

# 华宝新价值灵活配置混合型证券投资基金 2024 年中期报告

2024 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：2024 年 8 月 30 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 2024 年 08 月 28 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 2024 年 01 月 01 日起至 2024 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	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	12
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内容的真实、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 净资产变动表	16
6.4 报表附注	17
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>38</b>
7.1 期末基金资产组合情况	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	38
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	42
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	43
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	44

7.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	44
7.8	报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	44
7.9	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	44
7.10	本基金投资股指期货的投资政策	44
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	44
7.12	投资组合报告附注	44
<b>§ 8</b>	<b>基金份额持有人信息</b>	<b>45</b>
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	45
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	46
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	46
<b>§ 9</b>	<b>开放式基金份额变动</b>	<b>46</b>
<b>§ 10</b>	<b>重大事件揭示</b>	<b>46</b>
10.1	基金份额持有人大会决议	46
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	46
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	46
10.4	基金投资策略的改变	47
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	47
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	47
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	47
10.8	其他重大事件	50
<b>§ 11</b>	<b>影响投资者决策的其他重要信息</b>	<b>51</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	51
11.2	影响投资者决策的其他重要信息	52
<b>§ 12</b>	<b>备查文件目录</b>	<b>52</b>
12.1	备查文件目录	52
12.2	存放地点	52
12.3	查阅方式	52

## § 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	80,048,495.27 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	www.fsfund.com

址	
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(2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-1,316,599.93
本期利润	5,363,282.52
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	3.27%
本期基金份额净值增长率	3.16%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	42,691,744.75
期末可供分配基金份额利润	0.5333
期末基金资产净值	129,701,881.07
期末基金份额净值	1.6203
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	62.03%

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	0.15%	0.19%	0.37%	0.01%	-0.22%	0.18%
过去三个月	0.76%	0.23%	1.12%	0.01%	-0.36%	0.22%

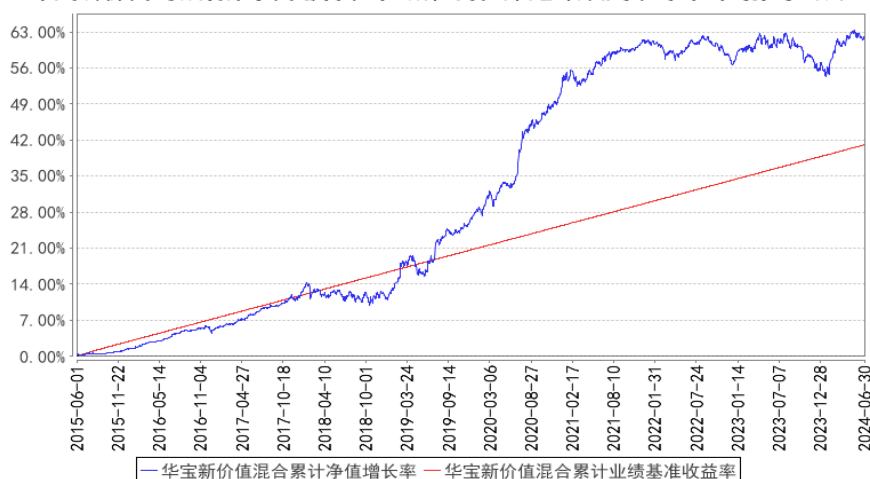
过去六个月	3.16%	0.27%	2.24%	0.02%	0.92%	0.25%
过去一年	0.42%	0.25%	4.51%	0.01%	-4.09%	0.24%
过去三年	2.41%	0.20%	13.51%	0.01%	-11.10%	0.19%
自基金合同生效起至今	62.03%	0.21%	41.07%	0.01%	20.96%	0.20%

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

华宝新价值混合累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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。截至本报告期末（2024 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 141 只，涵盖股票型基金、混合型基金、债券型基金、货币市场基金、FOF 等。

#### 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	本基金基金经理	2017-03-17	-	18 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 3 月起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，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 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 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	本基金基金经理	2024-06-14	-	9 年	硕士。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。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 月至 2023 年 11 月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 月至 2024 年 1 月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, 2023 年 9 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, 2024 年 6 月起任华宝新价值灵活配置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	2024-06-14	9 年	硕士。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 月至 2023 年 8 月任华宝新起点灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理, 2018 年 1 月至 2023 年 9 月任华宝新飞跃灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理, 2018 年 1 月至 2024 年 6 月任华宝新价值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 月至 2023 年 11 月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 月至 2024 年 1 月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, 2023 年 9 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, 2024 年 6 月起

