

华宝动力组合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

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	42
7.1 期末基金资产组合情况	42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	43
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	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	50
7.12 投资组合报告附注	50
§ 8 基金份额持有人信息	51
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	51
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	52
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	52
§ 9 开放式基金份额变动	52
§ 10 重大事件揭示	52
10.1 基金份额持有人大会决议	52
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
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	59
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
§ 12 备查文件目录	60
12.1 备查文件目录	60
12.2 存放地点	60
12.3 查阅方式	60

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华宝动力组合混合型证券投资基金	
基金简称	华宝动力组合混合	
基金主代码	240004	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2005 年 11 月 17 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	789,947,101.28 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华宝动力组合混合 A	华宝动力组合混合 C
下属分级基金的交易代码	240004	016257
报告期末下属分级基金的份额总额	657,115,994.11 份	132,831,107.17 份

2.2 基金产品说明

投资目标	通过对基金组合的动态优化管理，使基金收益持续稳定超越比较基准，并追求单位风险所获得的超额收益最大化。
投资策略	本基金根据中国股市价值驱动因子与成长驱动因子的变动趋势，调整评估个股“价值因子”与“成长因子”的权重比例，自下而上精选个股，获取超额收益。
业绩比较基准	80%上证 180 指数收益率与深证 100 指数收益率的流通市值加权平均 + 20%上证国债指数收益率
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
	联系电话	021-38505888
	电子邮箱	xxpl@fsfund.com
客户服务电话	400-700-5588、400-820-5050	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	北京市西城区复兴门内大街 1 号

	58 楼	
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	证券时报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.fsfund.com
基金中期报告备置地点	基金管理人办公场所和基金托管人住所。

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)		
	华宝动力组合混合 A	华宝动力组合混合 C	
本期已实现收益	28,366,472.66	15,273,104.80	
本期利润	66,317,547.35	14,600,477.87	
加权平均基金份额本期利润	0.1131	0.0817	
本期加权平均净值利润率	3.56%	2.58%	
本期基金份额净值增长率	4.64%	4.33%	
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	1,221,737,092.20	244,745,600.03
	期末可供分配基金份额利润	1.8592	1.8425
	期末基金资产净值	2,067,770,416.80	415,729,966.61
	期末基金份额净值	3.1467	3.1298

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	1,376.63%	3.86%

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

华宝动力组合混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-0.85%	2.09%	1.05%	0.69%	-1.90%	1.40%
过去三个月	-2.52%	1.37%	-3.92%	0.67%	1.40%	0.70%
过去六个月	4.64%	1.13%	-0.78%	0.68%	5.42%	0.45%
过去一年	1.88%	1.43%	-11.30%	0.79%	13.18%	0.64%
过去三年	63.03%	1.51%	-1.54%	0.96%	64.57%	0.55%
自基金合同生效起至今	1,376.63%	1.57%	336.38%	1.32%	1,040.25%	0.25%

华宝动力组合混合 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-0.90%	2.09%	1.05%	0.69%	-1.95%	1.40%
过去三个月	-2.66%	1.37%	-3.92%	0.67%	1.26%	0.70%
过去六个月	4.33%	1.13%	-0.78%	0.68%	5.11%	0.45%
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-

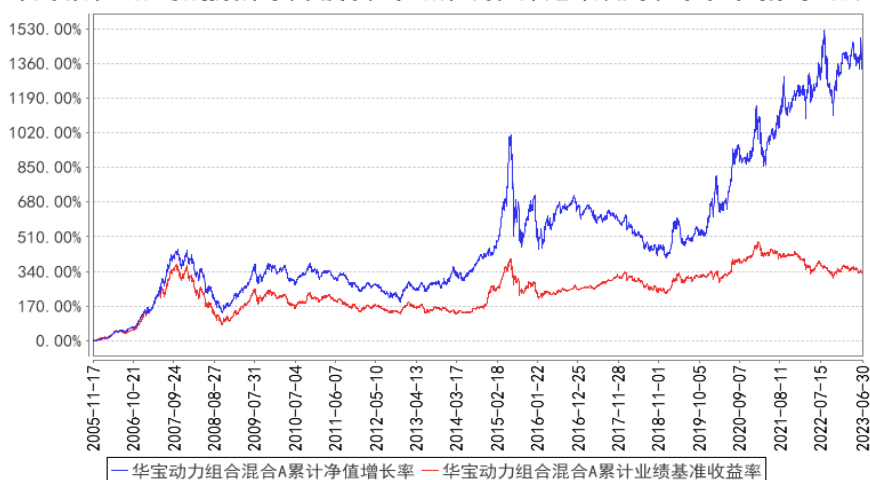
自基金合同生效起 至今	3.86%	1.43%	-7.75%	0.80%	11.61%	0.63%
----------------	-------	-------	--------	-------	--------	-------

