

# 华宝新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：华宝基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

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

<b>§1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§2 基金简介</b>	<b>5</b>
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	5
2.5 其他相关资料	6
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	6
<b>§4 管理人报告</b>	<b>7</b>
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	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
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
<b>§5 托管人报告</b>	<b>12</b>
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	13
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	13
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>13</b>
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	16
6.4 报表附注	18
<b>§7 投资组合报告</b>	<b>42</b>
7.1 期末基金资产组合情况	42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	43
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	50
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	50
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	50
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	50

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 .....	50
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	50
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	51
7.12 投资组合报告附注 .....	51
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>52</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	52
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	52
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	52
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>52</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>53</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	53
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	53
10.4 基金投资策略的改变 .....	53
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	53
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 .....	53
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	53
10.8 其他重大事件 .....	58
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>59</b>
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 .....	59
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	59
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>59</b>
12.1 备查文件目录 .....	59
12.2 存放地点 .....	59
12.3 查阅方式 .....	59

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华宝新价值灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	华宝新价值混合
基金主代码	001324
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 6 月 1 日
基金管理人	华宝基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	161,748,666.12 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，追求超越业绩比较基准的投资回报，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	1 年期银行定期存款基准利率（税后）+3%
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	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	周雷	许俊
	联系电话	021-38505888	010-66596688
	电子邮箱	xxpl@fsfund.com	fxjd_hq@bank-of-china.com
客户服务电话		400-700-5588、400-820-5050	95566
传真		021-38505777	010-66594942
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	北京市西城区复兴门内大街 1 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	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码		200120	100818
法定代表人		黄孔威	葛海蛟

### 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.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住所。
------------	--------------------

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	-3,662,254.07
本期利润	12,238,472.61
加权平均基金份额本期利润	0.0524
本期加权平均净值利润率	3.28%
本期基金份额净值增长率	2.59%
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	88,693,073.59
期末可供分配基金份额利润	0.5483
期末基金资产净值	261,005,733.17
期末基金份额净值	1.6136
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	61.36%

- 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

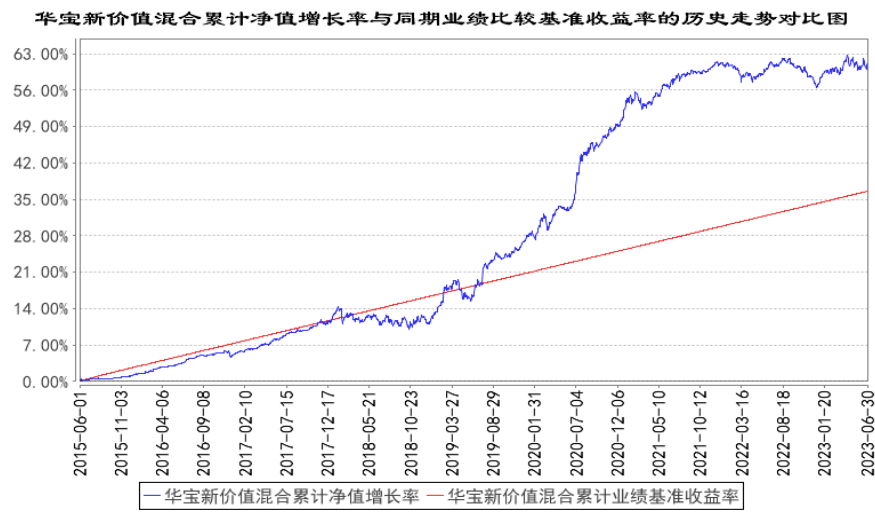
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.85%	0.27%	0.37%	0.01%	0.48%	0.26%
过去三个月	0.50%	0.27%	1.12%	0.01%	-0.62%	0.26%

过去六个月	2.59%	0.23%	2.23%	0.02%	0.36%	0.21%
过去一年	0.05%	0.19%	4.50%	0.01%	-4.45%	0.18%
过去三年	18.87%	0.21%	13.49%	0.01%	5.38%	0.20%
自基金合同生效起至今	61.36%	0.21%	36.56%	0.01%	24.80%	0.20%

注：（1）基金业绩基准：1 年期银行定期存款基准利率（税后）+3%；

（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 2015 年 12 月 01 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		
林昊	本基金经理	2017-03-17	-	17 年	硕士。2006 年 5 月加入华宝基金管理有限公司，先后担任渠道经理、交易员、高级交易员、基金经理助理等职务。2017 年 3 月起任华宝新机遇灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)、华宝新价值灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2017 年 3 月至 2023 年 3 月任华宝新活力灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2017 年 12 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 12 月至 2018 年 12 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 12 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，2018 年 8 月至 2021 年 3 月任华宝宝丰高等级债券型发起式证券投资基金基金经理，2019 年 11 月起任华宝宝惠纯债 39 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理，2020 年 7 月起任华宝宝利纯债 86 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理，2020 年 9 月起任华宝中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金基金经理，2021 年 6 月至 2023 年 3 月任华宝安盈混合型证券投资基金基金经理，2021 年 8 月起任华宝安享混合型证券投资基金基金经理，2021 年 9 月至 2022 年 6 月任华宝安益混合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遵规守信情况的说明

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、《华宝新价值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 年上半年债券市场收益率先上后下，整体较去年末有所下行。金融数据方面，在一季度信贷大幅放量后，二季度商业银行整体投放节奏有所放缓，1-6 月新增人民币信贷合计 15.73 万亿元，1-6 月新增社融合计 21.55 万亿元，均处于近年来高位。经济数据方面，1-6 月，全国固定资产投资同比增长 3.8%，其中房地产、制造业和基建（不含电力）投资的累计同比增速分别为 -7.9%、6.0% 和 7.2%，地产延续回落趋势，基建和制造业投资维持韧性。上半年社会消费品零售总额同比 8.2%，消费潜力逐步释放，线下消费场景加快恢复，接触性聚集性消费持续回暖，服务消费强劲复苏。出口受高基数和海外需求走弱影响，同比数据进一步回落，6 月按美元计出口同比增速从 5 月的 -7.5% 降至 -12.4%，但贸易顺差从 5 月的 658 亿美元增加至 706 亿美元。通胀呈现环比回落的态势，6 月 CPI 同比持平，环比增长 -0.2%，主要受到猪肉价格的负向拉动；PPI 同比下降 5.4%，环比增长 -0.8%，主要受到生产资料拖累，生产和投资端的需求仍待回升。货币政策维持宽松，中国人民银行在 6 月 13 日的公开市场操作中，下调了 7 天逆回购 10BP 至 1.90%，随后在 6 月 15 日超额续作 MLF 中相应调低利率至 2.65%，银行间流动性充裕，二季度跨季资金面波动相较于一季度末更趋缓和。整体来看，无风险收益率曲线呈现向下平移态势，1 年国债、国开较去年末分别下行 22BP、14BP 至 1.87%、2.09%；10 年国债、国开较去年末分别下行 20BP、22BP 至 2.64% 和 2.77%。