					任华宝新价值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

本报告期内，本基金管理人未发生所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%。

本报告期内，本基金未发现异常交易行为。

#### 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

2024 年上半年债券市场收益率震荡下行，在流动性宽松和政府债供给节奏放缓的背景下，债市做多情绪高涨。上半年 GDP 增长录得 5%，达到年初制定的全年经济增长目标，其中一、二季度分别为 5.3%和 4.7%。金融数据方面，1-6 月新增社融 18.1 万亿元，人民币贷款增加 13.27 万亿元，技术性原因和融资性需求较弱共同导致信贷投放节奏放缓，债券供给节奏偏慢也影响了社融

增速，6月末社融规模存量同比增长8.1%，M2同比增长6.2%。经济数据方面，1-6月，全国固定资产投资同比增长3.9%，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-10.1%、9.5%和7.7%，地产延续回落趋势，基建韧性犹在，制造业投资依靠出口和设备更新两大支撑因素维持强势。上半年社会消费品零售总额同比增长3.7%，以餐饮、旅游为代表的服务类消费表现较好，线上消费大幅增长。受低基数效应提振，6月以美元计价出口同比增速为8.6%，较5月7.6%进一步回升，出口商品结构中车、船、家具等景气度边际回落，但机械、家电和集成电路依旧保持韧性。通胀呈现环比回落的态势，6月CPI同比0.2%，环比增长-0.2%，主要受到食品和能源价格的负向拉动；PPI同比下降0.8%，降幅进一步收窄，环比增长-0.2%，主要受国际大宗商品价格波动及国内部分工业品市场需求不足等因素影响。货币政策维持宽松，1月24日，央行行长潘功胜在国新办新闻发布会上指出“将于2月5日下调存款准备金率0.5个百分点，向市场提供长期流动性1万亿元”。二季度，央行在月末等关键时点连续加大公开市场增加逆回购投放力度，以维护市场流动性平稳。整体来看，无风险收益率曲线呈现陡峭化下行的态势，1年国债、国开较去年末分别下行54BP、51BP至1.54%、1.69%；10年国债、国开较去年末分别下行35BP、39BP至2.21%和2.29%。

权益市场方面，上半年权益市场走势宽幅波动，年初快速下跌后，2-5月中迎来三个月不同程度的渐进式修复，但在5月中下旬再次转为调整。整体而言，上证指数、沪深300指数上半年分别涨跌-0.25%、0.89%，在经历半年度的反复波动后总体收平，但具体在风格内部则仍然大幅度分化，中证500、创业板指分别下跌8.96%、10.99%，大盘风格整体强于小微盘，价值风格的防御能力强于成长。基金在上半年依靠基准风格的适当选取、股票部分的超额收益和债券部分的收益安全垫获得了总体回报上的绝对收益，未来超额的稳定性和超额收益的能力仍然是策略绝对收益和回撤控制的关键。

新价值混合型基金在上半年维持了较高的债券投资比例和适度的组合久期，在市场大幅波动中，尽可能地降低组合净值回撤。本基金将继续保持较高的债券投资比例，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3.16%，业绩比较基准收益率为2.24%。

#### 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，重要会议对未来经济工作定调非常积极，强调坚定不移实现全年经济社会发展目标。宏观政策上，积极的财政政策将推进专项债发行和使用进度，支持国家重大战略和重点领域安全能力建设，稳健的货币政策将进一步引导实体融资成本下行，新利率走廊有助于更加精准

地调控市场波动幅度。同时，中央安排了 3000 亿元左右超长期特别国债资金，支持大规模设备更新和消费品以旧换新，以扩大国内需求，进一步提升消费在宏观经济运行中稳定器的作用。随着海外风险加剧，各国央行纷纷进入降息周期，外需亦将有所走弱。因此，国内无风险利率仍有一定下行空间，但曲线形态将整体保持偏陡峭，信用利差在供需结构不均衡下进一步压缩。

#### 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其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

本基金本报告期末未进行利润分配，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的真实、准确和完整发表意见

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

# § 6 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：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	1,051,853.33	11,819,766.41
结算备付金		2,391,451.06	13,014,793.35
存出保证金		1,370,191.73	1,868,122.11
交易性金融资产	6.4.7.2	119,029,284.59	161,780,779.36
其中：股票投资		56,963,819.56	77,823,398.34
基金投资		-	-
债券投资		62,065,465.03	83,957,381.02
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	6,832,000.00	10,943,000.00
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-