注：（1）基金业绩基准：80%上证 180 指数收益率与深证 100 指数收益率的流通市值加权平均+20% 上证国债指数收益率；

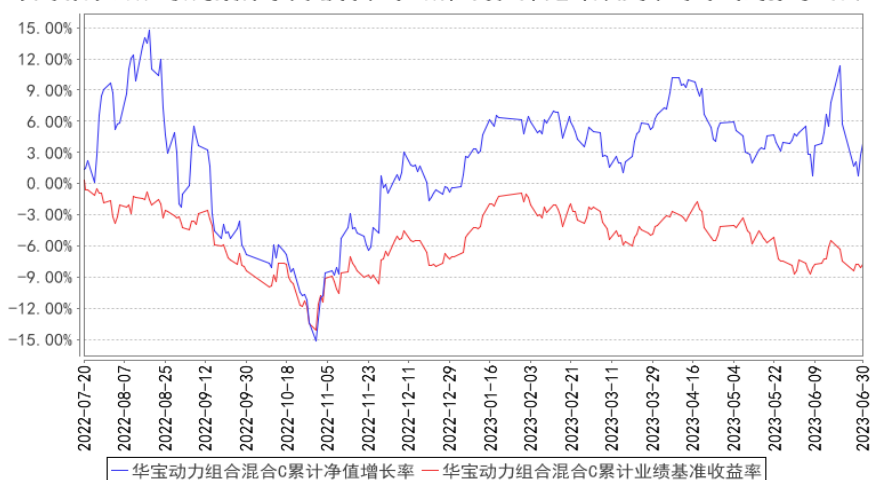
（2）净值以及比较基准相关数据计算中涉及天数的，包括所有交易日以及季末最后一自然日（如非交易日）。

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

华宝动力组合混合A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



华宝动力组合混合C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 2006 年 05 月 17 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		
刘自强	本基金基金经理、均衡风格投资总监	2008-03-19	-	22 年	硕士。曾在天同证券、中原证券、上海融昌资产管理公司从事证券研究工作。2006 年 5 月加入华宝基金管理有限公司，先后任高级分析师、研究部总经理助理、基金经理助理、投资副总监、投资总监等职务。2008 年 3 月起任华宝动力组合混合型证券投资基金基金经理，2010 年 6 月至 2012 年 1 月任华宝宝康消费品证券投资基金基金经理，2014 年 12 月至 2018 年 8 月任华宝高端制造股票型证券投资基金基金经理，2015 年 5 月至 2019 年 7 月任华宝国策导向混合型证券投资基金基金经理，2016 年 11 月至 2019 年 7 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 1 月起任华宝行业精选混合型证券投资基金基金经理，2023 年 3 月起任华宝远见回报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、《华宝动力组合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，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

新年以来，市场明显复苏。一方面，指数仍处于低位，另一方面，随着地产等政策放松，市场对未来经济复苏的预期加强，使市场进入了较好的反弹窗口。加之海外市场因加息节奏减缓而反弹，人民币恢复上涨，外部环境也非常有利，因此指数出现了一波持续上升的过程。进入 2 月，市场在快速反弹后资金流出开始增加，进入横盘整理过程，板块轮动较快，持续力不强，结构化明显。结构上，以中特估为主线的基建、银行、运营商等大幅拉升，以 AI 为主线的传媒、半导体、计算机大幅上涨，而资金仍然集中的新能源持续下跌。二季度伊始，减量市场的特征更加明显，叠加经济数据疲弱，资金从顺周期及新能源方向集中流出，导致 AI 产业成为市场唯一亮点，热度进一步发酵，市场机会集中在了传媒、通讯、计算机等狭小方向，其他板块大幅下跌。进入

5 月后，经济数据愈发疲弱，市场陷入恐慌情绪，各板块轮番下跌，指数再度跌破 3200 点。为应对经济的低迷，6 月政策再度释放放松信号，市场也迎来了一波短暂而快速的反弹。

年初本基金积极提升了仓位，组合从偏防御的结构向价值类均衡转换，增配了消费、医药等行业，因此反弹效果较好。在年初的白酒板块快速反弹后，逐步将白酒向传媒、航空进行了切换。同时，考虑到经济数据恢复较好，地产政策有可能逐步减弱，因此退出了地产及产业链方向，以金融板块进行了替换。这些操作在后续的传媒大涨的行情中获得了较好的回报。到季度末，考虑到 AI 概念的过度狂热，本基金退出了传媒板块，适当降低了仓位，并增加了消费、电子等方向的配置，仓位也进行了下调。减仓操作在下跌过程中获得了较好的抗跌性。至 5 月下旬，考虑到市场估值再度回到了低位，且风险因素已经在股价中有充分的反映，同时预判政策会有一些的对冲需求，因此开始积极提升仓位。结构上也开始向半导体、传媒、通讯等弹性方向切换，在反弹中获得了不错的超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金份额 A 类净值增长率为 4.64%，本报告期基金份额 C 类净值增长率为 4.33%；同期业绩比较基准收益率为-0.78%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在政治局会议对经济形势作出批示后，市场的政策底明显出现。由于相应的政策出台还有一定的节奏和时间，因此随着政策的发酵，短期价值风格的反弹应当继续演绎。但后续的持续力取决于具体政策和经济复苏效果的验证，并将最终伴随出现市场底。从中期角度看，由于我们对经济发展的态度要更重视高质量发展，因此顺周期方向未来面临新旧投资模式转变的挑战。从海外与中国过去类似的年份比较，本基金认为优势产业将向有确切高增长的成长性行业、有消费习惯变化的新兴消费、适应更广大人民需求的高性价比消费等几个方向集中。未来本基金将着重在这些领域挖掘投资机会，争取为基民获取更好的回报。