权益方面，市场表现随宏观经济预期的变动而有所波动，其中一季度经济自去年四季度低点边际改善，基建、消费、出行等行业的景气度恢复，叠加流动性的宽裕和新技术的出现，市场指

数总体上行。但经济复苏路径在二季度有所波动，总体需求在一季度集中释放后动能偏弱，市场表现重归波动，且行业分化再次扩大。整体而言，上半年沪深 300、中证 500、中证 1000 指数分别涨跌-0.75%、2.29%、5.10%，国证成长、国证价值分别变动-6.21%、4.77%，流动性宽松的环境下小盘股阶段性强于大盘，除 TMT 行业一枝独秀以外，弱复苏格局下价值风格整体强于成长。基金上半年继续明确组合收益特征目标，保持风险收益的审慎平衡，在弱势市场环境下强化对价值风格的保持，在指数下修和估值消化的过程中对未来权益市场表现渐进乐观，组合构建中重视资产的经营质地、稳定性能力和估值性价比，力争通过有性价比的超额收益提高基金的风险收益回报。

新价值混合型基金在上半年调整了债券投资比例和组合久期，增加了中长端利率债的配置，以获取无风险利率下行的收益。本基金将继续保持大类资产的平衡配置，并且积极参与新股网下申购来提高收益，本基金始终坚持绝对收益的投资目标。

#### 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 2.59%，业绩比较基准收益率为 2.23%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，重要会议的定调提振了市场信心。地方政府专项债的加速发行和使用，地产政策的适时适度调整，以及化解地方债务风险的一揽子方案均有利于拉动投资端企稳回升；积极扩大国内需求，增加居民收入、提高消费能力，有望进一步加强消费在宏观经济运行中稳定器的作用；多举措稳住外贸、外资基本盘，增加国际航班、保障中欧班列稳定畅通，有利于改善与外部经济体的沟通与协作，保持出口增长稳定。国内货币政策大概率继续维持宽松的局面，海外央行的加息进程也将进入尾声。债券市场在宽信用初期，无风险利率仍有一定下行空间，从收益率曲线看，短端的受益性更加确定，长端将在一个较宽的区间内震荡。权益市场方面，尽管上半年权益资产在指数层面表现相对波动，但相对偏弱的短期市场走势也内化了较为充分的风险预期，实际数据显示 6 月经济数据较 5 月的下行速度减缓，叠加降息政策的出台和更多政策的预期，投资者预期将有望持续修正。对于相对偏质优的资产，目前沪深 300 指数的 PE 及风险溢价率均处于历史最优的 25%左右分位数，指数层面进一步大幅度下行的空间有限，预期的消化、经济的当前状态和组合的估值水平是一个动态演化的过程，我们对未来权益部分的表现保持相对乐观。随着预期的触底和政策的逐步推出，基金在上半年债强股弱的环境下完成了预期的收益目标，未来将继续保持对市场的理解和跟踪，做好整体组合管理。

#### 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。

#### （1）日常估值流程

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帐务处理；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。

#### （2）特殊业务估值流程

根据中国证券监督管理委员会[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、中国证券投资基金业协会《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》、《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》、《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》等有关规定及本公司的估值制度，对特殊品种或由于特殊原因导致投资品种不存在活跃市场的情况，量化投资部根据估值委员会确定的对停牌股票或异常交易股票估值调整的方法（比如：指数收益法）进行估值，并兼顾行业研究员基于上市公司估值模型计算结果所提出的估值建议或意见。必要时基金经理也会就估值模型及估值方法的确定提出建议和意见，但由估值委员会做最终决策。

上述参与估值流程的人员均具备估值业务所需的专业胜任能力，参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

### 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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在华宝新价值灵活配置混合型证

券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

## 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

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

# § 6 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
<b>资 产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	2,037,391.64	1,377,815.50
结算备付金		14,855,591.48	12,440,751.11
存出保证金		2,496,425.63	2,956,806.12
交易性金融资产	6.4.7.2	217,187,233.87	525,443,872.66
其中：股票投资		104,198,527.56	123,173,144.62
基金投资		—	—
债券投资		112,988,706.31	402,270,728.04
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	27,035,320.00	30,405,965.49
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		2,866,995.21	151,714.13
应收股利		-	-
应收申购款		33,310.73	45,705.94
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		266,512,268.56	572,822,630.95
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2022 年 12 月 31 日</b>
<b>负 债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		3,248,926.66	-
应付赎回款		1,680,094.36	213,579.76
应付管理人报酬		130,771.47	292,797.40
应付托管费		54,488.12	121,998.91
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		4,510.68	33,571.67
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	387,744.10	529,651.12
负债合计		5,506,535.39	1,191,598.86
<b>净资产:</b>			
实收基金	6.4.7.10	161,748,666.12	363,417,988.64
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	99,257,067.05	208,213,043.45
净资产合计		261,005,733.17	571,631,032.09
负债和净资产总计		266,512,268.56	572,822,630.95

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.6136 元，基金份额总额 161,748,666.12 份。

## 6.2 利润表

会计主体：华宝新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	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022
-----	-----	----------------------------	---------------------------------

		年 6 月 30 日	年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		13,956,298.93	-346,347.05
1. 利息收入		262,330.45	322,961.78
其中：存款利息收入	6.4.7.13	106,136.28	149,598.01
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		156,194.17	173,363.77
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-2,503,286.26	6,029,984.47
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-5,053,409.64	-9,619,046.06
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	1,405,017.80	10,471,455.15
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-251,951.78	3,888,422.93
股利收益	6.4.7.19	1,397,057.36	1,289,152.45
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	15,900,726.68	-7,291,724.61
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	296,528.06	592,431.31
<b>减：二、营业总支出</b>		1,717,826.32	3,973,648.40
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,124,590.30	2,705,895.86
2. 托管费	6.4.10.2.2	468,579.26	1,127,456.63
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
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		11,145.72	21,384.97
8. 其他费用	6.4.7.23	113,511.04	118,910.94
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		12,238,472.61	-4,319,995.45

减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		12,238,472.61	-4,319,995.45
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		12,238,472.61	-4,319,995.45

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：华宝新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	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	363,417,988.64	-	208,213,043.45	571,631,032.09
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）	363,417,988.64	-	208,213,043.45	571,631,032.09
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-201,669,322.52	-	-108,955,976.40	-310,625,298.92
（一）、综合收益总额	-	-	12,238,472.61	12,238,472.61
（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）	-201,669,322.52	-	-121,194,449.01	-322,863,771.53
其中：1. 基金申购款	13,153,088.17	-	7,902,614.05	21,055,702.22
2. 基金赎回款	-214,822,410.69	-	-129,097,063.06	-343,919,473.75
（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)	161,748,666.12	-	99,257,067.05	261,005,733.17
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)	649,442,914.07	-	398,624,007.62	1,048,066,921.69
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)	649,442,914.07	-	398,624,007.62	1,048,066,921.69
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-177,973,974.07	-	-109,729,850.12	-287,703,824.19
(一)、综合收益总额	-	-	-4,319,995.45	-4,319,995.45
(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)	-177,973,974.07	-	-105,409,854.67	-283,383,828.74
其中：1. 基金申购款	59,789,262.67	-	36,050,413.15	95,839,675.82
2. 基金赎回款	-237,763,236.74	-	-141,460,267.82	-379,223,504.56
(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）	471,468,940.00	-	288,894,157.50	760,363,097.50
-----------------	----------------	---	----------------	----------------