应收清算款		40,813.41	279,728.14
应收股利		-	-
应收申购款		2,093.27	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		130,717,687.39	199,706,189.37
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024年6月30日</b>	<b>上年度末 2023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		-	10,263,205.81
应付赎回款		704,085.32	991,919.46
应付管理人报酬		70,381.40	104,730.89
应付托管费		23,460.47	34,910.30
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		3,483.39	45,113.75
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	214,395.74	326,637.82
负债合计		1,015,806.32	11,766,518.03
<b>净资产:</b>			
实收基金	6.4.7.7	80,048,495.27	119,661,316.90
未分配利润	6.4.7.8	49,653,385.80	68,278,354.44
净资产合计		129,701,881.07	187,939,671.34
负债和净资产总计		130,717,687.39	199,706,189.37

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.6203 元，基金份额总额 80,048,495.27 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：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2024年1月1日至2024 年6月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023 年6月30日
<b>一、营业总收入</b>		6,131,903.84	13,956,298.93
1. 利息收入		125,132.34	262,330.45
其中：存款利息收入	6.4.7.9	65,102.30	106,136.28

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		60,030.04	156,194.17
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-695,830.23	-2,503,286.26
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-2,817,592.27	-5,053,409.64
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	1,531,653.97	1,405,017.80
资产支持证券投资	6.4.7.12	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-440,027.72	-251,951.78
股利收益	6.4.7.15	1,030,135.79	1,397,057.36
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	6,679,882.45	15,900,726.68
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	22,719.28	296,528.06
<b>减：二、营业总支出</b>		768,621.32	1,717,826.32
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	491,381.99	1,124,590.30
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	163,794.05	468,579.26
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.18	-	-
7. 税金及附加		3,275.40	11,145.72
8. 其他费用	6.4.7.19	110,169.88	113,511.04
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		5,363,282.52	12,238,472.61
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		5,363,282.52	12,238,472.61
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		5,363,282.52	12,238,472.61

### 6.3 净资产变动表

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：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	119,661,316.90	-	68,278,354.44	187,939,671.34
二、本期期初净资产	119,661,316.90	-	68,278,354.44	187,939,671.34
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-39,612,821.63	-	-18,624,968.64	-58,237,790.27
（一）、综合收益总额	-	-	5,363,282.52	5,363,282.52
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-39,612,821.63	-	-23,988,251.16	-63,601,072.79
其中：1. 基金申购款	577,308.61	-	357,773.57	935,082.18
2. 基金赎回款	-40,190,130.24	-	-24,346,024.73	-64,536,154.97
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
四、本期期末净资产	80,048,495.27	-	49,653,385.80	129,701,881.07
项目	上年度可比期间 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	363,417,988.64	-	208,213,043.45	571,631,032.09
二、本期期初净资产	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)	-201,669,322.5 2	-	-108,955,976.4 0	-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净资产变动数 (净资产减少以“-”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净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
四、本期期末净资产	161,748,666.12	-	99,257,067.05	261,005,733.17

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：

向辉

基金管理人负责人

向辉

主管会计工作负责人

张幸骏

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 2024 年 8 月 30 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 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及 2024 年上半年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。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(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 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	1,051,853.33
等于：本金	1,051,704.53
加：应计利息	148.80
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	1,051,853.33

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	53,812,605.10	-	56,963,819.56	3,151,214.46
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券   交易所市	-	-	-	-

	场				
	银行间市场	60,319,360.81	1,051,465.03	62,065,465.03	694,639.19
	合计	60,319,360.81	1,051,465.03	62,065,465.03	694,639.19
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		114,131,965.91	1,051,465.03	119,029,284.59	3,845,853.65

### 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 2024年6月30日			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-11,504,640.00	-	-	-
其中：股指 期货投资	-11,504,640.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-11,504,640.00	-	-	-

#### 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
IF2407	IF2407	-11.00	-11,342,100.00	162,540.00
合计				162,540.00
减：可抵销期货 暂收款				162,540.00
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 2024 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	6,832,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	6,832,000.00	-

#### 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 2024 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1,126.80
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	38,733.58
其中：交易所市场	36,126.08
银行间市场	2,607.50
应付利息	-
预提费用	174,535.36
合计	214,395.74

#### 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	119,661,316.90	119,661,316.90
本期申购	577,308.61	577,308.61
本期赎回（以“-”号填列）	-40,190,130.24	-40,190,130.24
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	80,048,495.27	80,048,495.27

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 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	65,397,784.73	2,880,569.71	68,278,354.44
本期期初	65,397,784.73	2,880,569.71	68,278,354.44
本期利润	-1,316,599.93	6,679,882.45	5,363,282.52
本期基金份额交易产生的变动数	-21,389,440.05	-2,598,811.11	-23,988,251.16
其中：基金申购款	311,643.90	46,129.67	357,773.57
基金赎回款	-21,701,083.95	-2,644,940.78	-24,346,024.73
本期已分配利润	-	-	-
本期末	42,691,744.75	6,961,641.05	49,653,385.80

