险，适应我国房地产市场供求关系发生重大变化的新形势，适时调整优化房地产政策，因城施策用好政策工具箱，更好满足居民刚性和改善性住房需求，促进房地产市场平稳健康发展。而 2023 年三季度作为下半年承上启下的关键时期，将是年内政策集中发力的重要时期，预计国内经济经历了二季度环比增速的低谷后将有所反弹。整体而言，债券市场大概率难以出现今年二季度时的持续有利环境，但考虑到经济复苏的进程难以一蹴而就，债券收益率面临的风险也相对有限。尤其需要密切跟踪，在政策维稳下房地产的边际变化。资金面波动预计有所加大，不同于今年二季度资金利率经常位于政策利率偏下轨的位置运行，后续预计资金利率将延续向政策利率收敛。通胀整体可控，对货币政策的制约较小；宽信用的推进需要政策的引导呵护，因此在经济弱修复的过程中，货币政策显著收紧的概率不大。股票市场经过了前期的调整以后，经济和政策的边际变化有利于提振投资者的信心，可转债的估值水平决定了转债交易的难度高于股票。

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。

本基金管理人设有估值委员会，定期评价现行估值政策和程序，在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况后及时修订估值方法。基金在投资新品种时，由估值委员会评价现有估值政策和程序的适用性。参与估值的人员均具备估值业务所需的专业胜任能力，参与估值各方之间不存在重大利益冲突。

本基金的估值由基金会计负责，基金会计以本基金为会计核算主体，基金会计核算独立于公司会计核算，独立建账、独立核算。基金会计采用专用的财务核算软件系统进行基金核算及账务处理；每日按时接收成交数据及权益数据，进行基金估值。基金会计核算采用基金管理人与托管银行双人同步独立核算、相互核对的方式进行；基金会计每日就基金的会计核算、基金估值等与托管银行进行核对，每日估值结果必须与托管行核对一致后才能对外公告。

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

本基金本报告期末进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人低于二百人或基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了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，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

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

本托管人复核审查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。

§ 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：华宝新飞跃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	4,820,625.86	5,804,789.39
结算备付金		3,821,198.29	3,450,707.04
存出保证金		2,910,531.95	2,534,686.96
交易性金融资产	6.4.7.2	195,815,731.08	208,542,105.88
其中：股票投资		122,065,647.10	111,120,873.57
基金投资		-	-
债券投资		73,750,083.98	97,421,232.31
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	4,028,812.82	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		138,391.99	79,813.36
应收股利		-	-
应收申购款		23,226.60	2,495.75
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		211,558,518.59	220,414,598.38
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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		313,756.78	-
应付赎回款		15,301.58	20,859.22
应付管理人报酬		105,413.02	122,502.43
应付托管费		26,353.23	30,625.60
应付销售服务费		43,922.09	51,042.65
应付投资顾问费		-	-
应交税费		4,010.17	3,705.96
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	261,318.72	519,583.41
负债合计		770,075.59	748,319.27
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	110,741,036.91	118,591,742.21
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	100,047,406.09	101,074,536.90
净资产合计		210,788,443.00	219,666,279.11
负债和净资产总计		211,558,518.59	220,414,598.38

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.9034 元，基金份额总额 110,741,036.91 份。

6.2 利润表

会计主体：华宝新飞跃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		7,147,044.16	-9,877,990.31
1. 利息收入		55,428.33	72,583.47
其中：存款利息收入	6.4.7.13	34,179.26	43,893.02
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		21,249.07	28,690.45
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-1,074,673.95	1,834,875.40
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-2,086,078.20	-8,108,167.45

基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-228,823.68	4,958,843.22
资产支持证券投资 收益	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-129,193.27	3,705,957.28
股利收益	6.4.7.19	1,369,421.20	1,278,242.35
以摊余成本计量的 金融资产终止确认产生的 收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	6.4.7.20	8,165,984.98	-11,787,675.81
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）	6.4.7.21	304.80	2,226.63
减：二、营业总支出		1,181,592.05	1,503,599.41
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	646,034.78	827,334.47
2. 托管费	6.4.10.2.2	161,508.68	206,833.62
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	269,181.16	344,722.75
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产 支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		1,829.87	16,743.42
8. 其他费用	6.4.7.23	103,037.56	107,965.15
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		5,965,452.11	-11,381,589.72
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）		5,965,452.11	-11,381,589.72
五、其他综合收益的税后 净额		-	-
六、综合收益总额		5,965,452.11	-11,381,589.72

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：华宝新飞跃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	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	118,591,742.21	-	101,074,536.90	219,666,279.11
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	118,591,742.21	-	101,074,536.90	219,666,279.11
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-7,850,705.30	-	-1,027,130.81	-8,877,836.11
(一)、综合收益总额	-	-	5,965,452.11	5,965,452.11
(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)	-7,850,705.30	-	-6,992,582.92	-14,843,288.22
其中：1. 基金申购款	2,316,351.56	-	2,081,332.57	4,397,684.13
2. 基金赎回款	-10,167,056.86	-	-9,073,915.49	-19,240,972.35
(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)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	110,741,036.91	-	100,047,406.09	210,788,443.00
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	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	123,521,681.11	-	134,557,118.45	258,078,799.56
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-

其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	123,521,681.11	-	134,557,118.45	258,078,799.56
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	15,115,845.01	-	5,640,942.90	20,756,787.91
(一)、综合收益总额	-	-	-11,381,589.72	-11,381,589.72
(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)	15,115,845.01	-	17,022,532.62	32,138,377.63
其中：1. 基金申购款	22,644,693.81	-	24,381,983.37	47,026,677.18
2. 基金赎回款	-7,528,848.80	-	-7,359,450.75	-14,888,299.55
(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)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	138,637,526.12	-	140,198,061.35	278,835,587.47

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：

<u>向辉</u>	<u>向辉</u>	<u>张幸骏</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华宝新飞跃灵活配置混合型证券投资基金（原名华宝兴业新飞跃灵活配置混合型证券投资基金，以下简称“本基金”）系由基金管理人华宝基金管理有限公司（原华宝兴业基金管理有限公司，已于 2017 年 10 月 17 日办理完成工商变更登记）依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《华宝

兴业新飞跃灵活配置混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）及其他有关法律法规的规定，经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）以证监许可[2016]2909 号文批准公开募集。本基金为契约型开放式基金，存续期限为不定期，首次设立募集基金份额为 300,097,996.34 份，经德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）验证，并出具了编号为德师报（验）字（17）第 00038 号的验资报告。基金合同于 2017 年 2 月 27 日正式生效。本基金的基金管理人为华宝基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《华宝基金管理有限公司关于旗下基金更名事宜的公告》，华宝兴业新飞跃灵活配置混合型证券投资基金于 2017 年 12 月 30 日起更名为华宝新飞跃灵活配置混合型证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、截至报告期末最新公告的基金合同及《华宝新飞跃灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板、存托凭证及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、资产支持证券、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、权证、股指期货以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。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。本基金的投资组合比例为：本基金投资于股票的比例为基金资产的 0-95%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金保留的现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；股指期货的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×50%+上证国债指数收益率×50%。

本财务报表由本基金的基金管理人华宝基金管理有限公司于 2023 年 8 月 29 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关

规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

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于 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

(1) 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3%调整为 1%；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