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

华宝新价值灵活配置混合型证券投资基金(原名为华宝兴业新价值灵活配置混合型证券投资基金,以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015]第 799 号《关于准予华宝兴业新价值灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》核准,由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》和《华宝兴业新价值灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 1,951,610,868.52 元,业经安永华明中天会计师事务所(特殊普通合伙)安永华明(2015)验字第 60737318\_B22 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华宝兴业新价值灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2015 年 6 月 1 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,951,656,311.50 份基金份额,其中认购资金利息折合 45,442.98 份基金份额。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》,华宝兴业新价值灵活配置混合型证券投资基金于 2017 年 12 月 30 日起更名为华宝新价值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》和《华宝新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、存托凭证和其他经中国证监会核准上市的股票)、固定收益品种和货币市场工具(包括国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券(含超短期融资券)、资产支持证券、质押及买断式回购、银行存款、大额存单等)、股指期货、权证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)。本基金的股票投资比例不低于基金资产的 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,持有现金(不包括结算备付金、存出保证

金、应收申购款等)或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为: 1 年期银行定期存款基准利率(税后)+3%。

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

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“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》、《华宝新价值灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注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。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金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 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及 2023 年上半年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

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

本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。

#### 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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 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。

(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	2,037,391.64
等于：本金	2,036,615.95
加：应计利息	775.69
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	2,037,391.64

#### 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		101,006,915.35	-	104,198,527.56	3,191,612.21
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	110,662,354.21	1,966,706.31	112,988,706.31	359,645.79
	合计	110,662,354.21	1,966,706.31	112,988,706.31	359,645.79
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		211,669,269.56	1,966,706.31	217,187,233.87	3,551,258.00

#### 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	-21,009,081.45	-	-	-

其中：股指期货投资	-21,009,081.45	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-21,009,081.45	-	-	-

#### 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	-13.00	-14,938,560.00	103,461.45
IF2309	IF2309	-5.00	-5,758,500.00	208,560.00
合计				312,021.45
减：可抵销期货暂收款				312,021.45
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。

#### 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

#### 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	27,035,320.00	-
银行间市场	-	-
合计	27,035,320.00	-

##### 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 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.6 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	4,613.12
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	158,828.42
其中：交易所市场	156,773.42
银行间市场	2,055.00
应付利息	-
预提费用	224,302.56
合计	387,744.10

#### 6.4.7.7 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	363,417,988.64	363,417,988.64
本期申购	13,153,088.17	13,153,088.17
本期赎回（以“-”号填列）	-214,822,410.69	-214,822,410.69
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	161,748,666.12	161,748,666.12

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。

#### 6.4.7.8 其他综合收益

#### 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	208,036,669.43	176,374.02	208,213,043.45
本期利润	-3,662,254.07	15,900,726.68	12,238,472.61
本期基金份额交易产生的变动数	-115,681,341.77	-5,513,107.24	-121,194,449.01
其中：基金申购款	7,533,613.54	369,000.51	7,902,614.05
基金赎回款	-123,214,955.31	-5,882,107.75	-129,097,063.06
本期已分配利润	-	-	-
本期末	88,693,073.59	10,563,993.46	99,257,067.05

#### 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	25,073.68
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	80,997.28
其他	65.32
合计	106,136.28

#### 6.4.7.11 股票投资收益

##### 6.4.7.11.1 股票投资收益项目构成

##### 6.4.7.11.2 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	90,985,117.19
减：卖出股票成本总额	95,793,109.64
减：交易费用	245,417.19
买卖股票差价收入	-5,053,409.64

##### 6.4.7.11.3 股票投资收益——证券出借差价收入

#### 6.4.7.12 债券投资收益

##### 6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	4,030,306.97
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-2,625,289.17
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	1,405,017.80

##### 6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 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	388,533,404.55
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	387,071,614.33
减：应计利息总额	4,081,554.39
减：交易费用	5,525.00
买卖债券差价收入	-2,625,289.17



#### 6.4.7.12.3 债券投资收益——赎回差价收入

#### 6.4.7.12.4 债券投资收益——申购差价收入

#### 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

#### 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

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

#### 6.4.7.13.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

#### 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

#### 6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

#### 6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

#### 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

#### 6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	-251,951.78

#### 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	1,397,057.36
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	1,397,057.36

#### 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	15,548,325.23
股票投资	8,745,907.82

债券投资	6,802,417.41
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	352,401.45
权证投资	-
期货投资	352,401.45
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	15,900,726.68

#### 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	296,273.04
基金转换费收入	255.02
合计	296,528.06

注：1. 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。

2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中不低于转出基金的赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产。

#### 6.4.7.19 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

#### 6.4.7.20 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	10,608.48
账户维护费	18,000.00
上清所 CFCA 证书服务费	600.00
合计	113,511.04

#### 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
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	基金托管人, 基金销售机构
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, 基金销售机构
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
华宝稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)	本基金的基金管理人管理的其他基金

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 股票交易

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。

##### 6.4.10.1.2 应支付关联方的佣金

##### 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	1,124,590.30	2,705,895.86
其中：支付销售机构的客户维护费	279,139.18	394,585.29

注：支付基金管理人华宝基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.60%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.60% / 当年天数。

#### 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	468,579.26	1,127,456.63

注：支付基金托管人中国银行股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

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

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。

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

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 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
基金合同生效日（2015 年 6 月 1 日）持有的基金份额	—	—
报告期初持有的基金份额	6,498,765.11	6,498,765.11
报告期间申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	6,498,765.11	6,498,765.11
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	4.02%	1.38%

注：基金管理人投资本基金适用的认(申)购/赎回费率按照本基金招募说明书的规定执行。

##### 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（%）
交通银行股份有限公司—华宝稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）	2,141,373.36	1.32	2,141,373.36	0.59

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
中国银行	2,037,391.64	25,073.68	4,127,253.44	22,393.13