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
活期存款利息收入		10,543.83
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		54,488.21
其他		70.26
合计		65,102.30

#### 6.4.7.10 股票投资收益

##### 6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

##### 6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
卖出股票成交总额		31,167,404.21
减：卖出股票成本总额		33,931,018.66
减：交易费用		53,977.82
买卖股票差价收入		-2,817,592.27

##### 6.4.7.10.3 股票投资收益——证券出借差价收入

#### 6.4.7.11 债券投资收益

##### 6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
债券投资收益——利息收入		1,059,427.97
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入		472,226.00
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	1,531,653.97
----	--------------

## 6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	171,149,315.48
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	169,167,464.00
减：应计利息总额	1,506,075.48
减：交易费用	3,550.00
买卖债券差价收入	472,226.00

## 6.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

## 6.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入

## 6.4.7.12 资产支持证券投资收益

## 6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

## 6.4.7.13 贵金属投资收益

## 6.4.7.13.1 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 衍生工具收益

## 6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

## 6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
股指期货投资收益	-440,027.72

## 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,030,135.79
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	1,030,135.79

## 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元



项目名称	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	6,424,652.43
股票投资	6,011,678.43
债券投资	412,974.00
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	255,230.02
权证投资	-
期货投资	255,230.02
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	6,679,882.45

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	22,683.43
基金转换费收入	35.85
合计	22,719.28

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。

#### 6.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
审计费用	24,863.02
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行费用	7,034.52
账户维护费	18,000.00
上清所 CFCA 证书服务费	600.00
合计	110,169.88

## 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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例(%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例(%)
华宝证券	982,268.00	2.58	-	-

#### 6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的债券交易。

### 6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

### 6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
华宝证券	919.25	2.56	919.25	2.54
关联方名称	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
-	-	-	-	-

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

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

### 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 2024年1月1日至2024年6 月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	491,381.99	1,124,590.30
其中：应支付销售机构的客户维护 费	138,501.09	279,139.18
应支付基金管理人的净管理费	352,880.90	845,451.12

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 2024年1月1日至2024年6	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年
----	------------------------	----------------------------

	月 30 日	6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	163,794.05	468,579.26

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 0.20% 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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.20\% / \text{当年天数}。$$

#### 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

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

份额单位：份

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 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	8.12%	4.02%

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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 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)	-	-	1,141,373.36	0.95

#### 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 2024年1月1日至2024年6月30 日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023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	1,051,853.33	10,543.83	2,037,391.64	25,073.68

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（2024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
603312	西典 新能	2024 年1月 4日	6个月	新股 锁定	29.02	25.36	78	2,263.56	1,978.08	-
603325	博隆 技术	2024 年1月 3日	6个月	新股 锁定	72.46	68.06	33	2,391.18	2,245.98	-
688691	灿芯 股份	2024 年4月 2日	6个月	新股 锁定	19.86	42.51	173	3,435.78	7,354.23	-
688695	中创	2024	6个月	新股	22.43	31.55	186	4,171.98	5,868.30	-

	股份	年 3 月 6 日		锁定					
--	----	--------------	--	----	--	--	--	--	--

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。

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 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	10,025,249.32	1,507,849.32
合计	10,025,249.32	1,507,849.32

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 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
AAA	20,791,275.46	20,691,027.32
AAA 以下	-	-
未评级	31,248,940.25	61,758,504.38
合计	52,040,215.71	82,449,531.70

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》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。

### 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，此外还持有货币资金、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 2024年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	1,051,853.33	-	-	-	1,051,853.33
结算备付金	2,391,451.06	-	-	-	2,391,451.06
存出保证金	9,139.73	-	-	1,361,052.00	1,370,191.73
交易性金融资产	30,816,524.78	21,021,904.92	10,227,035.33	56,963,819.56	119,029,284.59
买入返售金融资产	6,832,000.00	-	-	-	6,832,000.00
应收申购款	-	-	-	2,093.27	2,093.27
应收清算款	-	-	-	40,813.41	40,813.41
资产总计	41,100,968.90	21,021,904.92	10,227,035.33	58,367,778.24	130,717,687.39
负债					
应付赎回款	-	-	-	704,085.32	704,085.32
应付管理人报酬	-	-	-	70,381.40	70,381.40
应付托管费	-	-	-	23,460.47	23,460.47
应交税费	-	-	-	3,483.39	3,483.39
其他负债	-	-	-	214,395.74	214,395.74
负债总计	-	-	-	1,015,806.32	1,015,806.32
利率敏感度缺口	41,100,968.90	21,021,904.92	10,227,035.33	57,351,971.92	129,701,881.07
上年度末 2023年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	11,819,766.41	-	-	-	11,819,766.41
结算备付金	13,014,793.35	-	-	-	13,014,793.35
存出保证金	5,338.11	-	-	1,862,784.00	1,868,122.11
交易性金融资产	22,194,916.97	61,762,464.05	-	77,823,398.34	161,780,779.36