(2) 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《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》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金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。对证券投资基金在 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，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

（3）城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011 年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

（4）企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资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，股权的股息、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。

（5）个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题

的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《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》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，暂减按 25% 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；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《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》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

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	4,820,625.86
等于：本金	4,819,748.95
加：应计利息	876.91
减：坏账准备	—
定期存款	—
等于：本金	—
加：应计利息	—
减：坏账准备	—
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	—
减：坏账准备	—
合计	4,820,625.86

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	119,933,688.22	-	122,065,647.10	2,131,958.88	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	64,650,960.62	447,243.41	63,328,979.87	-1,769,224.16
	银行间市场	10,333,337.53	298,104.11	10,421,104.11	-210,337.53
	合计	74,984,298.15	745,347.52	73,750,083.98	-1,979,561.69
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	194,917,986.37	745,347.52	195,815,731.08	152,397.19	

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-24,512,373.75	-	-	-
其中：股指期货投资	-24,512,373.75	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-24,512,373.75	-	-	-

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IF2307	IF2307	-15.00	-17,236,800.00	163,293.75
IF2309	IF2309	-6.00	-6,910,200.00	202,080.00

合计				365,373.75
减：可抵销期货 暂收款				365,373.75
净额				0.00

注：（1）买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

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

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	4,028,812.82	-
银行间市场	-	-
合计	4,028,812.82	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 债权投资

无。

6.4.7.6 其他债权投资

无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

无。

6.4.7.8 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.9 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	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	177,016.16

其中：交易所市场	177,016.16
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	84,302.56
合计	261,318.72

6.4.7.10 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	118,591,742.21	118,591,742.21
本期申购	2,316,351.56	2,316,351.56
本期赎回（以“-”号填列）	-10,167,056.86	-10,167,056.86
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	110,741,036.91	110,741,036.91

注：申购含红利再投以及转换入份(金)额，赎回含转换出份(金)额。

6.4.7.11 其他综合收益

无。

6.4.7.12 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	106,048,709.51	-4,974,172.61	101,074,536.90
本期利润	-2,200,532.87	8,165,984.98	5,965,452.11
本期基金份额交易产生的变动数	-6,950,982.84	-41,600.08	-6,992,582.92
其中：基金申购款	2,031,400.43	49,932.14	2,081,332.57
基金赎回款	-8,982,383.27	-91,532.22	-9,073,915.49
本期已分配利润	-	-	-
本期末	96,897,193.80	3,150,212.29	100,047,406.09

6.4.7.13 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
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	24,515.86
其他	104.47

合计	34,179.26
----	-----------

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
卖出股票成交总额	52,771,718.73
减：卖出股票成本总额	54,696,156.32
减：交易费用	161,640.61
买卖股票差价收入	-2,086,078.20

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 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	692,703.65
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-921,527.33
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	-228,823.68

6.4.7.15.2 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	43,893,340.34
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	43,929,099.47
减：应计利息总额	884,602.79
减：交易费用	1,165.41
买卖债券差价收入	-921,527.33

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.17 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	-129,193.27

6.4.7.19 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	1,369,421.20
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	1,369,421.20

6.4.7.20 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	7,762,111.23
股票投资	5,763,411.89
债券投资	1,998,699.34
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	403,873.75
权证投资	-
期货投资	403,873.75
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	8,165,984.98

6.4.7.21 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	304.80
合计	304.80

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

6.4.7.22 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.23 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	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	135.00
账户维护费	18,000.00
上清所 CFCA 证书服务费	600.00
合计	103,037.56

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，本基金并无需要披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华宝基金管理有限公司(“华宝基金”)	基金管理人, 注册登记机构, 基金销售机构
中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	基金托管人
华宝信托有限责任公司(“华宝信托”)	基金管理人的股东
华平资产管理有限合伙(Warburg Pincus Asset Management. L.P.)	基金管理人的股东
江苏省铁路集团有限公司(“江苏铁集”)	基金管理人的股东
中国宝武钢铁集团有限公司(“宝武集团”)	华宝信托的最终控制人
华宝证券股份有限公司(“华宝证券”)	受宝武集团控制的公司
华宝投资有限公司(“华宝投资”)	受宝武集团控制的公司
宝武集团财务有限责任公司(“宝武财务”)	受宝武集团控制的公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行交易。

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	646,034.78	827,334.47
其中：支付销售机构的客户维护费	7,185.06	11,208.01

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.60% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.60\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值。

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	161,508.68	206,833.62

注：基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.15% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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
	华宝新飞跃混合
华宝基金	261,218.64
合计	261,218.64
获得销售服务费的各关联方	上年度可比期间

名称	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	
	华宝新飞跃混合	
华宝基金	332,362.89	
合计	332,362.89	

注：销售服务费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

其计算公式为：日销售服务费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间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 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无转融通证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例 (%)	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例 (%)
华宝投资有限 公司	104,603,500.00	94.46	104,603,500.00	88.20

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 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
中国建设银行	4,820,625.86	9,558.93	1,221,128.46	12,183.61

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

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
001282	三联锻造	2023 年 5 月 15 日	6 个月	新股锁定	27.93	33.03	71	1,983.03	2,345.13	-
001286	陕西能源	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股锁定	9.60	9.41	3,767	36,163.20	35,447.47	-
001287	中电港	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股锁定	11.88	21.02	305	3,623.40	6,411.10	-
001324	长青科技	2023 年 5 月 12 日	6 个月	新股锁定	18.88	19.60	93	1,755.84	1,822.80	-
001328	登康口腔	2023 年 3 月 29 日	6 个月	新股锁定	20.68	25.49	90	1,861.20	2,294.10	-
001360	南矿集团	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股锁定	15.38	14.87	125	1,922.50	1,858.75	-
001367	海森药业	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股锁定	44.48	39.48	45	2,001.60	1,776.60	-
001380	华纬科技	2023 年 5 月 9 日	6 个月	新股锁定	28.84	30.78	119	3,431.96	3,662.82	-
300804	广康生化	2023 年 6 月 15 日	6 个月	新股锁定	42.45	32.97	169	7,174.05	5,571.93	-
301141	中科磁业	2023 年 3 月 27 日	6 个月	新股锁定	41.20	42.69	174	7,168.80	7,428.06	-
301170	锡南科技	2023 年 6 月 16 日	6 个月	新股锁定	34.00	34.93	147	4,998.00	5,134.71	-
301202	朗威股	2023 年	6 个月	新股锁	25.82	25.82	192	4,957.44	4,957.44	-