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，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	99	2,765.07	3,269.97	—
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	499	5,928.12	10,488.98	-
001324	长青科技	2023 年 5 月 12 日	6 个月	新股锁定	18.88	19.60	114	2,152.32	2,234.40	-
001328	登康口腔	2023 年 3 月 29 日	6 个月	新股锁定	20.68	25.49	145	2,998.60	3,696.05	-
001360	南矿集团	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股锁定	15.38	14.87	177	2,722.26	2,631.99	-
001367	海森药业	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股锁定	44.48	39.48	55	2,446.40	2,171.40	-
001380	华纬科技	2023 年 5 月 9 日	6 个月	新股锁定	28.84	30.78	168	4,845.12	5,171.04	-
301141	中科磁业	2023 年 3 月 27 日	6 个月	新股锁定	41.20	42.69	262	10,794.40	11,184.78	-
301157	华塑科技	2023 年 3 月 1 日	6 个月	新股锁定	56.50	52.93	150	8,475.00	7,939.50	-
301203	国泰环保	2023 年 3 月 28 日	6 个月	新股锁定	46.13	34.40	225	10,379.25	7,740.00	-
301246	宏源药业	2023 年 3 月 10 日	6 个月	新股锁定	50.00	30.71	540	27,000.00	16,583.40	-
301260	格力博	2023 年 1 月 20 日	6 个月	新股锁定	30.85	23.63	1,102	33,996.70	26,040.26	-
301281	科源制药	2023 年 3 月 28 日	6 个月	新股锁定	44.18	25.10	241	10,647.38	6,049.10	-
301281	科源制药	2023 年 5 月 26 日	4 个月	新股锁定-送股	-	25.10	97	-	2,434.70	-
301303	真兰仪表	2023 年 2 月 13 日	6 个月	新股锁定	26.80	22.32	931	24,950.80	20,779.92	-
301305	朗坤环境	2023 年 5 月 15 日	6 个月	新股锁定	25.25	19.69	406	10,251.50	7,994.14	-

		日									
301307	美利信	2023 年 4 月 14 日	6 个月	新股锁定	32.34	31.86	403	13,033.02	12,839.58		-
301317	鑫磊股份	2023 年 1 月 12 日	6 个月	新股锁定	20.67	26.17	694	14,344.98	18,161.98		-
301322	绿通科技	2023 年 2 月 27 日	6 个月	新股锁定	131.11	53.24	158	20,715.38	8,411.92		-
301322	绿通科技	2023 年 5 月 25 日	3 个月	新股锁定-送股	-	53.24	79	-	4,205.96		-
301325	曼恩斯特	2023 年 5 月 4 日	6 个月	新股锁定	76.80	107.95	169	12,979.20	18,243.55		-
301332	德尔玛	2023 年 5 月 9 日	6 个月	新股锁定	14.81	13.73	645	9,552.45	8,855.85		-
301345	涛涛车业	2023 年 3 月 10 日	6 个月	新股锁定	73.45	46.64	163	11,972.35	7,602.32		-
301357	北方长龙	2023 年 4 月 11 日	6 个月	新股锁定	50.00	48.39	184	9,200.00	8,903.76		-
301358	湖南裕能	2023 年 2 月 1 日	6 个月	新股锁定	23.77	42.89	741	17,613.57	31,781.49		-
301360	荣旗科技	2023 年 4 月 17 日	6 个月	新股锁定	71.88	92.60	121	8,697.48	11,204.60		-
301373	凌玮科技	2023 年 1 月 20 日	6 个月	新股锁定	33.73	31.85	277	9,343.21	8,822.45		-
301382	蜂助手	2023 年 5 月 9 日	6 个月	新股锁定	23.80	32.84	320	7,616.00	10,508.80		-
301386	未来电器	2023 年 3 月 21 日	6 个月	新股锁定	29.99	23.79	364	10,916.36	8,659.56		-
301387	光大同创	2023 年 4 月 10 日	6 个月	新股锁定	58.32	45.36	258	15,046.56	11,702.88		-
301429	森泰	2023 年	6 个月	新股锁	28.75	21.02	499	14,346.25	10,488.98		-

	股份	4月10日		定							
301439	泓淋电力	2023年3月10日	6个月	新股锁定	19.99	16.90	573	11,454.27	9,683.70		-
601061	中信金属	2023年3月30日	6个月	新股锁定	6.58	7.58	1,125	7,402.50	8,527.50		-
601065	江盐集团	2023年3月31日	6个月	新股锁定	10.36	11.84	393	4,071.48	4,653.12		-
601133	柏诚股份	2023年3月31日	6个月	新股锁定	11.66	12.26	341	3,976.06	4,180.66		-
603125	常青科技	2023年3月30日	6个月	新股锁定	25.98	24.53	120	3,117.60	2,943.60		-
603135	中重科技	2023年3月29日	6个月	新股锁定	17.80	17.89	371	6,603.80	6,637.19		-
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	中船特气	2023年4月13日	6个月	新股锁定	36.15	38.13	291	10,519.65	11,095.83		-
688334	西高院	2023年6月9日	6个月	新股锁定	14.16	16.21	581	8,226.96	9,418.01		-
688352	颀中科技	2023年4月11日	6个月	新股锁定	12.10	12.07	961	11,628.10	11,599.27		-
688361	中科飞测	2023年5月12日	6个月	新股锁定	23.60	64.67	296	6,985.60	19,142.32		-
688429	时创能源	2023年6月20日	6个月	新股锁定	19.20	25.53	292	5,606.40	7,454.76		-
688433	华曙高科	2023年4月7日	6个月	新股锁定	26.66	31.50	266	7,091.56	8,379.00		-



688443	智翔金泰	2023 年 6 月 13 日	6 个月	新股锁定	37.88	29.49	477	18,068.76	14,066.73	-
688469	中芯集成	2023 年 4 月 28 日	6 个月	新股锁定	5.69	5.41	3,581	20,375.89	19,373.21	-
688478	晶升股份	2023 年 4 月 13 日	6 个月	新股锁定	32.52	42.37	358	11,642.16	15,168.46	-
688479	友车科技	2023 年 5 月 4 日	6 个月	新股锁定	33.99	29.49	200	6,798.00	5,898.00	-
688484	南芯科技	2023 年 3 月 28 日	6 个月	新股锁定	39.99	36.71	339	13,556.61	12,444.69	-
688507	索辰科技	2023 年 4 月 10 日	6 个月	新股锁定	245.56	122.11	54	13,260.24	6,593.94	-
688507	索辰科技	2023 年 6 月 20 日	3 个月	新股锁定-送股	-	122.11	26	-	3,174.86	-
688512	慧智微	2023 年 5 月 8 日	6 个月	新股锁定	20.92	19.16	408	8,535.36	7,817.28	-
688522	纳睿雷达	2023 年 2 月 22 日	6 个月	新股锁定	46.68	51.50	3,009	140,460.12	154,963.50	-
688523	航天环宇	2023 年 5 月 26 日	6 个月	新股锁定	21.86	23.85	409	8,940.74	9,754.65	-
688531	日联科技	2023 年 3 月 24 日	6 个月	新股锁定	152.38	135.97	116	17,676.08	15,772.52	-
688535	华海诚科	2023 年 3 月 28 日	6 个月	新股锁定	35.00	51.23	161	5,635.00	8,248.03	-
688543	国科军工	2023 年 6 月 14 日	6 个月	新股锁定	43.67	53.05	195	8,515.65	10,344.75	-
688552	航天南湖	2023 年 5 月 8 日	6 个月	新股锁定	21.17	23.50	407	8,616.19	9,564.50	-
688562	航天软件	2023 年 5 月 15 日	6 个月	新股锁定	12.68	22.31	549	6,961.32	12,248.19	-