买入返售金融资产	10,943,000.00	-	-	-	10,943,000.00
应收清算款	-	-	-	279,728.14	279,728.14
资产总计	57,977,814.84	61,762,464.05	-	79,965,910.48	199,706,189.37
负债					
应付赎回款	-	-	-	991,919.46	991,919.46
应付管理人报酬	-	-	-	104,730.89	104,730.89
应付托管费	-	-	-	34,910.30	34,910.30
应付清算款	-	-	-	10,263,205.81	10,263,205.81
应交税费	-	-	-	45,113.75	45,113.75
其他负债	-	-	-	326,637.82	326,637.82
负债总计	-	-	-	11,766,518.03	11,766,518.03
利率敏感度缺口	57,977,814.84	61,762,464.05	-	68,199,392.45	187,939,671.34

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（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）
	1. 市场利率下降 25 个基点	573,239.26	420,908.00
2. 市场利率上升 25 个基点	-570,025.93	-416,561.26	

#### 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 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 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	56,963,819.56	43.92	77,823,398.34	41.41
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	56,963,819.56	43.92	77,823,398.34	41.41

#### 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（2024 年 6 月 30 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	1. 业绩比较基准上升 5%		1,679,070.56
2. 业绩比较基准下降 5%		-1,679,070.56	-14,163,464.14

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

假设	-		
	-		
	-		
分析	风险价值 (单位: 人民币元)	本期末 (2024 年 6 月 30 日)	上年度末 (2023 年 12 月 31 日)
	合计	-	0.00

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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	56,946,372.97	77,272,758.40
第二层次	62,065,465.03	83,957,381.02
第三层次	17,446.59	550,639.94
合计	119,029,284.59	161,780,779.36

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	56,963,819.56	43.58
	其中：股票	56,963,819.56	43.58
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	62,065,465.03	47.48
	其中：债券	62,065,465.03	47.48
	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	6,832,000.00	5.23
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	3,443,304.39	2.63
8	其他各项资产	1,413,098.41	1.08
9	合计	130,717,687.39	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	578,744.00	0.45
B	采矿业	4,836,774.00	3.73
C	制造业	27,728,101.81	21.38
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,842,634.00	2.19
E	建筑业	1,318,884.00	1.02
F	批发和零售业	249,314.00	0.19

G	交通运输、仓储和邮政业	2,181,399.00	1.68
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,897,380.53	2.23
J	金融业	13,324,809.10	10.27
K	房地产业	288,586.00	0.22
L	租赁和商务服务业	2,419.12	0.00
M	科学研究和技术服务业	290,006.00	0.22
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	424,768.00	0.33
S	综合	-	-
	合计	56,963,819.56	43.92

### 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	3,401	4,990,593.39	3.85
2	601328	交通银行	360,100	2,689,947.00	2.07
3	601318	中国平安	43,100	1,782,616.00	1.37
4	300750	宁德时代	9,240	1,663,477.20	1.28
5	601288	农业银行	359,300	1,566,548.00	1.21
6	000333	美的集团	21,000	1,354,500.00	1.04
7	600941	中国移动	11,900	1,279,250.00	0.99
8	601398	工商银行	223,400	1,273,380.00	0.98
9	600900	长江电力	43,200	1,249,344.00	0.96
10	601668	中国建筑	214,200	1,137,402.00	0.88
11	601899	紫金矿业	64,500	1,133,265.00	0.87
12	600030	中信证券	55,070	1,003,926.10	0.77
13	002475	立讯精密	25,366	997,137.46	0.77
14	601939	建设银行	133,400	987,160.00	0.76
15	600919	江苏银行	131,100	974,073.00	0.75
16	002371	北方华创	2,600	831,714.00	0.64
17	600406	国电南瑞	33,300	831,168.00	0.64
18	600760	中航沈飞	20,120	806,812.00	0.62
19	600690	海尔智家	27,000	766,260.00	0.59
20	000338	潍柴动力	45,700	742,168.00	0.57
21	600285	羚锐制药	30,300	733,563.00	0.57