	份	6月28日		定							
301202	朗威股份	2023年6月28日	1个月内(含)	新股流通受限	25.82	25.82	1,724	44,513.68	44,513.68		-
301203	国泰环保	2023年3月28日	6个月	新股锁定	46.13	34.40	146	6,734.98	5,022.40		-
301210	金杨股份	2023年6月21日	6个月	新股锁定	57.88	49.17	145	8,392.60	7,129.65		-
301225	恒勃股份	2023年6月8日	6个月	新股锁定	35.66	33.26	222	7,916.52	7,383.72		-
301232	飞沃科技	2023年6月8日	6个月	新股锁定	72.50	58.42	103	7,467.50	6,017.26		-
301261	恒工精密	2023年6月29日	1个月内(含)	新股流通受限	36.90	36.90	1,166	43,025.40	43,025.40		-
301261	恒工精密	2023年6月29日	6个月	新股锁定	36.90	36.90	130	4,797.00	4,797.00		-
301262	海看股份	2023年6月13日	6个月	新股锁定	30.22	25.50	286	8,642.92	7,293.00		-
301281	科源制药	2023年3月28日	6个月	新股锁定	44.18	25.10	147	6,494.46	3,689.70		-
301281	科源制药	2023年5月26日	4个月	新股锁定-送股	-	25.10	59	-	1,480.90		-
301291	明阳电气	2023年6月21日	6个月	新股锁定	38.13	31.03	255	9,723.15	7,912.65		-
301292	海科新源	2023年6月29日	1个月内(含)	新股流通受限	19.99	19.99	3,284	65,647.16	65,647.16		-
301292	海科新源	2023年6月29日	6个月	新股锁定	19.99	19.99	365	7,296.35	7,296.35		-
301305	朗坤环境	2023年5月15日	6个月	新股锁定	25.25	19.69	293	7,398.25	5,769.17		-
301307	美利信	2023年4月14日	6个月	新股锁定	32.34	31.86	280	9,055.20	8,920.80		-

		日									
301310	鑫宏业	2023年 5月26 日	6个月	新股锁 定	67.28	65.43	173	11,639.44	11,319.39		-
301315	威士顿	2023年 6月13 日	6个月	新股锁 定	32.29	51.12	179	5,779.91	9,150.48		-
301320	豪江智 能	2023年 6月1日	6个月	新股锁 定	13.06	20.62	634	8,280.04	13,073.08		-
301323	新莱福	2023年 5月29 日	6个月	新股锁 定	39.06	39.36	126	4,921.56	4,959.36		-
301325	曼恩斯 特	2023年 5月4日	6个月	新股锁 定	76.80	107.95	109	8,371.20	11,766.55		-
301332	德尔玛	2023年 5月9日	6个月	新股锁 定	14.81	13.73	459	6,797.79	6,302.07		-
301355	南王科 技	2023年 6月2日	6个月	新股锁 定	17.55	16.75	375	6,581.25	6,281.25		-
301357	北方长 龙	2023年 4月11 日	6个月	新股锁 定	50.00	48.39	118	5,900.00	5,710.02		-
301360	荣旗科 技	2023年 4月17 日	6个月	新股锁 定	71.88	92.60	84	6,037.92	7,778.40		-
301376	致欧科 技	2023年 6月14 日	6个月	新股锁 定	24.66	22.51	262	6,460.92	5,897.62		-
301382	蜂助手	2023年 5月9日	6个月	新股锁 定	23.80	32.84	229	5,450.20	7,520.36		-
301383	天键股 份	2023年 5月31 日	6个月	新股锁 定	46.16	35.72	209	9,647.44	7,465.48		-
301386	未来电 器	2023年 3月21 日	6个月	新股锁 定	29.99	23.79	217	6,507.83	5,162.43		-
301387	光大同 创	2023年 4月10 日	6个月	新股锁 定	58.32	45.36	165	9,622.80	7,484.40		-
301395	仁信新 材	2023年 6月21 日	6个月	新股锁 定	26.68	26.68	304	8,110.72	8,110.72		-
301395	仁信新 材	2023年 6月21 日	1个月 内(含)	新股流 通受限	26.68	26.68	2,727	72,756.36	72,756.36		-

301397	溯联股份	2023年6月15日	6个月	新股锁定	53.27	40.20	144	7,670.88	5,788.80	-
301429	森泰股份	2023年4月10日	6个月	新股锁定	28.75	21.02	339	9,746.25	7,125.78	-
301486	致尚科技	2023年6月30日	1个月内(含)	新股流通受限	57.66	57.66	1,301	75,015.66	75,015.66	-
301486	致尚科技	2023年6月30日	6个月	新股锁定	57.66	57.66	145	8,360.70	8,360.70	-
601061	中信金属	2023年3月30日	6个月	新股锁定	6.58	7.58	689	4,533.62	5,222.62	-
601065	江盐集团	2023年3月31日	6个月	新股锁定	10.36	11.84	241	2,496.76	2,853.44	-
601133	柏诚股份	2023年3月31日	6个月	新股锁定	11.66	12.26	210	2,448.60	2,574.60	-
603125	常青科技	2023年3月30日	6个月	新股锁定	25.98	24.53	73	1,896.54	1,790.69	-
603135	中重科技	2023年3月29日	6个月	新股锁定	17.80	17.89	226	4,022.80	4,043.14	-
603137	恒尚节能	2023年4月10日	6个月	新股锁定	15.90	17.09	139	2,210.10	2,375.51	-
603172	万丰股份	2023年4月28日	6个月	新股锁定	14.58	16.13	122	1,778.76	1,967.86	-
688146	XD中船特	2023年4月13日	6个月	新股锁定	36.15	38.13	203	7,338.45	7,740.39	-
688334	西高院	2023年6月9日	6个月	新股锁定	14.16	16.21	463	6,556.08	7,505.23	-
688352	硕中科技	2023年4月11日	6个月	新股锁定	12.10	12.07	642	7,768.20	7,748.94	-
688361	中科飞测	2023年5月12日	6个月	新股锁定	23.60	64.67	213	5,026.80	13,774.71	-

688429	时创能源	2023年 6月20日	6个月	新股锁定	19.20	25.53	230	4,416.00	5,871.90	-
688433	华曙高科	2023年 4月7日	6个月	新股锁定	26.66	31.50	173	4,612.18	5,449.50	-
688443	智翔金泰	2023年 6月13日	6个月	新股锁定	37.88	29.49	382	14,470.16	11,265.18	-
688469	中芯集成	2023年 4月28日	6个月	新股锁定	5.69	5.41	2,402	13,667.38	12,994.82	-
688472	阿特斯	2023年 6月2日	6个月	新股锁定	11.10	17.04	828	9,190.80	14,109.12	-
688478	晶升股份	2023年 4月13日	6个月	新股锁定	32.52	42.37	249	8,097.48	10,550.13	-
688479	友车科技	2023年 5月4日	6个月	新股锁定	33.99	29.49	141	4,792.59	4,158.09	-
688484	南芯科技	2023年 3月28日	6个月	新股锁定	39.99	36.71	206	8,237.94	7,562.26	-
688512	慧智微	2023年 5月8日	6个月	新股锁定	20.92	19.16	292	6,108.64	5,594.72	-
688523	航天环宇	2023年 5月26日	6个月	新股锁定	21.86	23.85	297	6,492.42	7,083.45	-
688531	日联科技	2023年 3月24日	6个月	新股锁定	152.38	135.97	70	10,666.60	9,517.90	-
688535	华海诚科	2023年 3月28日	6个月	新股锁定	35.00	51.23	121	4,235.00	6,198.83	-
688543	国科军工	2023年 6月14日	6个月	新股锁定	43.67	53.05	154	6,725.18	8,169.70	-
688552	XD 航天南	2023年 5月8日	6个月	新股锁定	21.17	23.50	291	6,160.47	6,838.50	-
688562	航天软件	2023年 5月15日	6个月	新股锁定	12.68	22.31	395	5,008.60	8,812.45	-
688570	天玛智控	2023年 5月29日	6个月	新股锁定	30.26	25.33	231	6,990.06	5,851.23	-
688581	安杰思	2023年	6个月	新股锁	125.80	118.03	50	6,290.00	5,901.50	-