		日								
688581	安杰思	2023 年 5 月 12 日	6 个月	新股锁定	125.80	118.03	71	8,931.80	8,380.13	-
688582	芯动联科	2023 年 6 月 21 日	6 个月	新股锁定	26.74	40.68	300	8,022.00	12,204.00	-
688593	新相微	2023 年 5 月 25 日	6 个月	新股锁定	11.18	14.59	617	6,898.06	9,002.03	-
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	1,220	67,100.00	67,100.00	-
688603	天承科技	2023 年 6 月 30 日	6 个月	新股锁定	55.00	55.00	136	7,480.00	7,480.00	-
688620	安凯微	2023 年 6 月 15 日	6 个月	新股锁定	10.68	12.34	813	8,682.84	10,032.42	-
688629	华丰科技	2023 年 6 月 16 日	6 个月	新股锁定	9.26	18.59	708	6,556.08	13,161.72	-
688631	莱斯信息	2023 年 6 月 19 日	6 个月	新股锁定	25.28	29.87	212	5,359.36	6,332.44	-

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大型股份制商业银行，因而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，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。

于本报告期末，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券和资产支持证券占基金资产净值的比例较低，因此无重大信用风险(上年度末：同)。

##### 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	20,244,410.96	90,539,576.80
合计	20,244,410.96	90,539,576.80

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	41,313,581.69	90,299,330.96
AAA 以下	–	40,843,739.18
未评级	51,430,713.66	180,588,081.10
合计	92,744,295.35	311,731,151.24

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约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》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公司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。

#### 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未来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。

本基金投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种比重较大，此外还持有银行存款、结算备付金、存出保证金和买入返售金融资产等利率敏感性资产，因此存在相应的利率风险。

##### 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	2,037,391.64	-	-	-	2,037,391.64
结算备付金	14,855,591.48	-	-	-	14,855,591.48
存出保证金	12,778.43	-	-	2,483,647.20	2,496,425.63
交易性金融资产	20,244,410.96	82,315,183.33	10,429,112.02	104,198,527.56	217,187,233.87
买入返售金融资产	27,035,320.00	-	-	-	27,035,320.00
应收申购款	-	-	-	33,310.73	33,310.73
应收清算款	-	-	-	2,866,995.21	2,866,995.21
资产总计	64,185,492.51	82,315,183.33	10,429,112.02	109,582,480.70	266,512,268.56
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,680,094.36	1,680,094.36
应付管理人报酬	-	-	-	130,771.47	130,771.47
应付托管费	-	-	-	54,488.12	54,488.12
应付清算款	-	-	-	3,248,926.66	3,248,926.66
应交税费	-	-	-	4,510.68	4,510.68
其他负债	-	-	-	387,744.10	387,744.10
负债总计	-	-	-	5,506,535.39	5,506,535.39
利率敏感度缺口	64,185,492.51	82,315,183.33	10,429,112.02	104,075,945.31	261,005,733.17
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	1,377,815.50	-	-	-	1,377,815.50
结算备付金	12,440,751.11	-	-	-	12,440,751.11
存出保证金	9,817.32	-	-	2,946,988.80	2,956,806.12
交易性金融资产	90,539,576.80	311,731,151.24	-	123,173,144.62	525,443,872.66
买入返售金融资产	30,405,965.49	-	-	-	30,405,965.49
应收申购款	-	-	-	45,705.94	45,705.94
应收清算款	-	-	-	151,714.13	151,714.13
资产总计	134,773,926.22	311,731,151.24	-	126,317,553.49	572,822,630.95
负债					
应付赎回款	-	-	-	213,579.76	213,579.76
应付管理人报酬	-	-	-	292,797.40	292,797.40
应付托管费	-	-	-	121,998.91	121,998.91
应交税费	-	-	-	33,571.67	33,571.67
其他负债	-	-	-	529,651.12	529,651.12
负债总计	-	-	-	1,191,598.86	1,191,598.86
利率敏感度缺口	134,773,926.22	311,731,151.24	-	125,125,954.63	571,631,032.09

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. 市场利率下降 25 个基点	1,016,053.70	3,002,489.53
	2. 市场利率上升 25 个基点	-979,104.07	-2,981,945.54

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。本基金投资组合中股票投资比例为基金总资产的 0%-95%。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	104,198,527.56	39.92	123,173,144.62	21.55
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	104,198,527.56	39.92	123,173,144.62	21.55

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%	9,404,349.95	6,635,602.40
	2. 业绩比较基准下降 5%	-9,404,349.95	-6,635,602.40

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	103,299,092.40	122,325,185.61

第二层次	113,063,286.31	402,270,728.04
第三层次	824,855.16	847,959.01
合计	217,187,233.87	525,443,872.66

#### 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	104,198,527.56	39.10
	其中：股票	104,198,527.56	39.10
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	112,988,706.31	42.40
	其中：债券	112,988,706.31	42.40
	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	27,035,320.00	10.14
	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	16,892,983.12	6.34
8	其他各项资产	5,396,731.57	2.02
9	合计	266,512,268.56	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	1,240,125.00	0.48
B	采矿业	5,715,707.00	2.19
C	制造业	58,159,598.76	22.28
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,376,436.47	1.29
E	建筑业	2,730,998.17	1.05
F	批发和零售业	1,861,749.78	0.71
G	交通运输、仓储和邮政业	3,850,258.00	1.48
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,374,425.63	2.06
J	金融业	19,566,015.60	7.50
K	房地产业	1,611,757.00	0.62
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	345,892.01	0.13
N	水利、环境和公共设施管理业	15,734.14	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	349,830.00	0.13
S	综合	—	—
	合计	104,198,527.56	39.92

### 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	4,401	7,442,091.00	2.85
2	300750	宁德时代	17,340	3,967,218.60	1.52
3	601328	交通银行	538,700	3,124,460.00	1.20
4	601318	中国平安	63,600	2,951,040.00	1.13