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、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”）在华宝动力组合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遵规守信、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：华宝动力组合混合型证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	170,887,537.91	441,505,185.27
结算备付金		8,195,081.07	7,228,911.06
存出保证金		1,007,316.21	890,410.39
交易性金融资产	6.4.7.2	2,331,738,838.29	1,702,533,500.41
其中：股票投资		2,331,738,838.29	1,702,533,500.41
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
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		18,558,094.16	-
应收股利		-	-
应收申购款		3,183,981.36	3,422,769.16
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		2,533,570,849.00	2,155,580,776.29
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		9,425,323.30	99,325,260.10
应付赎回款		26,680,495.35	2,015,794.06

应付管理人报酬		3,225,357.42	2,309,155.08
应付托管费		537,559.58	384,859.17
应付销售服务费		253,055.49	144,368.64
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	9,948,674.45	8,326,115.48
负债合计		50,070,465.59	112,505,552.53
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	789,947,101.28	679,739,729.90
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	1,693,553,282.13	1,363,335,493.86
净资产合计		2,483,500,383.41	2,043,075,223.76
负债和净资产总计		2,533,570,849.00	2,155,580,776.29

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额总额 789,947,101.28 份，其中华宝动力组合混合 A 基金份额总额 657,115,994.11 份，基金份额净值 3.1467 元；华宝动力组合混合 C 基金份额总额 132,831,107.17 份，基金份额净值 3.1298 元。

6.2 利润表

会计主体：华宝动力组合混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		103,749,803.26	99,451,144.12
1. 利息收入		1,027,353.80	655,592.37
其中：存款利息收入	6.4.7.13	659,812.64	349,489.83
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		367,541.16	306,102.54
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		64,710,462.69	58,006,320.91
其中：股票投资收益	6.4.7.14	52,180,440.73	50,617,244.82
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	-
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	-	-
股利收益	6.4.7.19	12,530,021.96	7,389,076.09
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	37,278,447.76	40,504,315.77
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	733,539.01	284,915.07
减：二、营业总支出		22,831,778.04	8,647,410.07
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	18,024,975.60	7,315,252.33
2. 托管费	6.4.10.2.2	3,004,162.68	1,219,208.66
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	1,675,424.69	-
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		-	-
8. 其他费用	6.4.7.23	127,215.07	112,949.08
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		80,918,025.22	90,803,734.05
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		80,918,025.22	90,803,734.05
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		80,918,025.22	90,803,734.05

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：华宝动力组合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）	679,739,729.90	-	1,363,335,493.	2,043,075,223.7

			86	6
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)	679,739,729.90	-	1,363,335,493.86	2,043,075,223.76
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	110,207,371.38	-	330,217,788.27	440,425,159.65
(一)、综合收益总额	-	-	80,918,025.22	80,918,025.22
(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)	110,207,371.38	-	249,299,763.05	359,507,134.43
其中：1. 基金申购款	446,067,000.71	-	966,235,444.78	1,412,302,445.49
2. 基金赎回款	-335,859,629.33	-	-716,935,681.73	-1,052,795,311.06
(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)	789,947,101.28	-	1,693,553,282.13	2,483,500,383.41
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)	309,147,938.33	-	564,263,974.23	873,411,912.56
加：会计政策变	-	-	-	-

更				
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	309,147,938.33	-	564,263,974.23	873,411,912.56
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	47,782,934.54	-	181,264,126.95	229,047,061.49
(一)、综合收益总额	-	-	90,803,734.05	90,803,734.05
(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)	47,782,934.54	-	90,460,392.90	138,243,327.44
其中：1. 基金申购款	132,359,391.47	-	246,180,010.08	378,539,401.55
2. 基金赎回款	-84,576,456.93	-	-155,719,617.18	-240,296,074.11
(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)	356,930,872.87	-	745,528,101.18	1,102,458,974.05

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	向辉	张幸骏
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

华宝动力组合混合型证券投资基金(原名为华宝兴业动力组合股票型证券投资基金、华宝兴业动力组合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”)证监基金字[2005]第 162 号《关于同意华宝兴业动力组合股票型证券投资基金募集的批复》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《华宝兴业动力组合股票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,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 535,344,206.95 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2005)第 168 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华宝兴业动力组合股票型证券投资基金基金合同》于 2005 年 11 月 17 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 535,410,310.23 份基金份额,其中认购资金利息折合 66,103.28 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《华宝基金管理股份有限公司关于华宝动力组合混合型证券投资基金增加 C 类基金份额并修改基金合同等法律文件的公告》,自 2022 年 7 月 19 日起,增设 C 类基金份额。增加 C 类基金份额后,本基金将设 A 类基金份额和 C 类基金份额两个基金份额类别,本基金原有份额调整为 A 类基金份额。本基金根据销售服务费及申购费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。其中,在投资者申购时收取申购费且不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为 A 类基金份额;在投资者申购时不收取申购费但从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为 C 类基金份额。两类基金份额分设不同的基金代码,并分别公布基金份额净值和基金份额累计净值。