22	000933	神火股份	35,600	720,188.00	0.56
23	600028	中国石化	106,200	671,184.00	0.52
24	601211	国泰君安	44,300	600,265.00	0.46
25	600938	中国海油	18,100	597,300.00	0.46
26	600276	恒瑞医药	15,500	596,130.00	0.46
27	601088	中国神华	13,400	594,558.00	0.46
28	601138	工业富联	21,300	583,620.00	0.45
29	300498	温氏股份	29,200	578,744.00	0.45
30	603986	兆易创新	5,800	554,596.00	0.43
31	603019	中科曙光	12,900	535,350.00	0.41
32	601816	京沪高铁	99,100	532,167.00	0.41
33	600309	万华化学	6,500	525,590.00	0.41
34	600489	中金黄金	35,500	525,400.00	0.41
35	600031	三一重工	31,000	511,500.00	0.39
36	600809	山西汾酒	2,400	506,112.00	0.39
37	600660	福耀玻璃	10,500	502,950.00	0.39
38	601857	中国石油	48,700	502,584.00	0.39
39	688981	中芯国际	10,600	488,660.00	0.38
40	600350	山东高速	54,500	482,325.00	0.37
41	688012	中微公司	3,400	480,284.00	0.37
42	600737	中粮糖业	49,000	469,910.00	0.36
43	002415	海康威视	14,500	448,195.00	0.35
44	600025	华能水电	39,400	424,732.00	0.33
45	601766	中国中车	54,500	409,295.00	0.32
46	300760	迈瑞医疗	1,400	407,274.00	0.31
47	688009	中国通号	67,600	405,600.00	0.31
48	601169	北京银行	67,500	394,200.00	0.30
49	601658	邮储银行	74,900	379,743.00	0.29
50	601377	兴业证券	73,900	373,934.00	0.29
51	600373	中文传媒	24,800	368,032.00	0.28
52	601628	中国人寿	11,800	366,390.00	0.28
53	300274	阳光电源	5,880	364,736.40	0.28
54	601728	中国电信	57,600	354,240.00	0.27
55	600012	皖通高速	25,300	353,441.00	0.27
56	600741	华域汽车	20,500	335,790.00	0.26
57	600958	东方证券	43,100	327,560.00	0.25
58	002594	比亚迪	1,300	325,325.00	0.25
59	600312	平高电气	16,500	320,925.00	0.25
60	601872	招商轮船	37,600	317,720.00	0.24
61	000725	京东方 A	74,300	303,887.00	0.23
62	600750	江中药业	13,000	300,430.00	0.23
63	600282	南钢股份	59,200	294,816.00	0.23
64	603259	药明康德	7,400	290,006.00	0.22



65	600989	宝丰能源	16,600	287,678.00	0.22
66	600887	伊利股份	10,700	276,488.00	0.21
67	600188	兖矿能源	12,100	275,033.00	0.21
68	600985	淮北矿业	16,200	271,188.00	0.21
69	600150	中国船舶	6,600	268,686.00	0.21
70	600971	恒源煤电	22,300	266,262.00	0.21
71	601985	中国核电	24,700	263,302.00	0.20
72	600129	太极集团	8,800	254,496.00	0.20
73	601000	唐山港	49,000	230,300.00	0.18
74	000100	TCL 科技	52,770	227,966.40	0.18
75	601600	中国铝业	29,700	226,611.00	0.17
76	600183	生益科技	10,500	221,130.00	0.17
77	600585	海螺水泥	9,200	217,028.00	0.17
78	002230	科大讯飞	5,000	214,750.00	0.17
79	688111	金山办公	900	204,750.00	0.16
80	600027	华电国际	29,300	203,342.00	0.16
81	601006	大秦铁路	27,900	199,764.00	0.15
82	600015	华夏银行	30,300	193,920.00	0.15
83	603393	新天然气	5,400	187,596.00	0.14
84	600011	华能国际	19,100	183,742.00	0.14
85	600089	特变电工	13,230	183,500.10	0.14
86	601800	中国交建	20,300	181,482.00	0.14
87	600886	国投电力	9,900	180,576.00	0.14
88	002533	金杯电工	17,600	175,120.00	0.14
89	688120	华海清科	910	172,517.80	0.13
90	601818	光大银行	53,500	169,595.00	0.13
91	603368	柳药集团	9,300	162,750.00	0.13
92	600085	同仁堂	4,200	160,482.00	0.12
93	601688	华泰证券	12,800	158,592.00	0.12
94	601012	隆基绿能	11,300	158,426.00	0.12
95	600398	海澜之家	17,000	157,080.00	0.12
96	600479	千金药业	15,100	153,567.00	0.12
97	600674	川投能源	8,000	150,000.00	0.12
98	600584	长电科技	4,700	149,037.00	0.11
99	600362	江西铜业	6,200	146,816.00	0.11
100	600007	中国国贸	6,600	144,936.00	0.11
101	600325	华发股份	22,100	143,650.00	0.11
102	000977	浪潮信息	3,900	141,843.00	0.11
103	600426	华鲁恒升	5,100	135,864.00	0.10
104	000425	徐工机械	19,000	135,850.00	0.10
105	002048	宁波华翔	9,200	119,048.00	0.09
106	002126	银轮股份	6,800	118,388.00	0.09
107	603920	世运电路	5,300	104,622.00	0.08