5	000333	美的集团	37,500	2,209,500.00	0.85
6	600919	江苏银行	294,200	2,162,370.00	0.83
7	001965	招商公路	224,400	2,154,240.00	0.83
8	600028	中国石化	335,600	2,134,416.00	0.82
9	000858	五 粮 液	12,200	1,995,554.00	0.76
10	601668	中国建筑	313,100	1,797,194.00	0.69
11	601288	农业银行	465,000	1,641,450.00	0.63
12	600941	中国移动	17,300	1,614,090.00	0.62
13	002594	比亚迪	5,900	1,523,793.00	0.58
14	600030	中信证券	75,570	1,494,774.60	0.57
15	601398	工商银行	289,000	1,392,980.00	0.53
16	000933	神火股份	102,700	1,335,100.00	0.51
17	300274	阳光电源	11,400	1,329,582.00	0.51
18	600276	恒瑞医药	27,700	1,326,830.00	0.51
19	002371	北方华创	4,000	1,270,600.00	0.49
20	601939	建设银行	183,500	1,148,710.00	0.44
21	300316	晶盛机电	16,200	1,148,580.00	0.44
22	000568	泸州老窖	5,400	1,131,678.00	0.43
23	000063	中兴通讯	24,100	1,097,514.00	0.42
24	000338	潍柴动力	87,500	1,090,250.00	0.42
25	600129	太极集团	17,700	1,052,973.00	0.40
26	000651	格力电器	27,900	1,018,629.00	0.39
27	002415	海康威视	29,400	973,434.00	0.37
28	002179	中航光电	21,262	964,231.70	0.37
29	002475	立讯精密	29,666	962,661.70	0.37
30	601899	紫金矿业	84,500	960,765.00	0.37
31	600958	东方证券	95,600	927,320.00	0.36
32	601377	兴业证券	146,700	897,804.00	0.34
33	601211	国泰君安	61,700	863,183.00	0.33
34	688017	绿的谐波	5,100	828,240.00	0.32
35	001979	招商蛇口	63,000	820,890.00	0.31
36	600406	国电南瑞	33,600	776,160.00	0.30
37	601816	京沪高铁	145,500	765,330.00	0.29
38	000425	徐工机械	112,900	764,333.00	0.29
39	603019	中科曙光	14,900	758,410.00	0.29
40	688111	金山办公	1,600	755,552.00	0.29
41	600309	万华化学	8,400	737,856.00	0.28
42	601658	邮储银行	150,700	736,923.00	0.28
43	600933	爱柯迪	29,300	682,397.00	0.26
44	002714	牧原股份	16,100	678,615.00	0.26
45	688036	传音控股	4,600	676,200.00	0.26
46	002049	紫光国微	7,180	669,535.00	0.26
47	002129	TCL 中环	19,875	659,850.00	0.25

48	603986	兆易创新	6,200	658,750.00	0.25
49	601628	中国人寿	17,100	597,816.00	0.23
50	688981	中芯国际	11,700	591,084.00	0.23
51	600760	中航沈飞	12,720	572,400.00	0.22
52	000895	双汇发展	23,100	565,719.00	0.22
53	300498	温氏股份	30,600	561,510.00	0.22
54	600900	长江电力	25,400	560,324.00	0.21
55	601169	北京银行	119,100	551,433.00	0.21
56	300124	汇川技术	8,500	545,785.00	0.21
57	600436	片仔癀	1,900	544,084.00	0.21
58	600089	特变电工	24,100	537,189.00	0.21
59	002050	三花智控	17,700	535,602.00	0.21
60	601088	中国神华	17,400	535,050.00	0.20
61	002531	天顺风能	34,800	530,004.00	0.20
62	000938	紫光股份	16,400	522,340.00	0.20
63	002264	新华都	86,300	516,937.00	0.20
64	000028	国药一致	11,830	515,906.30	0.20
65	600325	华发股份	51,900	511,215.00	0.20
66	300760	迈瑞医疗	1,700	509,660.00	0.20
67	600027	华电国际	76,000	508,440.00	0.19
68	688120	华海清科	2,010	506,620.50	0.19
69	601186	中国铁建	49,500	487,575.00	0.19
70	002139	拓邦股份	37,300	486,765.00	0.19
71	601857	中国石油	64,100	478,827.00	0.18
72	600438	通威股份	13,800	473,478.00	0.18
73	600536	中国软件	9,880	463,174.40	0.18
74	601818	光大银行	148,800	456,816.00	0.18
75	002230	科大讯飞	6,700	455,332.00	0.17
76	600489	中金黄金	43,300	447,289.00	0.17
77	300496	中科创达	4,600	443,210.00	0.17
78	601800	中国交建	40,300	439,673.00	0.17
79	003816	中国广核	141,000	438,510.00	0.17
80	600570	恒生电子	9,900	438,471.00	0.17
81	600350	山东高速	68,800	438,256.00	0.17
82	300693	盛弘股份	11,700	431,964.00	0.17
83	600085	同仁堂	7,500	431,700.00	0.17
84	002384	东山精密	16,600	429,940.00	0.16
85	688012	中微公司	2,700	422,415.00	0.16
86	600011	华能国际	43,800	405,588.00	0.16
87	600025	华能水电	56,400	402,132.00	0.15
88	000725	京东方 A	96,000	392,640.00	0.15
89	000513	丽珠集团	10,000	389,100.00	0.15
90	603368	柳药集团	15,700	387,947.00	0.15

91	002555	三七互娱	11,000	383,680.00	0.15
92	603659	璞泰来	9,990	381,817.80	0.15
93	002709	天赐材料	9,100	374,829.00	0.14
94	600150	中国船舶	11,300	371,883.00	0.14
95	000100	TCL 科技	94,270	371,423.80	0.14
96	002152	广电运通	31,500	369,180.00	0.14
97	002267	陕天然气	46,500	368,280.00	0.14
98	601012	隆基绿能	12,300	352,641.00	0.14
99	000719	中原传媒	29,900	349,830.00	0.13
100	600282	南钢股份	103,300	348,121.00	0.13
101	002891	中宠股份	14,300	345,202.00	0.13
102	002372	伟星新材	16,800	345,072.00	0.13
103	300054	鼎龙股份	13,800	341,274.00	0.13
104	002460	赣锋锂业	5,580	340,156.80	0.13
105	603259	药明康德	5,400	336,474.00	0.13
106	600015	华夏银行	60,000	324,600.00	0.12
107	002126	银轮股份	18,200	322,140.00	0.12
108	000937	冀中能源	50,400	321,552.00	0.12
109	000977	浪潮信息	6,500	315,250.00	0.12
110	601808	中海油服	22,700	315,076.00	0.12
111	600612	老凤祥	4,300	300,484.00	0.12
112	002459	晶澳科技	7,200	300,240.00	0.12
113	600660	福耀玻璃	8,300	297,555.00	0.11
114	000738	航发控制	12,100	295,240.00	0.11
115	601319	中国人保	50,400	294,336.00	0.11
116	301168	通灵股份	4,600	286,580.00	0.11
117	600886	国投电力	22,200	280,830.00	0.11
118	600007	中国国贸	15,100	279,652.00	0.11
119	601006	大秦铁路	37,200	276,396.00	0.11
120	600426	华鲁恒升	9,000	275,670.00	0.11
121	002422	科伦药业	9,200	273,056.00	0.10
122	600566	济川药业	9,300	270,072.00	0.10
123	600985	淮北矿业	23,100	266,112.00	0.10
124	000983	山西焦煤	28,200	256,620.00	0.10
125	600362	江西铜业	13,300	252,434.00	0.10
126	002154	报喜鸟	45,300	250,056.00	0.10
127	600600	青岛啤酒	2,400	248,712.00	0.10
128	603699	纽威股份	15,300	227,664.00	0.09
129	000596	古井贡酒	900	222,642.00	0.09
130	600584	长电科技	7,100	221,307.00	0.08
131	601000	唐山港	61,200	216,036.00	0.08
132	000963	华东医药	4,900	212,513.00	0.08
133	600031	三一重工	12,600	209,538.00	0.08