根据 2014 年中国证监会令第 104 号《公开募集证券投资基金运作管理办法》,华宝兴业动力组合股票型证券投资基金于 2015 年 7 月 22 日公告后更名为华宝兴业动力组合混合型证券投资基金。

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》,华宝兴业动力组合混合型证券投资基金于 2017 年 12 月 30 日起更名为华宝动力组合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《华宝动力组合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国内依法发行、上市的股票(包括存托凭证)、债券及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。在正常的市场情况下,本基金的投资比例范围为:股票占基金资产净值的 60%-95%;债券占 0%-40%;现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款

等)或者到期日在一年内的政府债券比例在 5%以上。本基金的业绩比较基准为: 上证 180 指数收益率与深证 100 指数收益率的流通市值加权平均 $\times 80\%$ +上证国债指数收益率 $\times 20\%$ 。

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》、《华宝动力组合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	170,887,537.91
等于：本金	170,863,950.89
加：应计利息	23,587.02
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	170,887,537.91

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	2,284,947,745.99	-	2,331,738,838.29	46,791,092.30
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	2,284,947,745.99	-	2,331,738,838.29	46,791,092.30

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无

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

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 债权投资

无

6.4.7.6 其他债权投资

无

6.4.7.7 其他权益工具投资

无

6.4.7.8 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	64,300.55
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	9,735,111.46
其中：交易所市场	9,735,111.46
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	149,260.15
其他	2.29
合计	9,948,674.45

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

华宝动力组合混合 A

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	534,967,348.72	534,967,348.72
本期申购	286,853,910.54	286,853,910.54
本期赎回（以“-”号填列）	-164,705,265.15	-164,705,265.15
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	657,115,994.11	657,115,994.11

华宝动力组合混合 C

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	144,772,381.18	144,772,381.18
本期申购	159,213,090.17	159,213,090.17
本期赎回 (以“-”号填列)	-171,154,364.18	-171,154,364.18
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	132,831,107.17	132,831,107.17

注：申购含红利再投以及转换入份(金)额，赎回含转换出份(金)额。

6.4.7.11 其他综合收益

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

华宝动力组合混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	952,633,952.94	121,174,074.71	1,073,808,027.65
本期利润	28,366,472.66	37,951,074.69	66,317,547.35
本期基金份额交易产生的变动数	240,736,666.60	29,792,181.09	270,528,847.69
其中：基金申购款	545,407,817.57	74,407,431.05	619,815,248.62
基金赎回款	-304,671,150.97	-44,615,249.96	-349,286,400.93
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,221,737,092.20	188,917,330.49	1,410,654,422.69

华宝动力组合混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	256,744,665.75	32,782,800.46	289,527,466.21
本期利润	15,273,104.80	-672,626.93	14,600,477.87
本期基金份额交易产生的变动数	-27,272,170.52	6,043,085.88	-21,229,084.64
其中：基金申购款	298,684,474.08	47,735,722.08	346,420,196.16
基金赎回款	-325,956,644.60	-41,692,636.20	-367,649,280.80
本期已分配利润	-	-	-
本期末	244,745,600.03	38,153,259.41	282,898,859.44

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	578,217.54
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	73,665.17
其他	7,929.93
合计	659,812.64

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
卖出股票成交总额	5,455,110,168.44
减：卖出股票成本总额	5,386,017,961.48
减：交易费用	16,911,766.23
买卖股票差价收入	52,180,440.73

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 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。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 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。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资产生的股利收益	12,530,021.96
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	12,530,021.96

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
------	----

	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	37,278,447.76
股票投资	37,278,447.76
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	37,278,447.76

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	724,554.73
基金转换费收入	8,984.28
合计	733,539.01

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。

6.4.7.22 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	29,752.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	19,354.92
账户维护费	18,000.00
上清所 CFCA 证书服务费	600.00
合计	127,215.07

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

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 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例(%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例(%)
华宝证券	411,578,246.39	3.61	-	-

6.4.10.1.2 债券交易

无

6.4.10.1.3 债券回购交易

无

6.4.10.1.4 权证交易

无

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
华宝证券	379,186.40	3.59	379,186.40	3.90
关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
-	-	-	-	-

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 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	18,024,975.60
其中：支付销售机构的客户维护费	5,387,927.66	2,903,451.05

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 1.50% 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 × 1.50% / 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	3,004,162.68

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。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方 名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华宝动力组合混合 A	华宝动力组合混合 C	合计
华宝基金	-	634,635.55	634,635.55
华宝证券	-	5.69	5.69
合计	-	634,641.24	634,641.24
获得销售服务费的各关联方 名称	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华宝动力组合混合 A	华宝动力组合混合 C	合计
合计	-	-	-

注：销售服务费每日计提，按月支付。A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.6% 年费率计提。本基金 C 类基金份额销售服务费计提的计算方法如下： $H = E \times 0.6\% \div \text{当年天数}$ ，H 为 C 类基金份额每日应计提的基金销售服务费 E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值。

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自有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间基金管理人未运用自有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末除基金管理人外其他关联方未投资本基金。

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	170,887,537.91	578,217.54	254,927,035.72	316,267.89