		5月12日		定							
688582	芯动联科	2023年6月21日	6个月	新股锁定	26.74	40.68	236	6,310.64	9,600.48		-
688593	新相微	2023年5月25日	6个月	新股锁定	11.18	14.59	486	5,433.48	7,090.74		-
688603	天承科技	2023年6月30日	1个月内(含)	新股流通受限	55.00	55.00	970	53,350.00	53,350.00		-
688603	天承科技	2023年6月30日	6个月	新股锁定	55.00	55.00	108	5,940.00	5,940.00		-
688620	安凯微	2023年6月15日	6个月	新股锁定	10.68	12.34	645	6,888.60	7,959.30		-
688623	双元科技	2023年5月31日	6个月	新股锁定	125.88	86.79	56	7,049.28	4,860.24		-
688629	华丰科技	2023年6月16日	6个月	新股锁定	9.26	18.59	614	5,685.64	11,414.26		-
688631	莱斯信息	2023年6月19日	6个月	新股锁定	25.28	29.87	168	4,247.04	5,018.16		-

注：1. 根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

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

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

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购，因此没有在银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购，因此没有在交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

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

本基金是一只主动投资的混合型证券投资基金，其长期平均预期风险和预期收益率低于股票型基金，高于债券型基金、货币市场基金。本基金投资的金融工具主要包括股票、债券等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，公司内部监督和反馈系统包括内部控制委员会、督察长、合规审计部、风险管理部、各部门负责人和风险控制联络人、各业务岗位。内部控制委员会负责对公司在经营管理和基金运作中的风险进行评估并研究制订相应的控制制度。督察长向董事会负责，总管公司的内控事务并独立地就内控制度的执行情况履行检查、评价、报告和建议职能。风险管理部在督察长指导下对公司内部控制运行情况进行监控，主要针对公司内部控制制度的总体构架和内部控制的目标进行评估并提出改进意见；合规审计部在督察长的领导下对各部门和岗位的内部控制执行情况进行监督和核查，同时对内控的失控点进行查漏并责令改正。

本基金的基金管理人根据自身经营特点设立顺序递进、权责统一、严密有效的四层监控防线。第一层监控防线为一线岗位自控与互控；第二层防线为大业务板块内部各部门和部门之间的自控和互控；第三层监控防线为风险管理部和合规审计部对各岗位、各部门、各项业务全面实施的监督反馈；最后是以内部控制委员会为主体的第四层防线，实施对公司各类业务和风险的总体监督、控制，并对风险管理部和合规审计部的工作予以直接指导。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法是通过结合定性分析和定量分析方法，估

测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具的特征，通过特定的风险量化指标、模型、日常的量化报告，确定相应置信程度和风险损失的限度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

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、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，因此违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	11,604,959.51	2,517,140.41
合计	11,604,959.51	2,517,140.41

注：债券信用评级取自第三方评级机构的债项评级。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级列示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

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

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	上年度末 2022年12月31日
--------	-------------------	---------------------

AAA	42,835,571.41	65,727,752.74
AAA 以下	19,309,553.06	19,045,278.89
未评级	-	10,131,060.27
合计	62,145,124.47	94,904,091.90

注：债券信用评级取自第三方评级机构的债项评级。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示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

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。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或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于本报告期末，除附注中列示的卖出回购金融资产款将在一个月以内到期且计息（该利息金额不重大）外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，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严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（自 2017 年 10 月 1 日起施行）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的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%，本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公

司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持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，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

本报告期内，基金管理人坚持组合管理、分散投资的基本原则，严格按照法律法规的有关规定和基金合同约定的投资范围与比例限制实施投资管理。本基金所持大部分证券在证券交易所上市或银行间同业市场交易，不存在具有重大流动性风险的投资品种。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度，按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

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

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担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。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金、债券投资及买入返售金融资产等。

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	4,820,625.86	-	-	-	4,820,625.86
结算备付金	3,821,198.29	-	-	-	3,821,198.29
存出保证金	12,891.95	-	-	2,897,640.00	2,910,531.95
交易性金融资产	22,335,276.83	51,414,807.15	-	122,065,647.10	195,815,731.08
买入返售金融资产	4,028,812.82	-	-	-	4,028,812.82
应收申购款	-	-	-	23,226.60	23,226.60
应收清算款	-	-	-	138,391.99	138,391.99
资产总计	35,018,805.75	51,414,807.15	-	125,124,905.69	211,558,518.59
负债					
应付赎回款	-	-	-	15,301.58	15,301.58
应付管理人报酬	-	-	-	105,413.02	105,413.02
应付托管费	-	-	-	26,353.23	26,353.23
应付清算款	-	-	-	313,756.78	313,756.78
应付销售服务费	-	-	-	43,922.09	43,922.09
应交税费	-	-	-	4,010.17	4,010.17
其他负债	-	-	-	261,318.72	261,318.72
负债总计	-	-	-	770,075.59	770,075.59
利率敏感度缺口	35,018,805.75	51,414,807.15	-	-124,354,830.10	210,788,443.00
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	5,804,789.39	-	-	-	5,804,789.39
结算备付金	3,450,707.04	-	-	-	3,450,707.04
存出保证金	8,041.36	-	-	2,526,645.60	2,534,686.96
交易性金融资产	43,874,837.02	52,519,296.11	1,027,099.18	111,120,873.57	208,542,105.88
应收申购款	-	-	-	2,495.75	2,495.75
应收清算款	-	-	-	79,813.36	79,813.36
资产总计	53,138,374.81	52,519,296.11	1,027,099.18	113,729,828.28	220,414,598.38
负债					
应付赎回款	-	-	-	20,859.22	20,859.22
应付管理人报酬	-	-	-	122,502.43	122,502.43
应付托管费	-	-	-	30,625.60	30,625.60
应付销售服务费	-	-	-	51,042.65	51,042.65
应交税费	-	-	-	3,705.96	3,705.96
其他负债	-	-	-	519,583.41	519,583.41

负债总计	-	-	-	748,319.27	748,319.27
利率敏感度缺口	53,138,374.81	52,519,296.11	1,027,099.18	112,981,509.01	219,666,279.11

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023年6月30日）	上年度末（2022年12月31日）
	1. 市场利率上升 25 个基点	-23,033.87	-48,776.17
2. 市场利率下降 25 个基点	23,054.68	48,897.18	

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险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，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下和自下而上相结合”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及投资组合构建的策略；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于股票的比例为基金资产的 0-95%，每个交易日日终在扣除股指期货 期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括

VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 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	122,065,647.10	57.91	111,120,873.57	50.59
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	122,065,647.10	57.91	111,120,873.57	50.59

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023年6月30日）	上年度末（2022年12月31日）
	1. 业绩比较基准上升 5%	8,122,020.01	8,400,027.88
2. 业绩比较基准下降 5%	-8,122,020.01	-8,400,027.88	

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	上年度末 2022年12月31日
第一层次	172,590,056.00	157,072,622.95
第二层次	22,729,047.30	51,046,586.50
第三层次	496,627.78	422,896.43
合计	195,815,731.08	208,542,105.88

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的证券等，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别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不将相关证券等的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关证券公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本报告期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(上年度末：同)。