134	600713	南京医药	39,000	209,430.00	0.08
135	000807	云铝股份	16,400	208,772.00	0.08
136	600795	国电电力	54,000	206,820.00	0.08
137	603043	广州酒家	7,200	203,472.00	0.08
138	600674	川投能源	11,300	170,065.00	0.07
139	002601	龙佰集团	10,300	169,950.00	0.07
140	600989	宝丰能源	12,500	157,625.00	0.06
141	603920	世运电路	8,000	156,240.00	0.06
142	688522	纳睿雷达	3,009	154,963.50	0.06
143	300109	新开源	6,000	149,220.00	0.06
144	000999	华润三九	2,200	133,452.00	0.05
145	688603	天承科技	1,356	74,580.00	0.03
146	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.01
147	301358	湖南裕能	741	31,781.49	0.01
148	301260	格力博	1,102	26,040.26	0.01
149	301303	真兰仪表	931	20,779.92	0.01
150	688469	中芯集成	3,581	19,373.21	0.01
151	688361	中科飞测	296	19,142.32	0.01
152	301325	曼恩斯特	169	18,243.55	0.01
153	301317	鑫磊股份	694	18,161.98	0.01
154	301246	宏源药业	540	16,583.40	0.01
155	688531	日联科技	116	15,772.52	0.01
156	688478	晶升股份	358	15,168.46	0.01
157	688443	智翔金泰	477	14,066.73	0.01
158	688629	华丰科技	708	13,161.72	0.01
159	301307	美利信	403	12,839.58	0.00
160	301322	绿通科技	237	12,617.88	0.00
161	688484	南芯科技	339	12,444.69	0.00
162	688562	航天软件	549	12,248.19	0.00
163	688582	芯动联科	300	12,204.00	0.00
164	301387	光大同创	258	11,702.88	0.00
165	688352	颀中科技	961	11,599.27	0.00
166	301360	荣旗科技	121	11,204.60	0.00
167	301141	中科磁业	262	11,184.78	0.00
168	688146	中船特气	291	11,095.83	0.00
169	301382	蜂助手	320	10,508.80	0.00
170	001287	中电港	499	10,488.98	0.00
170	301429	森泰股份	499	10,488.98	0.00
171	688543	国科军工	195	10,344.75	0.00
172	688620	安凯微	813	10,032.42	0.00
173	688507	索辰科技	80	9,768.80	0.00
174	688523	航天环宇	409	9,754.65	0.00
175	301439	泓淋电力	573	9,683.70	0.00

176	688552	航天南湖	407	9,564.50	0.00
177	688334	西高院	581	9,418.01	0.00
178	688593	新相微	617	9,002.03	0.00
179	301357	北方长龙	184	8,903.76	0.00
180	301332	德尔玛	645	8,855.85	0.00
181	301373	凌玮科技	277	8,822.45	0.00
182	301386	未来电器	364	8,659.56	0.00
183	601061	中信金属	1,125	8,527.50	0.00
184	301281	科源制药	338	8,483.80	0.00
185	688581	安杰思	71	8,380.13	0.00
186	688433	华曙高科	266	8,379.00	0.00
187	688535	华海诚科	161	8,248.03	0.00
188	301305	朗坤环境	406	7,994.14	0.00
189	301157	华塑科技	150	7,939.50	0.00
190	301388	欣灵电气	292	7,840.20	0.00
191	688512	慧智微	408	7,817.28	0.00
192	301203	国泰环保	225	7,740.00	0.00
193	301345	涛涛车业	163	7,602.32	0.00
194	688429	时创能源	292	7,454.76	0.00
195	603135	中重科技	371	6,637.19	0.00
196	688631	莱斯信息	212	6,332.44	0.00
197	688479	友车科技	200	5,898.00	0.00
198	001380	华纬科技	168	5,171.04	0.00
199	601065	江盐集团	393	4,653.12	0.00
200	601133	柏诚股份	341	4,180.66	0.00
201	001328	登康口腔	145	3,696.05	0.00
202	001282	三联锻造	99	3,269.97	0.00
203	603125	常青科技	120	2,943.60	0.00
204	001360	南矿集团	177	2,631.99	0.00
205	603137	恒尚节能	139	2,375.51	0.00
206	001324	长青科技	114	2,234.40	0.00
207	001367	海森药业	55	2,171.40	0.00
208	603172	万丰股份	122	1,967.86	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	601318	中国平安	1,769,338.44	0.31
2	601288	农业银行	1,568,810.00	0.27
3	000001	平安银行	1,532,085.00	0.27
4	002966	苏州银行	1,478,845.00	0.26
5	600276	恒瑞医药	1,285,274.00	0.22



6	601939	建设银行	1,138,621.00	0.20
7	601899	紫金矿业	1,115,178.00	0.20
8	000338	潍柴动力	1,101,204.00	0.19
9	600760	中航沈飞	1,047,931.00	0.18
10	000975	银泰黄金	966,540.00	0.17
11	600958	东方证券	953,913.00	0.17
12	000425	徐工机械	937,186.00	0.16
13	600030	中信证券	933,073.00	0.16
14	601995	中金公司	913,873.00	0.16
15	601377	兴业证券	912,256.00	0.16
16	601211	国泰君安	902,377.00	0.16
17	600036	招商银行	895,425.00	0.16
18	002179	中航光电	866,394.80	0.15
19	600309	万华化学	833,724.74	0.15
20	601816	京沪高铁	808,626.00	0.14

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	000776	广发证券	2,652,138.00	0.46
2	600036	招商银行	2,620,675.00	0.46
3	002966	苏州银行	2,436,798.00	0.43
4	000001	平安银行	2,233,668.00	0.39
5	300059	东方财富	2,188,631.15	0.38
6	300347	泰格医药	2,133,100.96	0.37
7	601009	南京银行	1,770,935.00	0.31
8	600519	贵州茅台	1,407,230.00	0.25
9	000596	古井贡酒	1,357,332.00	0.24
10	002821	凯莱英	1,317,085.00	0.23
11	600028	中国石化	1,273,203.00	0.22
12	000568	泸州老窖	1,260,013.00	0.22
13	002142	宁波银行	1,082,515.97	0.19
14	600760	中航沈飞	1,050,278.29	0.18
15	001979	招商蛇口	1,049,534.00	0.18
16	601012	隆基绿能	1,049,459.60	0.18
17	600809	山西汾酒	1,037,542.60	0.18
18	603259	药明康德	1,027,811.00	0.18
19	601838	成都银行	972,287.00	0.17
20	600988	赤峰黄金	918,499.00	0.16

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	68,072,584.76
卖出股票收入（成交）总额	90,985,117.19

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	10,429,112.02	4.00
2	央行票据	-	-
3	金融债券	50,699,639.91	19.42
	其中：政策性金融债	40,672,208.22	15.58
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	51,859,954.38	19.87
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	112,988,706.31	43.29