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	105	2,932.65	3,468.15	-
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	1,386	16,465.68	29,133.72	-
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	-

		日									
001380	华纬科技	2023年5月9日	6个月	新股锁定	28.84	30.78	170	4,902.80	5,232.60		-
300804	广康生化	2023年6月15日	6个月	新股锁定	42.45	32.97	226	9,593.70	7,451.22		-
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		-
301170	锡南科技	2023年6月16日	6个月	新股锁定	34.00	34.93	250	8,500.00	8,732.50		-
301202	朗威股份	2023年6月28日	6个月	新股锁定	25.82	25.82	306	7,900.92	7,900.92		-
301202	朗威股份	2023年6月28日	1个月内(含)	新股流通受限	25.82	25.82	2,754	71,108.28	71,108.28		-
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		-
301210	金杨股份	2023年6月21日	6个月	新股锁定	57.88	49.17	281	16,264.28	13,816.77		-
301225	恒勃股份	2023年6月8日	6个月	新股锁定	35.66	33.26	333	11,874.78	11,075.58		-
301232	飞沃科技	2023年6月8日	6个月	新股锁定	72.50	58.42	165	11,962.50	9,639.30		-
301246	宏源药业	2023年3月10日	6个月	新股锁定	50.00	30.71	931	46,550.00	28,591.01		-
301260	格力博	2023年1月20日	6个月	新股锁定	30.85	23.63	3,121	96,282.85	73,749.23		-
301261	恒工精密	2023年6月29日	1个月内(含)	新股流通受限	36.90	36.90	1,775	65,497.50	65,497.50		-
301261	恒工	2023年	6个月	新股锁	36.90	36.90	198	7,306.20	7,306.20		-

	精密	6月29日		定							
301262	海看股份	2023年6月13日	6个月	新股锁定	30.22	25.50	692	20,912.24	17,646.00		-
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		-
301291	明阳电气	2023年6月21日	6个月	新股锁定	38.13	31.03	1,206	45,984.78	37,422.18		-
301292	海科新源	2023年6月29日	6个月	新股锁定	19.99	19.99	583	11,654.17	11,654.17		-
301292	海科新源	2023年6月29日	1个月内(含)	新股流通受限	19.99	19.99	5,241	104,767.59	104,767.59		-
301293	三博脑科	2023年4月25日	6个月	新股锁定	29.60	71.42	333	9,856.80	23,782.86		-
301303	真兰仪表	2023年2月13日	6个月	新股锁定	26.80	22.32	1,058	28,354.40	23,614.56		-
301305	朗坤环境	2023年5月15日	6个月	新股锁定	25.25	19.69	753	19,013.25	14,826.57		-
301307	美利信	2023年4月14日	6个月	新股锁定	32.34	31.86	687	22,217.58	21,887.82		-
301315	威士顿	2023年6月13日	6个月	新股锁定	32.29	51.12	226	7,297.54	11,553.12		-
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		-
301320	豪江智能	2023年6月1日	6个月	新股锁定	13.06	20.62	642	8,384.52	13,238.04		-
301322	绿通科技	2023年2月27日	6个月	新股锁定	131.11	53.24	261	34,219.71	13,895.64		-

301322	绿通科技	2023年5月25日	3个月	新股锁定-送股	-	53.24	131	-	6,974.44	-
301323	新莱福	2023年5月29日	6个月	新股锁定	39.06	39.36	228	8,905.68	8,974.08	-
301325	曼恩斯特	2023年5月4日	6个月	新股锁定	76.80	107.95	364	27,955.20	39,293.80	-
301345	涛涛车业	2023年3月10日	6个月	新股锁定	73.45	46.64	266	19,537.70	12,406.24	-
301355	南王科技	2023年6月2日	6个月	新股锁定	17.55	16.75	563	9,880.65	9,430.25	-
301357	北方长龙	2023年4月11日	6个月	新股锁定	50.00	48.39	190	9,500.00	9,194.10	-
301358	湖南裕能	2023年2月1日	6个月	新股锁定	23.77	42.89	2,023	48,086.71	86,766.47	-
301360	荣旗科技	2023年4月17日	6个月	新股锁定	71.88	92.60	134	9,631.92	12,408.40	-
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	-
301376	致欧科技	2023年6月14日	6个月	新股锁定	24.66	22.51	420	10,357.20	9,454.20	-
301382	蜂助手	2023年5月9日	6个月	新股锁定	23.80	32.84	408	9,710.40	13,398.72	-
301383	天键股份	2023年5月31日	6个月	新股锁定	46.16	35.72	493	22,756.88	17,609.96	-
301386	未来电器	2023年3月21日	6个月	新股锁定	29.99	23.79	378	11,336.22	8,992.62	-
301387	光大同创	2023年4月10日	6个月	新股锁定	58.32	45.36	307	17,904.24	13,925.52	-
301395	仁信新材	2023年6月21日	1个月内(含)	新股流通受限	26.68	26.68	4,676	124,755.68	124,755.68	-