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	122,065,647.10	57.70
	其中：股票	122,065,647.10	57.70
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	73,750,083.98	34.86
	其中：债券	73,750,083.98	34.86
	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	4,028,812.82	1.90
	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	8,641,824.15	4.08
8	其他各项资产	3,072,150.54	1.45
9	合计	211,558,518.59	100.00

注：本基金本报告期末“固定收益投资”、“买入返售金融资产”、“银行存款和结算备付金合计”等项目的列报金额已包含对应的“应计利息”和“减值准备”（若有），“其他资产”中的“应收利息”指本基金截至本报告期末已过付息期但尚未收到的利息金额（下同）。

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

金额单位：人民币元

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	1,678,685.00	0.80
B	采矿业	8,103,137.48	3.84
C	制造业	65,950,008.26	31.29
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,697,859.47	1.75
E	建筑业	3,737,797.11	1.77
F	批发和零售业	1,447,888.44	0.69
G	交通运输、仓储和邮政业	4,178,444.60	1.98
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,038,761.34	2.86
J	金融业	23,300,852.60	11.05
K	房地产业	2,445,731.00	1.16
L	租赁和商务服务业	426,306.00	0.20
M	科学研究和技术服务业	686,684.23	0.33
N	水利、环境和公共设施管理业	10,791.57	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	362,700.00	0.17
S	综合	-	-
	合计	122,065,647.10	57.91

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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	4,900	8,285,900.00	3.93
2	300750	宁德时代	20,320	4,649,012.80	2.21
3	601328	交通银行	501,400	2,908,120.00	1.38
4	601988	中国银行	612,900	2,396,439.00	1.14
5	000333	美的集团	39,001	2,297,938.92	1.09
6	600028	中国石化	323,500	2,057,460.00	0.98
7	000568	泸州老窖	9,500	1,990,915.00	0.94
8	002594	比亚迪	7,400	1,911,198.00	0.91
9	001965	招商公路	198,366	1,904,313.60	0.90
10	601318	中国平安	40,900	1,897,760.00	0.90
11	000776	广发证券	128,900	1,896,119.00	0.90
12	001979	招商蛇口	143,600	1,871,108.00	0.89
13	002230	科大讯飞	25,500	1,732,980.00	0.82
14	000063	中兴通讯	37,400	1,703,196.00	0.81
15	000651	格力电器	45,100	1,646,601.00	0.78
16	300316	晶盛机电	22,400	1,588,160.00	0.75
17	601211	国泰君安	113,300	1,585,067.00	0.75
18	601319	中国人保	270,800	1,581,472.00	0.75
19	600900	长江电力	71,000	1,566,260.00	0.74
20	601668	中国建筑	270,900	1,554,966.00	0.74
21	600938	中国海油	84,404	1,529,400.48	0.73
22	002371	北方华创	4,700	1,492,955.00	0.71
23	300274	阳光电源	12,700	1,481,201.00	0.70
24	002475	立讯精密	45,299	1,469,952.55	0.70
25	601186	中国铁建	145,700	1,435,145.00	0.68
26	601288	农业银行	404,400	1,427,532.00	0.68
27	600085	同仁堂	23,700	1,364,172.00	0.65
28	600919	江苏银行	181,200	1,331,820.00	0.63
29	002142	宁波银行	50,500	1,277,650.00	0.61
30	688981	中芯国际	23,700	1,197,324.00	0.57
31	601899	紫金矿业	105,300	1,197,261.00	0.57
32	688111	金山办公	2,500	1,180,550.00	0.56
33	002415	海康威视	34,200	1,132,362.00	0.54
34	000807	云铝股份	88,600	1,127,878.00	0.54
35	002714	牧原股份	26,200	1,104,330.00	0.52
36	000425	徐工机械	162,600	1,100,802.00	0.52
37	300059	东方财富	76,168	1,081,585.60	0.51
38	600309	万华化学	12,200	1,071,648.00	0.51
39	601398	工商银行	215,800	1,040,156.00	0.49
40	000596	古井贡酒	4,200	1,038,996.00	0.49

41	601628	中国人寿	29,400	1,027,824.00	0.49
42	002459	晶澳科技	23,484	979,282.80	0.46
43	601857	中国石油	130,500	974,835.00	0.46
44	600941	中国移动	9,600	895,680.00	0.42
45	000963	华东医药	20,200	876,074.00	0.42
46	002179	中航光电	19,072	864,915.20	0.41
47	600276	恒瑞医药	17,900	857,410.00	0.41
48	600036	招商银行	24,500	802,620.00	0.38
49	300124	汇川技术	12,000	770,520.00	0.37
50	600426	华鲁恒升	23,700	725,931.00	0.34
51	600600	青岛啤酒	7,000	725,410.00	0.34
52	002129	TCL 中环	21,375	709,650.00	0.34
53	603259	药明康德	10,900	679,179.00	0.32
54	688012	中微公司	4,300	672,735.00	0.32
55	601225	陕西煤业	36,300	660,297.00	0.31
56	300693	盛弘股份	17,780	656,437.60	0.31
57	600011	华能国际	69,900	647,274.00	0.31
58	000975	银泰黄金	54,600	638,820.00	0.30
59	002384	东山精密	24,300	629,370.00	0.30
60	601012	隆基绿能	21,580	618,698.60	0.29
61	600027	华电国际	92,200	616,818.00	0.29
62	002821	凯莱英	5,180	610,514.80	0.29
63	601658	邮储银行	122,900	600,981.00	0.29
64	300760	迈瑞医疗	2,000	599,600.00	0.28
65	601088	中国神华	19,400	596,550.00	0.28
66	603986	兆易创新	5,600	595,000.00	0.28
67	002422	科伦药业	19,800	587,664.00	0.28
68	002410	广联达	18,080	587,419.20	0.28
69	601006	大秦铁路	77,600	576,568.00	0.27
70	600048	保利发展	44,100	574,623.00	0.27
71	300498	温氏股份	31,300	574,355.00	0.27
72	300770	新媒股份	12,200	559,492.00	0.27
73	000538	云南白药	10,640	558,387.20	0.26
74	000028	国药一致	12,710	554,283.10	0.26
75	000858	五粮液	3,300	539,781.00	0.26
76	600089	特变电工	23,800	530,502.00	0.25
77	601390	中国中铁	69,200	524,536.00	0.25
78	002540	亚太科技	89,400	516,732.00	0.25
79	600958	东方证券	53,200	516,040.00	0.24
80	600000	浦发银行	71,000	514,040.00	0.24
81	000725	京东方 A	125,300	512,477.00	0.24
82	600030	中信证券	25,800	510,324.00	0.24
83	688009	中国通号	87,200	505,760.00	0.24