108	605599	菜百股份	6,800	86,564.00	0.07
109	300033	同花顺	800	82,960.00	0.06
110	002236	大华股份	4,900	75,754.00	0.06
111	603816	顾家家居	2,100	67,809.00	0.05
112	601111	中国国航	8,900	65,682.00	0.05
113	600873	梅花生物	5,700	57,114.00	0.04
114	601019	山东出版	4,800	56,736.00	0.04
115	600295	鄂尔多斯	5,400	53,568.00	0.04
116	688691	灿芯股份	173	7,354.23	0.01
117	688695	中创股份	186	5,868.30	0.00
118	603373	安邦护卫	88	2,419.12	0.00
119	603325	博隆技术	33	2,245.98	0.00
120	603312	西典新能	78	1,978.08	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	600690	海尔智家	752,011.00	0.40
2	688009	中国通号	388,476.25	0.21
3	601766	中国中车	388,439.00	0.21
4	600012	皖通高速	369,549.00	0.20
5	601728	中国电信	367,500.00	0.20
6	600741	华域汽车	367,177.00	0.20
7	600750	江中药业	357,997.00	0.19
8	600285	羚锐制药	314,902.00	0.17
9	600732	爱旭股份	290,950.00	0.15
10	600737	中粮糖业	284,625.00	0.15
11	600060	海信视像	229,612.00	0.12
12	603393	新天然气	211,707.00	0.11
13	601689	拓普集团	206,351.00	0.11
14	600660	福耀玻璃	182,045.00	0.10
15	600519	贵州茅台	167,149.00	0.09
16	603019	中科曙光	163,489.00	0.09
17	605599	菜百股份	150,477.00	0.08
18	600887	伊利股份	149,352.00	0.08
19	601158	重庆水务	148,177.00	0.08
20	603986	兆易创新	141,474.00	0.08

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(%)
----	------	------	----------	----------------

	码			
1	600519	贵州茅台	1,767,416.00	0.94
2	300750	宁德时代	898,057.00	0.48
3	600919	江苏银行	814,877.00	0.43
4	000333	美的集团	814,835.00	0.43
5	601318	中国平安	712,168.00	0.38
6	601328	交通银行	618,824.00	0.33
7	000858	五粮液	598,942.00	0.32
8	603259	药明康德	532,431.00	0.28
9	688036	传音控股	527,575.23	0.28
10	600276	恒瑞医药	507,471.61	0.27
11	000651	格力电器	496,016.00	0.26
12	000933	神火股份	473,999.00	0.25
13	600933	爱柯迪	470,668.00	0.25
14	000895	双汇发展	452,147.00	0.24
15	603699	纽威股份	446,413.00	0.24
16	601012	隆基绿能	432,989.00	0.23
17	600309	万华化学	411,219.00	0.22
18	600030	中信证券	400,095.00	0.21
19	601288	农业银行	399,200.00	0.21
20	601689	拓普集团	398,672.00	0.21

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	7,059,761.45
卖出股票收入（成交）总额	31,167,404.21

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	10,227,035.33	7.89
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,025,249.32	7.73
	其中：政策性金融债	10,025,249.32	7.73
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	41,813,180.38	32.24
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	62,065,465.03	47.85

## 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	100,000	10,570,059.02	8.15
2	102281597	22 成都国投 MTN001	100,000	10,524,557.38	8.11
3	102281632	22 江津园区 MTN002	100,000	10,497,347.54	8.09
4	2400002	24 特别国债 02	100,000	10,227,035.33	7.89
5	102000779	20 西安高新 MTN004	100,000	10,221,216.44	7.88

## 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 2024 年 06 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中，交通银行股份有限公司

司因一、安全测试存在薄弱环节二、运行管理存在漏洞三、数据安全管理制度不足四、灾备管理不足；于 2024 年 06 月 03 日收到国家金融监督管理总局罚款的处罚措施。

本基金管理人通过对上述上市公司进行进一步了解和视为，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	1,370,191.73
2	应收清算款	40,813.41
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	2,093.27
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,413,098.41

### 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 (%)
9,074	8,821.74	31,407,110.40	39.24	48,641,384.87	60.76

### 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	307,966.86	0.3847

### 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 究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	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	119,661,316.90
本报告期基金总申购份额	577,308.61
减：本报告期基金总赎回份额	40,190,130.24
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	80,048,495.27