		日									
301395	仁信新材	2023年6月21日	6个月	新股锁定	26.68	26.68	520	13,873.60	13,873.60		-
301419	阿莱德	2023年2月2日	6个月	新股锁定	24.80	43.85	330	8,184.00	14,470.50		-
301428	世纪恒通	2023年5月10日	6个月	新股锁定	26.35	30.60	229	6,034.15	7,007.40		-
301429	森泰股份	2023年4月10日	6个月	新股锁定	28.75	21.02	499	14,346.25	10,488.98		-
301439	泓淋电力	2023年3月10日	6个月	新股锁定	19.99	16.90	949	18,970.51	16,038.10		-
601061	中信金属	2023年3月30日	6个月	新股锁定	6.58	7.58	4,016	26,425.28	30,441.28		-
601065	江盐集团	2023年3月31日	6个月	新股锁定	10.36	11.84	875	9,065.00	10,360.00		-
601133	柏诚股份	2023年3月31日	6个月	新股锁定	11.66	12.26	664	7,742.24	8,140.64		-
603125	常青科技	2023年3月30日	6个月	新股锁定	25.98	24.53	160	4,156.80	3,924.80		-
603135	中重科技	2023年3月29日	6个月	新股锁定	17.80	17.89	628	11,178.40	11,234.92		-
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	1,011	36,547.65	38,549.43		-
688249	晶合集成	2023年4月24日	6个月	新股锁定	19.86	18.06	7,405	147,063.30	133,734.30		-
688334	西高	2023年	6个月	新股锁	14.16	16.21	888	12,574.08	14,394.48		-

	院	6月9日		定							
688352	颀中科技	2023年4月11日	6个月	新股锁定	12.10	12.07	2,361	28,568.10	28,497.27		-
688361	中科飞测	2023年5月12日	6个月	新股锁定	23.60	64.67	831	19,611.60	53,740.77		-
688429	时创能源	2023年6月20日	6个月	新股锁定	19.20	25.53	346	6,643.20	8,833.38		-
688433	华曙高科	2023年4月7日	6个月	新股锁定	26.66	31.50	418	11,143.88	13,167.00		-
688443	智翔金泰	2023年6月13日	6个月	新股锁定	37.88	29.49	3,033	114,890.04	89,443.17		-
688458	美芯晟	2023年5月15日	6个月	新股锁定	75.00	90.76	221	16,575.00	20,057.96		-
688469	中芯集成	2023年4月28日	6个月	新股锁定	5.69	5.41	13,800	78,522.00	74,658.00		-
688472	阿特斯	2023年6月2日	6个月	新股锁定	11.10	17.04	6,261	69,497.10	106,687.44		-
688478	晶升股份	2023年4月13日	6个月	新股锁定	32.52	42.37	402	13,073.04	17,032.74		-
688479	友车科技	2023年5月4日	6个月	新股锁定	33.99	29.49	332	11,284.68	9,790.68		-
688484	南芯科技	2023年3月28日	6个月	新股锁定	39.99	36.71	1,008	40,309.92	37,003.68		-
688507	索辰科技	2023年4月10日	6个月	新股锁定	245.56	122.11	150	36,834.00	18,316.50		-
688507	索辰科技	2023年6月20日	3个月	新股锁定-送股	-	122.11	72	-	8,791.92		-
688512	慧智微	2023年5月8日	6个月	新股锁定	20.92	19.16	721	15,083.32	13,814.36		-

688523	航天环宇	2023年5月26日	6个月	新股锁定	21.86	23.85	472	10,317.92	11,257.20	-
688531	日联科技	2023年3月24日	6个月	新股锁定	152.38	135.97	346	52,723.48	47,045.62	-
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	410	17,904.70	21,750.50	-
688552	航天南湖	2023年5月8日	6个月	新股锁定	21.17	23.50	956	20,238.52	22,466.00	-
688562	航天软件	2023年5月15日	6个月	新股锁定	12.68	22.31	726	9,205.68	16,197.06	-
688581	安杰思	2023年5月12日	6个月	新股锁定	125.80	118.03	163	20,505.40	19,238.89	-
688582	芯动联科	2023年6月21日	6个月	新股锁定	26.74	40.68	648	17,327.52	26,360.64	-
688620	安凯微	2023年6月15日	6个月	新股锁定	10.68	12.34	1,016	10,850.88	12,537.44	-
688623	双元科技	2023年5月31日	6个月	新股锁定	125.88	86.79	178	22,406.64	15,448.62	-
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	336	8,494.08	10,036.32	-