84	688036	传音控股	3,400	499,800.00	0.24
85	000977	浪潮信息	10,200	494,700.00	0.23
86	601000	唐山港	135,800	479,374.00	0.23
87	002304	洋河股份	3,600	472,860.00	0.22
88	000937	冀中能源	70,300	448,514.00	0.21
89	000895	双汇发展	17,700	433,473.00	0.21
90	000932	华菱钢铁	90,400	431,208.00	0.20
91	002027	分众传媒	62,600	426,306.00	0.20
92	600438	通威股份	12,300	422,013.00	0.20
93	000338	潍柴动力	33,800	421,148.00	0.20
94	000738	航发控制	17,200	419,680.00	0.20
95	002049	紫光国微	4,420	412,165.00	0.20
96	600570	恒生电子	9,200	407,468.00	0.19
97	000625	长安汽车	31,400	406,002.00	0.19
98	600933	爱柯迪	17,200	400,588.00	0.19
99	000938	紫光股份	12,100	385,385.00	0.18
100	002966	苏州银行	58,300	381,865.00	0.18
101	000559	万向钱潮	69,800	380,410.00	0.18
102	000100	TCL 科技	94,850	373,709.00	0.18
103	000719	中原传媒	31,000	362,700.00	0.17
104	300054	鼎龙股份	14,100	348,693.00	0.17
105	002372	伟星新材	16,900	347,126.00	0.16
106	603659	璞泰来	8,900	340,158.00	0.16
107	600548	深高速	37,400	335,852.00	0.16
108	002709	天赐材料	8,100	333,639.00	0.16
109	601816	京沪高铁	62,000	326,120.00	0.15
110	002271	东方雨虹	11,800	321,668.00	0.15
111	603019	中科曙光	6,300	320,670.00	0.15
112	002050	三花智控	10,300	311,678.00	0.15
113	600750	江中药业	14,200	311,406.00	0.15
114	600760	中航沈飞	6,820	306,900.00	0.15
115	000001	平安银行	27,100	304,333.00	0.14
116	002555	三七互娱	8,600	299,968.00	0.14
117	002154	报喜鸟	52,500	289,800.00	0.14
118	002563	森马服饰	46,500	289,230.00	0.14
119	600436	片仔癀	1,000	286,360.00	0.14
120	000933	神火股份	21,800	283,400.00	0.13
121	600479	千金药业	23,900	269,592.00	0.13
122	000830	鲁西化工	25,500	269,280.00	0.13
123	002600	领益智造	36,400	251,524.00	0.12
124	301168	通灵股份	4,000	249,200.00	0.12
125	601600	中国铝业	45,200	248,148.00	0.12
126	600104	上汽集团	17,400	246,558.00	0.12

127	601966	玲珑轮胎	10,900	242,198.00	0.11
128	600886	国投电力	18,700	236,555.00	0.11
129	300450	先导智能	6,500	235,105.00	0.11
130	002531	天顺风能	15,200	231,496.00	0.11
131	000429	粤高速 A	29,300	229,712.00	0.11
132	000157	中联重科	33,500	226,125.00	0.11
133	000999	华润三九	3,700	224,442.00	0.11
134	600660	福耀玻璃	6,200	222,270.00	0.11
135	600015	华夏银行	40,500	219,105.00	0.10
136	601800	中国交建	20,000	218,200.00	0.10
137	002126	银轮股份	12,200	215,940.00	0.10
138	002139	拓邦股份	16,400	214,020.00	0.10
139	600674	川投能源	14,200	213,710.00	0.10
140	600350	山东高速	32,500	207,025.00	0.10
141	600025	华能水电	27,900	198,927.00	0.09
142	600887	伊利股份	7,000	198,240.00	0.09
143	002601	龙佰集团	11,300	186,450.00	0.09
144	003816	中国广核	58,800	182,868.00	0.09
145	600536	中国软件	3,770	176,737.60	0.08
146	002891	中宠股份	6,900	166,566.00	0.08
147	600031	三一重工	10,000	166,300.00	0.08
148	601728	中国电信	27,800	156,514.00	0.07
149	002007	华兰生物	6,800	152,388.00	0.07
150	000786	北新建材	6,200	151,962.00	0.07
151	600584	长电科技	4,100	127,797.00	0.06
152	601111	中国国航	14,500	119,480.00	0.06
153	000708	中信特钢	7,300	115,632.00	0.05
154	000789	万年青	14,900	115,475.00	0.05
155	002460	赣锋锂业	1,480	90,220.80	0.04
156	301486	致尚科技	1,446	83,376.36	0.04
157	301395	仁信新材	3,031	80,867.08	0.04
158	301292	海科能源	3,649	72,943.51	0.03
159	688603	天承科技	1,078	59,290.00	0.03
160	301202	朗威股份	1,916	49,471.12	0.02
161	301261	恒工精密	1,296	47,822.40	0.02
162	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.02
163	688472	阿特斯	828	14,109.12	0.01
164	688361	中科飞测	213	13,774.71	0.01
165	301320	豪江智能	634	13,073.08	0.01
166	688469	中芯集成	2,402	12,994.82	0.01
167	301325	曼恩斯特	109	11,766.55	0.01
168	688629	华丰科技	614	11,414.26	0.01
169	301310	鑫宏业	173	11,319.39	0.01

170	688443	智翔金泰	382	11,265.18	0.01
171	688478	晶升股份	249	10,550.13	0.01
172	688582	芯动联科	236	9,600.48	0.00
173	688531	日联科技	70	9,517.90	0.00
174	301315	威士顿	179	9,150.48	0.00
175	301307	美利信	280	8,920.80	0.00
176	688562	航天软件	395	8,812.45	0.00
177	688543	国科军工	154	8,169.70	0.00
178	688620	安凯微	645	7,959.30	0.00
179	301291	明阳电气	255	7,912.65	0.00
180	301360	荣旗科技	84	7,778.40	0.00
181	688352	颀中科技	642	7,748.94	0.00
182	688146	中船特气	203	7,740.39	0.00
183	688484	南芯科技	206	7,562.26	0.00
184	301382	蜂助手	229	7,520.36	0.00
185	688334	西高院	463	7,505.23	0.00
186	301387	光大同创	165	7,484.40	0.00
187	301383	天键股份	209	7,465.48	0.00
188	301141	中科磁业	174	7,428.06	0.00
189	301225	恒勃股份	222	7,383.72	0.00
190	301262	海看股份	286	7,293.00	0.00
191	301210	金杨股份	145	7,129.65	0.00
192	301429	森泰股份	339	7,125.78	0.00
193	688593	新相微	486	7,090.74	0.00
194	688523	航天环宇	297	7,083.45	0.00
195	688552	航天南湖	291	6,838.50	0.00
196	001287	中电港	305	6,411.10	0.00
197	301332	德尔玛	459	6,302.07	0.00
198	301355	南王科技	375	6,281.25	0.00
199	688535	华海诚科	121	6,198.83	0.00
200	301232	飞沃科技	103	6,017.26	0.00
201	688581	安杰思	50	5,901.50	0.00
202	301376	致欧科技	262	5,897.62	0.00
203	688429	时创能源	230	5,871.90	0.00
204	688570	天玛智控	231	5,851.23	0.00
205	301397	溯联股份	144	5,788.80	0.00
206	301305	朗坤环境	293	5,769.17	0.00
207	301357	北方长龙	118	5,710.02	0.00
208	688512	慧智微	292	5,594.72	0.00
209	300804	广康生化	169	5,571.93	0.00
210	688433	华曙高科	173	5,449.50	0.00
211	601061	中信金属	689	5,222.62	0.00
212	301281	科源制药	206	5,170.60	0.00