### 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	102281461	22 华发实业 MTN001B	200,000	21,272,100.82	8.15
2	230203	23 国开 03	200,000	20,427,797.26	7.83
3	220308	22 进出 08	200,000	20,244,410.96	7.76
4	230009	23 付息国债 09	100,000	10,429,112.02	4.00
5	102281597	22 成都国投 MTN001	100,000	10,346,509.59	3.96

### 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

华宝新价值混合截止 2023 年 06 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中，中国民生银行股份有限公司因信贷业务违规，票据业务违规，存款业务违规，违规销售或推介，违规授信，贷后资金流向、用途及项目进度等管理、监督、执行不到位，违规收费，内部管理与控制制度不健全或执行监督不力，未经任职资格审查或核准任命董事、高级管理人员、首席代表，编制或者提供虚假资料；于 2023 年 02 月 16 日收到银保监会罚款，没收违法所得的处罚措施。

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	2,496,425.63
2	应收清算款	2,866,995.21
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	33,310.73
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,396,731.57

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，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 (%)
39,310	4,114.70	58,674,707.52	36.28	103,073,958.60	63.72

#### 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	302,890.63	0.1873

#### 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	10~50

### § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2015 年 6 月 1 日) 基金份额总额	1,951,656,311.50
本报告期期初基金份额总额	363,417,988.64
本报告期基金总申购份额	13,153,088.17
减：本报告期基金总赎回份额	214,822,410.69
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	161,748,666.12

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金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 2015 年 12 月 15 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，本基金托管人的托管业务部门及其相关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 (%)	
广发证券	2	21,672,144.60	14.33	19,966.74	14.25	-
东方证券	1	18,346,313.08	12.13	16,902.26	12.07	-

国联证券	3	12,408,897.59	8.20	11,556.57	8.25	-
方正证券	1	12,219,645.36	8.08	11,257.91	8.04	-
东海证券	2	12,017,516.25	7.95	11,191.68	7.99	-
中信建投	2	11,333,961.25	7.49	10,504.21	7.50	-
东方财富	2	10,882,047.73	7.19	10,070.24	7.19	-
光大证券	2	10,372,506.33	6.86	9,659.85	6.90	-
东亚前海证券	1	6,617,727.16	4.38	6,163.17	4.40	-
国泰君安	1	6,230,632.00	4.12	5,802.47	4.14	-
华泰证券	2	5,705,503.52	3.77	5,259.13	3.75	-
中金国际	2	5,339,567.82	3.53	4,919.25	3.51	-
财通证券	3	4,411,380.54	2.92	4,108.47	2.93	-
海通证券	2	4,383,999.48	2.90	4,082.87	2.91	-
天风证券	3	2,995,132.65	1.98	2,789.42	1.99	-
开源证券	2	1,978,278.80	1.31	1,842.43	1.32	-
浙商证券	2	1,875,264.49	1.24	1,727.63	1.23	-
德邦证券	1	1,751,109.10	1.16	1,613.23	1.15	-
申万宏源	3	299,799.16	0.20	276.19	0.20	-
华金证券	1	280,248.36	0.19	261.00	0.19	-
上海证券	2	119,916.92	0.08	111.68	0.08	-
江海证券	2	16,291.44	0.01	15.00	0.01	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
长城证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
诚通证券	2	-	-	-	-	-
大和证券	2	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
国海证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	2	-	-	-	-	-
宏信证券	2	-	-	-	-	-
华安证券	2	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
麦高证券	1	-	-	-	-	-

民生证券	2	-	-	-	-	-
申港证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	1	-	-	-	-	-
五矿证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
英大证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	3	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-
中邮证券	1	-	-	-	-	-

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新增的有：财通证券、华泰证券、麦高证券、中信证券、中邮证券。

#### 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(%)
广发证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	5,152,730.14	50.04	-	-	-	-
方正证	5,144,236.9	49.96	309,454,000.	31.38	-	-

券	9		00			
东海证 券	-	-	24,562,000.0 0	2.49	-	-
中信建 投	-	-	228,796,000. 00	23.20	-	-
东方财 富	-	-	1,049,000.00	0.11	-	-
光大证 券	-	-	32,782,000.0 0	3.32	-	-
东亚前 海证券	-	-	31,213,000.0 0	3.17	-	-
国泰君 安	-	-	89,509,000.0 0	9.08	-	-
华泰证 券	-	-	55,234,000.0 0	5.60	-	-
中金国 际	-	-	-	-	-	-
财通证 券	-	-	46,827,000.0 0	4.75	-	-
海通证 券	-	-	45,850,000.0 0	4.65	-	-
天风证 券	-	-	38,274,000.0 0	3.88	-	-
开源证 券	-	-	62,273,000.0 0	6.31	-	-
浙商证 券	-	-	-	-	-	-
德邦证 券	-	-	-	-	-	-
申万宏 源	-	-	-	-	-	-
华金证 券	-	-	10,171,000.0 0	1.03	-	-
上海证 券	-	-	2,710,000.00	0.27	-	-
江海证 券	-	-	-	-	-	-
安信证 券	-	-	-	-	-	-
长城证 券	-	-	-	-	-	-
长江证 券	-	-	-	-	-	-
诚通证	-	-	-	-	-	-



券						
大和证 券	-	-	-	-	-	-
第一创 业	-	-	7,438,000.00	0.75	-	-
东北证 券	-	-	-	-	-	-
东吴证 券	-	-	-	-	-	-
国海证 券	-	-	-	-	-	-
国金证 券	-	-	-	-	-	-
国信证 券	-	-	-	-	-	-
国元证 券	-	-	-	-	-	-
宏信证 券	-	-	-	-	-	-
华安证 券	-	-	-	-	-	-
华宝证 券	-	-	-	-	-	-
华创证 券	-	-	-	-	-	-
麦高证 券	-	-	-	-	-	-
民生证 券	-	-	-	-	-	-
申港证 券	-	-	-	-	-	-
太平洋 证券	-	-	-	-	-	-
五矿证 券	-	-	-	-	-	-
信达证 券	-	-	-	-	-	-
兴业证 券	-	-	-	-	-	-
英大证 券	-	-	-	-	-	-
招商证 券	-	-	-	-	-	-
中泰证	-	-	-	-	-	-

券						
中信证 券	-	-	-	-	-	-
中银国 际	-	-	-	-	-	-
中邮证 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	华宝新价值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	华宝基金关于华宝新价值灵活配置混合型证券投资基金新增湘财证券股份有限公司为代销机构的公告	基金管理人网站, 中国证券报	2023-02-06
5	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
6	华宝基金关于旗下部分基金新增杭州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	2023-03-17
7	华宝新价值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
8	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
9	华宝新价值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
10	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
11	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
12	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
13	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	2023-06-16

		券时报，中国证券报	
14	华宝基金关于旗下部分基金新增上海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	2023-06-20

§ 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	20230302~20230326	57,750,478.13	0.00	30,000,000.00	27,750,478.13	17.16
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

§ 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；
- 华宝新价值灵活配置混合型证券投资基金基金合同；
- 华宝新价值灵活配置混合型证券投资基金招募说明书；
- 华宝新价值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办公场所和基金托管人住所备投资者查阅。

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