## § 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，经中国银行股份有限公司研究决定，郭德秋先生不再担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

### 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 (%)	
中信建投	2	8,798,551.94	23.09	8,315.55	23.13	-
中信证券	4	7,573,987.50	19.88	7,130.79	19.83	-
华泰证券	2	7,569,941.13	19.87	7,151.11	19.89	-
国海证券	2	3,697,191.94	9.70	3,496.34	9.73	-
上海证券	2	3,539,565.25	9.29	3,348.21	9.31	-
东吴证券	2	2,385,187.93	6.26	2,256.36	6.28	-
浙商证券	2	1,216,176.89	3.19	1,139.32	3.17	-
华宝证券	1	982,268.00	2.58	919.25	2.56	-
招商证券	4	813,249.00	2.13	761.11	2.12	-
方正证券	1	794,253.54	2.08	743.29	2.07	-
麦高证券	1	441,963.00	1.16	413.62	1.15	-
长江证券	1	262,331.95	0.69	248.13	0.69	-
中泰证券	1	9,337.50	0.02	8.82	0.02	-
东北证券	2	7,970.22	0.02	7.54	0.02	-
国信证券	1	7,401.65	0.02	7.00	0.02	-
申万宏源	3	5,479.02	0.01	5.18	0.01	-
财通证券	3	-	-	-	-	-
长城证券	2	-	-	-	-	-
诚通证券	2	-	-	-	-	-
大和证券	2	-	-	-	-	-
德邦证券	1	-	-	-	-	-

第一创业	1	-	-	-	-	-
东方财富	2	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	2	-	-	-	-	-
东亚前海 证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	4	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
国联证券	3	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
国投证券	2	-	-	-	-	-
国元证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
宏信证券	2	-	-	-	-	-
华安证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
华金证券	1	-	-	-	-	-
华林证券	1	-	-	-	-	-
江海证券	2	-	-	-	-	-
开源证券	2	-	-	-	-	-
联储证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	2	-	-	-	-	-
山西证券	2	-	-	-	-	-
申港证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证 券	1	-	-	-	-	-
天风证券	3	-	-	-	-	-
五矿证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
英大证券	2	-	-	-	-	-
中金国际	2	-	-	-	-	-
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，并能为本基金提供全面的信息服；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：中信证券；退租交易单元：国投证券、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 (%)
中信建投	1,507,400.55	100.00	54,500,000.00	8.76	-	-
中信证券	-	-	31,526,000.00	5.07	-	-
华泰证券	-	-	88,663,000.00	14.26	-	-
国海证券	-	-	27,476,000.00	4.42	-	-
上海证券	-	-	121,988,000.00	19.62	-	-
东吴证券	-	-	15,414,000.00	2.48	-	-
浙商证券	-	-	119,876,000.00	19.28	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	54,814,000.00	8.81	-	-
麦高证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	37,744,000.00	6.07	-	-
中泰证券	-	-	1,650,000.00	0.27	-	-
东北证券	-	-	28,775,000.00	4.63	-	-
国信证券	-	-	16,887,000.00	2.72	-	-
申万宏源	-	-	7,659,000.00	1.23	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
诚通证券	-	-	-	-	-	-
大和证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-

东方证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
东亚前海 证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	14,900,000.00	2.40	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
宏信证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
华林证券	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
联储证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
申港证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证 券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
五矿证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-
中金国际	-	-	-	-	-	-
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银泰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	2024-01-05

2	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	2024-01-19
3	华宝基金关于旗下部分基金新增上海大智慧基金销售有限公司为代销机构的通知	基金管理人网站	2024-02-29
4	华宝基金管理有限公司旗下部分基金年度报告提示性公告	上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2024-03-29
5	华宝新价值灵活配置混合型证券投资基金恢复申购、转换转入及定期定额投资业务的公告	基金管理人网站, 中国证券报	2024-04-11
6	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	2024-04-19
7	华宝基金关于旗下部分基金新增华福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	2024-05-16
8	华宝新价值灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告	基金管理人网站, 中国证券报	2024-06-14
9	华宝新价值灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要(更新)	基金管理人网站	2024-06-17
10	华宝新价值灵活配置混合型证券投资基金招募说明书(更新)	基金管理人网站	2024-06-17
11	华宝基金关于旗下部分基金新增东方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	2024-06-25
12	华宝新价值灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要(更新)	基金管理人网站	2024-06-28

## § 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	20240101~20240305, 20240617~20240630	24,750,478.13	0.00	8,200,000.00	16,550,478.13	20.68
产品特有风险							
<p>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。</p> <p>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。</p>							

## 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及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

2024年8月30日