213	301386	未来电器	217	5,162.43	0.00
214	301170	锡南科技	147	5,134.71	0.00
215	301203	国泰环保	146	5,022.40	0.00
216	688631	莱斯信息	168	5,018.16	0.00
217	301323	新莱福	126	4,959.36	0.00
218	688623	二元科技	56	4,860.24	0.00
219	688479	友车科技	141	4,158.09	0.00
220	603135	中重科技	226	4,043.14	0.00
221	001380	华纬科技	119	3,662.82	0.00
222	601065	江盐集团	241	2,853.44	0.00
223	601133	柏诚股份	210	2,574.60	0.00
224	603137	恒尚节能	139	2,375.51	0.00
225	001282	三联锻造	71	2,345.13	0.00
226	001328	登康口腔	90	2,294.10	0.00
227	603172	万丰股份	122	1,967.86	0.00
228	001360	南矿集团	125	1,858.75	0.00
229	001324	长青科技	93	1,822.80	0.00
230	603125	常青科技	73	1,790.69	0.00
231	001367	海森药业	45	1,776.60	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	002142	宁波银行	2,207,327.00	1.00
2	601288	农业银行	1,394,315.00	0.63
3	300750	宁德时代	1,374,675.00	0.63
4	002415	海康威视	1,281,408.00	0.58
5	000063	中兴通讯	1,258,344.00	0.57
6	000090	天健集团	1,190,915.00	0.54
7	600309	万华化学	1,175,592.00	0.54
8	000425	徐工机械	1,094,915.00	0.50
9	601398	工商银行	991,300.00	0.45
10	002807	江阴银行	950,725.00	0.43
11	600941	中国移动	938,478.00	0.43
12	600085	同仁堂	898,266.00	0.41
13	000776	广发证券	893,542.00	0.41
14	601899	紫金矿业	856,990.00	0.39
15	600276	恒瑞医药	828,260.60	0.38
16	688599	天合光能	813,413.33	0.37
17	002839	张家港行	802,607.00	0.37
18	300274	阳光电源	768,861.86	0.35
19	688111	金山办公	767,959.01	0.35

20	002129	TCL 中环	725,970.00	0.33
----	--------	--------	------------	------

注：买入金额不包括相关交易费用。

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	601009	南京银行	1,608,590.40	0.73
2	600048	保利发展	1,312,835.00	0.60
3	601398	工商银行	1,242,441.00	0.57
4	000090	天健集团	1,100,926.00	0.50
5	300347	泰格医药	1,086,079.00	0.49
6	600809	山西汾酒	1,072,813.00	0.49
7	002049	紫光国微	951,024.00	0.43
8	600919	江苏银行	855,250.00	0.39
9	601838	成都银行	852,530.00	0.39
10	002807	江阴银行	831,407.00	0.38
11	688599	天合光能	790,341.35	0.36
12	600025	华能水电	762,750.00	0.35
13	600582	天地科技	736,600.00	0.34
14	002839	张家港行	734,190.00	0.33
15	600036	招商银行	678,450.00	0.31
16	002966	苏州银行	670,026.00	0.31
17	002242	九阳股份	629,457.00	0.29
18	600188	兖矿能源	627,215.00	0.29
19	002410	广联达	625,871.00	0.28
20	688390	固德威	612,357.13	0.28

注：卖出金额不包括相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	59,877,517.96
卖出股票收入（成交）总额	52,771,718.73

注：买入股票成本、卖出股票收入均不包括相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	11,604,959.51	5.51
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	309,213.21	0.15

5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	10,421,104.11	4.94
7	可转债（可交换债）	51,414,807.15	24.39
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	73,750,083.98	34.99

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	019679	22 国债 14	114,000	11,604,959.51	5.51
2	101801068	18 浙能源 MTN003	100,000	10,421,104.11	4.94
3	113037	紫银转债	79,500	8,313,484.89	3.94
4	113043	财通转债	74,890	8,001,019.85	3.80
5	110073	国投转债	58,590	6,338,251.75	3.01

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

基金主要利用股指期货进行套期保值或仓位调节操作。当进行空头套期保值时，基金持有的卖出股指期货合约价值，不超过基金持有的股票总市值的 20%，基金通过空头套期保值，一定程度上可以规避市场的系统性风险。当进行多头仓位调节时，基金持有的买入股指期货合约价值，不超过基金资产净值的 10%，基金通过持有股指期货多头合约对股票资产进行替代，可以提高投资效率，赚取或有的基差收益和实现更好的头寸管理。截止报告期末，本基金对股指期货的投资符合基金合同的约定，符合既定的投资政策和投资目标。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金未投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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

华宝新飞跃混合截止 2023 年 06 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中，上海浦东发展银行股份有限公司因违规经营，涉嫌违反法律法规，违反结汇、售汇及付汇管理规定于 2022 年 09 月 02 日收到国家外汇管理局上海市分局警告，罚款，责令改正，没收违法所得的处罚措施。

华宝新飞跃混合截止 2023 年 06 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中，财通证券股份有限公司因涉嫌违反外汇账户管理规定于 2022 年 11 月 30 日收到国家外汇管理局浙江省分局警告，罚款的处罚措施。

本基金管理人通过对上述上市公司进行进一步了解和他分析，认为上述处分不会对公司的投资价值构成实质性影响，因此本基金管理人对上述证券的投资判断未发生改变。报告期内，本基金投资的前十名证券的其余的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

7.12.2 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

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	2,910,531.95
2	应收清算款	138,391.99
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	23,226.60
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,072,150.54

7.12.4 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	113037	紫银转债	8,313,484.89	3.94
2	113043	财通转债	8,001,019.85	3.80
3	110073	国投转债	6,338,251.75	3.01
4	132026	G 三峡 EB2	5,533,828.77	2.63
5	110059	浦发转债	5,404,613.70	2.56
6	123076	强力转债	3,654,566.77	1.73

7	110067	华安转债	3,581,055.09	1.70
8	113042	上银转债	3,246,484.93	1.54
9	123113	仙乐转债	2,447,016.00	1.16
10	113046	金田转债	1,488,130.56	0.71
11	113627	太平转债	1,255,741.66	0.60
12	110082	宏发转债	869,406.85	0.41
13	128071	合兴转债	718,617.29	0.34
14	128136	立讯转债	562,589.04	0.27

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，合计数可能不等于分项之和。

§ 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 (%)
927	119,461.74	106,154,640.30	95.86	4,586,396.61	4.14

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	7,004.52	0.0063

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、基金投资和研发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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2017 年 2 月 27 日) 基金份额总额	300,097,996.34
本报告期期初基金份额总额	118,591,742.21
本报告期基金总申购份额	2,316,351.56
减：本报告期基金总赎回份额	10,167,056.86

本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	110,741,036.91

§ 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

1、基金管理人的重大人事变动

本报告期内，基金管理人无重大人事变动。

2、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，无涉及本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产和基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未发生变更。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

基金管理人为本基金聘任的会计师事务所向本基金提供的审计服务持续期限为：自 2019 年 11 月 20 日起至本报告期末。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚的情况。

10.6.2 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，本基金托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
德邦证券	2	35,651,028.93	33.41	33,116.89	33.48	-