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)。

6.4.13.3 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，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。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金和存出保证金等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	170,887,537.91	-	-	-	170,887,537.91
结算备付金	8,195,081.07	-	-	-	8,195,081.07
存出保证金	1,007,316.21	-	-	-	1,007,316.21
交易性金融资产	-	-	-2,331,738,838.29	-	2,331,738,838.29
应收申购款	-	-	-	3,183,981.36	3,183,981.36
应收清算款	-	-	-	18,558,094.16	18,558,094.16
资产总计	180,089,935.19	-	-2,353,480,913.81	-	2,533,570,849.00
负债					
应付赎回款	-	-	-	26,680,495.35	26,680,495.35
应付管理人报酬	-	-	-	3,225,357.42	3,225,357.42
应付托管费	-	-	-	537,559.58	537,559.58
应付清算款	-	-	-	9,425,323.30	9,425,323.30
应付销售服务费	-	-	-	253,055.49	253,055.49
其他负债	-	-	-	9,948,674.45	9,948,674.45
负债总计	-	-	-	50,070,465.59	50,070,465.59
利率敏感度缺口	180,089,935.19	-	-2,303,410,448.22	-	2,483,500,383.41
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	441,505,185.27	-	-	-	441,505,185.27
结算备付金	7,228,911.06	-	-	-	7,228,911.06
存出保证金	890,410.39	-	-	-	890,410.39
交易性金融资产	-	-	-	-1,702,533,500.41	1,702,533,500.41
应收申购款	-	-	-	3,422,769.16	3,422,769.16
资产总计	449,624,506.72	-	-	-1,705,956,269.57	2,155,580,776.29
负债					
应付赎回款	-	-	-	2,015,794.06	2,015,794.06
应付管理人报酬	-	-	-	2,309,155.08	2,309,155.08
应付托管费	-	-	-	384,859.17	384,859.17
应付清算款	-	-	-	99,325,260.10	99,325,260.10
应付销售服务费	-	-	-	144,368.64	144,368.64
其他负债	-	-	-	8,326,115.48	8,326,115.48
负债总计	-	-	-	112,505,552.53	112,505,552.53
利率敏感度缺口	449,624,506.72	-	-	-1,593,450,717.04	2,043,075,223.76

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

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。

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 60%-95%，债券占 0%-40%；现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在一年内的政府债券比例在 5%以上。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	2,331,738,838.29	93.89	1,702,533,500.41	83.33
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	2,331,738,838.29	93.89	1,702,533,500.41	83.33

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%	126,301,228.88	100,180,701.32
2. 业绩比较基准下降 5%	-126,301,228.88	-100,180,701.32	

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	2,329,579,163.75	1,701,171,244.24
第二层次	406,863.94	-
第三层次	1,752,810.60	1,362,256.17
合计	2,331,738,838.29	1,702,533,500.41

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	2,331,738,838.29	92.03
	其中：股票	2,331,738,838.29	92.03
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-

5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	179,082,618.98	7.07
8	其他各项资产	22,749,391.73	0.90
9	合计	2,533,570,849.00	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,660,223,351.33	66.85
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	35,447.47	0.00
E	建筑业	10,516.15	0.00
F	批发和零售业	69,029.20	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	671,339,750.23	27.03
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	14,394.48	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	22,566.57	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	23,782.86	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	2,331,738,838.29	93.89

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	300502	新易盛	1,849,900	125,737,703.00	5.06
2	300308	中际旭创	790,100	116,500,245.00	4.69
3	002555	三七互娱	3,085,200	107,611,776.00	4.33
4	002558	巨人网络	3,217,943	57,697,717.99	2.32
5	688498	源杰科技	201,512	57,430,920.00	2.31
6	300314	戴维医疗	2,686,700	56,796,838.00	2.29
7	300638	广和通	2,451,726	55,605,145.68	2.24
8	600079	人福医药	2,057,600	55,431,744.00	2.23
9	603258	电魂网络	1,296,000	55,092,960.00	2.22
10	688205	德科立	744,225	54,417,732.00	2.19
11	688668	鼎通科技	552,900	54,073,620.00	2.18
12	002402	和而泰	3,175,500	53,919,990.00	2.17
13	002463	沪电股份	2,522,818	52,827,808.92	2.13
14	300820	英杰电气	624,675	51,460,726.50	2.07
15	688008	澜起科技	870,119	49,962,232.98	2.01
16	002436	兴森科技	3,198,600	49,578,300.00	2.00
17	688111	金山办公	99,800	47,127,556.00	1.90
18	300604	长川科技	986,941	46,869,828.09	1.89
19	300260	新莱应材	1,175,870	46,470,382.40	1.87
20	002475	立讯精密	1,419,300	46,056,285.00	1.85
21	002517	恺英网络	2,883,400	45,384,716.00	1.83
22	603444	吉比特	88,900	43,659,679.00	1.76
23	002919	名臣健康	962,080	43,389,808.00	1.75
24	002624	完美世界	2,502,640	42,269,589.60	1.70
25	688052	纳芯微	265,422	42,034,882.14	1.69
26	605186	健麾信息	816,000	40,392,000.00	1.63
27	300613	富瀚微	704,880	39,994,891.20	1.61
28	688601	力芯微	842,966	39,703,698.60	1.60
29	300031	宝通科技	1,581,500	39,094,680.00	1.57
30	002881	美格智能	1,073,566	36,662,278.90	1.48
31	002273	水晶光电	2,937,200	35,070,168.00	1.41
32	300496	中科创达	362,700	34,946,145.00	1.41
33	002174	游族网络	2,031,969	34,137,079.20	1.37
34	002602	世纪华通	4,448,240	33,762,141.60	1.36
35	688301	奕瑞科技	119,320	33,699,547.60	1.36
36	000063	中兴通讯	734,700	33,458,238.00	1.35
37	688332	中科蓝讯	388,265	32,490,015.20	1.31
38	688025	杰普特	364,221	31,814,704.35	1.28
39	688376	美埃科技	805,502	31,809,273.98	1.28
40	688037	芯源微	180,733	30,896,306.35	1.24