申万宏源	1	21,198,961.8 2	19.87	19,530.58	19.75	-
中信建投	2	15,869,749.1 5	14.87	14,779.80	14.94	-
上海证券	1	15,690,531.4 2	14.71	14,455.85	14.62	-
国泰君安	2	7,043,861.98	6.60	6,559.96	6.63	-
方正证券	3	5,010,470.18	4.70	4,666.25	4.72	-
长城证券	2	2,879,060.06	2.70	2,681.20	2.71	-
平安证券	1	1,390,717.97	1.30	1,295.22	1.31	-
东吴证券	2	854,642.65	0.80	795.93	0.80	-
中金国际	1	644,099.16	0.60	599.87	0.61	-
浙商证券	1	280,676.25	0.26	258.59	0.26	-
民生证券	1	138,541.44	0.13	127.65	0.13	-
申港证券	2	40,717.93	0.04	37.92	0.04	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
东方财富	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
宏信证券	2	-	-	-	-	-
华安证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
麦高证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证 券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-

注：1. 基金管理人选择交易单元的标准和程序如下：

(1) 选择标准： 资质雄厚，信誉良好，注册资本不少于 5 亿元人民币；财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；经营行为规范，最近两年未因重大违规行为受到中国证监会和中国人民银行处罚；内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要

求；具备基金运作所需要的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需
要，并能为本基金提供全面的信息服务；研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，
能及时为本基金提供高质量的咨询服务，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告；适
当地的地域分散化。

(2) 选择程序：(a) 服务评价；(b) 拟定备选交易单元；(c) 签约。

2、本报告期租用的证券公司交易单元退租的有：宏信证券、天风证券。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名 称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期 债券 成交总 额的比例 (%)	成交金额	占当期债 券回购成 交总额的 比例 (%)	成交金额	占当期权 证 成交总额 的比例 (%)
德邦证 券	28,145,374.28	89.66	88,386,000.00	39.64	-	-
申万宏 源	-	-	-	-	-	-
中信建 投	2,015,896.44	6.42	110,114,000.00	49.39	-	-
上海证 券	-	-	-	-	-	-
国泰君 安	-	-	12,693,000.00	5.69	-	-
方正证 券	-	-	3,380,000.00	1.52	-	-
长城证 券	-	-	2,122,000.00	0.95	-	-
平安证 券	1,229,843.00	3.92	-	-	-	-
东吴证 券	-	-	2,100,000.00	0.94	-	-
中金国 际	-	-	4,030,000.00	1.81	-	-
浙商证 券	-	-	-	-	-	-
民生证 券	-	-	-	-	-	-
申港证 券	-	-	-	-	-	-

安信证 券	-	-	-	-	-	-
长江证 券	-	-	-	-	-	-
东北证 券	-	-	-	-	-	-
东方财 富	-	-	-	-	-	-
东方证 券	-	-	-	-	-	-
国联证 券	-	-	-	-	-	-
国盛证 券	-	-	-	-	-	-
国信证 券	-	-	-	-	-	-
海通证 券	-	-	-	-	-	-
宏信证 券	-	-	-	-	-	-
华安证 券	-	-	-	-	-	-
华创证 券	-	-	-	-	-	-
华泰证 券	-	-	-	-	-	-
麦高证 券	-	-	-	-	-	-
太平洋 证券	-	-	-	-	-	-
天风证 券	-	-	-	-	-	-
万联证 券	-	-	-	-	-	-
西部证 券	-	-	127,000.00	0.06	-	-
兴业证 券	-	-	-	-	-	-
银河证 券	-	-	-	-	-	-
招商证 券	-	-	-	-	-	-
中信证 券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华宝基金关于旗下部分基金新增东方财富证券股份有限公司为代销机构的公告	基金管理人网站, 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2023-01-09
2	华宝基金关于旗下部分基金新增兴业银行股份有限公司(银银平台)为代销机构的公告	基金管理人网站, 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2023-01-13
3	华宝新飞跃灵活配置混合型证券投资基金 2022 年第 4 季度报告	基金管理人网站	2023-01-19
4	华宝基金关于旗下部分基金新增第一创业证券股份有限公司为代销机构的公告	基金管理人网站, 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2023-02-13
5	华宝基金关于旗下部分基金新增海通证券股份有限公司为代销机构的公告	基金管理人网站, 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2023-02-27
6	华宝基金关于旗下部分基金新增南京证券股份有限公司为代销机构的公告	基金管理人网站, 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2023-03-01
7	华宝基金关于旗下部分基金新增国盛证券有限责任公司为代销机构的公告	基金管理人网站, 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2023-03-06
8	华宝基金关于旗下部分基金新增申万宏源西部证券有限公司为代销机构的公告	基金管理人网站, 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2023-03-22
9	华宝基金关于旗下部分基金新增申万宏源证券有限公司为代销机构的公告	基金管理人网站, 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2023-03-22
10	华宝新飞跃灵活配置混合型证券投资基金 2022 年年度报告	基金管理人网站	2023-03-31
11	华宝基金关于旗下部分基金新增兴业证券股份有限公司为代销机构的公告	基金管理人网站, 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2023-04-19
12	华宝基金管理有限公司旗下部分基金季度报告提示性公告	上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2023-04-22
13	华宝新飞跃灵活配置混合型证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	基金管理人网站	2023-04-23
14	华宝基金关于旗下部分基金新增平安银行股份有限公司为代销机构的公告	基金管理人网站, 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2023-05-05
15	华宝基金关于旗下部分基金新增麦高证券有限责任公司为代销机构的公告	基金管理人网站, 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2023-05-08
16	华宝基金关于旗下部分基金新增上海	基金管理人网站, 上海	2023-05-10

	陆享基金销售有限公司为代销机构的公告	证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	
17	华宝基金关于旗下部分基金新增华西证券股份有限公司为代销机构的公告	基金管理人网站, 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2023-05-30
18	华宝基金关于旗下部分基金新增西部证券股份有限公司为代销机构的公告	基金管理人网站, 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2023-06-16
19	华宝基金关于旗下部分基金新增安信证券股份有限公司为代销机构的公告	基金管理人网站, 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2023-06-19
20	华宝基金关于旗下部分基金新增国金证券股份有限公司为代销机构的公告	基金管理人网站, 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2023-06-28
21	华宝基金关于旗下部分基金新增德邦证券股份有限公司为代销机构的公告	基金管理人网站, 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2023-06-29

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20230101~20230630	104,603,500.00	0.00	0.00	104,603,500.00	94.46

产品特有风险

报告期内本基金出现单一投资者持有基金份额比例超过 20%的情况。

在单一投资者持有基金份额比例较高的情况下, 如该投资者集中赎回, 可能会增加基金的流动性风险。此外, 由于基金在遇到大额赎回的时候可能需要变现部分资产, 可能对持有资产的价格形成冲击, 增加基金的市场风险。基金管理人将专业审慎、勤勉尽责地运作基金资产, 加强防范流动性风险、市场风险, 保护持有人利益。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

中国证监会批准基金设立的文件;

华宝新飞跃灵活配置混合型证券投资基金基金合同;

华宝新飞跃灵活配置混合型证券投资基金招募说明书；

华宝新飞跃灵活配置混合型证券投资基金托管协议；

基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；

基金管理人报告期内在指定报刊上披露的各种公告；

基金托管人业务资格批件和营业执照。

12.2 存放地点

以上文件存于基金管理人及基金托管人办公场所备投资者查阅。

12.3 查阅方式

投资者可以通过基金管理人网站，查阅或下载基金合同、招募说明书、托管协议及基金的各种定期和临时公告。

华宝基金管理有限公司

2023 年 8 月 31 日