41	300476	胜宏科技	1,250,000	30,137,500.00	1.21
42	688141	杰华特	708,520	27,703,132.00	1.12
43	688212	澳华内镜	352,045	23,903,855.50	0.96
44	688458	美芯晟	237,343	22,824,080.70	0.92
45	300757	罗博特科	248,400	21,861,684.00	0.88
46	688103	国力股份	357,932	21,443,706.12	0.86
47	688120	华海清科	78,217	19,714,594.85	0.79
48	300770	新媒股份	380,300	17,440,558.00	0.70
49	688372	伟测科技	112,712	17,261,842.80	0.70
50	002876	三利谱	514,320	17,059,994.40	0.69
51	688766	普冉股份	158,021	16,879,803.22	0.68
52	688368	晶丰明源	129,518	16,475,984.78	0.66
53	000021	深科技	772,500	15,442,275.00	0.62
54	300661	圣邦股份	175,012	14,373,735.56	0.58
55	600519	贵州茅台	8,400	14,204,400.00	0.57
56	688687	凯因科技	438,365	12,931,767.50	0.52
57	301312	智立方	120,300	12,771,048.00	0.51
58	002605	姚记科技	224,200	10,409,606.00	0.42
59	002387	维信诺	799,700	7,333,249.00	0.30
60	300559	佳发教育	247,700	4,087,050.00	0.16
61	301395	仁信新材	5,196	138,629.28	0.01
62	688249	晶合集成	7,405	133,734.30	0.01
63	301292	海科新源	5,824	116,421.76	0.00
64	688472	阿特斯	6,261	106,687.44	0.00
65	688443	智翔金泰	3,033	89,443.17	0.00
66	301358	湖南裕能	2,023	86,766.47	0.00
67	301202	朗威股份	3,060	79,009.20	0.00
68	688469	中芯集成	13,800	74,658.00	0.00
69	301260	格力博	3,121	73,749.23	0.00
70	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	0.00
71	688361	中科飞测	831	53,740.77	0.00
72	688531	日联科技	346	47,045.62	0.00
73	301325	曼恩斯特	364	39,293.80	0.00
74	688146	中船特气	1,011	38,549.43	0.00
75	301291	明阳电气	1,206	37,422.18	0.00
76	688484	南芯科技	1,008	37,003.68	0.00
77	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.00
78	601061	中信金属	4,016	30,441.28	0.00
79	001287	中电港	1,386	29,133.72	0.00
80	301246	宏源药业	931	28,591.01	0.00
81	688352	颀中科技	2,361	28,497.27	0.00
82	688507	索辰科技	222	27,108.42	0.00
83	688582	芯动联科	648	26,360.64	0.00

84	301293	三博脑科	333	23,782.86	0.00
85	301303	真兰仪表	1,058	23,614.56	0.00
86	688552	航天南湖	956	22,466.00	0.00
87	301307	美利信	687	21,887.82	0.00
88	688543	国科军工	410	21,750.50	0.00
89	301322	绿通科技	392	20,870.08	0.00
90	688581	安杰思	163	19,238.89	0.00
91	301317	鑫磊股份	694	18,161.98	0.00
92	301262	海看股份	692	17,646.00	0.00
93	301383	天键股份	493	17,609.96	0.00
94	688478	晶升股份	402	17,032.74	0.00
95	688562	航天软件	726	16,197.06	0.00
96	301439	泓淋电力	949	16,038.10	0.00
97	688623	二元科技	178	15,448.62	0.00
98	301305	朗坤环境	753	14,826.57	0.00
99	301419	阿莱德	330	14,470.50	0.00
100	688334	西高院	888	14,394.48	0.00
101	301387	光大同创	307	13,925.52	0.00
102	301210	金杨股份	281	13,816.77	0.00
103	688512	慧智微	721	13,814.36	0.00
104	301382	蜂助手	408	13,398.72	0.00
105	301320	豪江智能	642	13,238.04	0.00
106	688433	华曙高科	418	13,167.00	0.00
107	688629	华丰科技	708	13,161.72	0.00
108	688620	安凯微	1,016	12,537.44	0.00
109	301360	荣旗科技	134	12,408.40	0.00
110	301345	涛涛车业	266	12,406.24	0.00
111	301315	威士顿	226	11,553.12	0.00
112	688523	航天环宇	472	11,257.20	0.00
113	603135	中重科技	628	11,234.92	0.00
114	301141	中科磁业	262	11,184.78	0.00
115	301225	恒勃股份	333	11,075.58	0.00
116	301429	森泰股份	499	10,488.98	0.00
117	601065	江盐集团	875	10,360.00	0.00
118	688631	莱斯信息	336	10,036.32	0.00
119	688479	友车科技	332	9,790.68	0.00
120	301232	飞沃科技	165	9,639.30	0.00
121	301376	致欧科技	420	9,454.20	0.00
122	301355	南王科技	563	9,430.25	0.00
123	301357	北方长龙	190	9,194.10	0.00
124	301386	未来电器	378	8,992.62	0.00
125	301323	新莱福	228	8,974.08	0.00
126	688429	时创能源	346	8,833.38	0.00

127	301373	凌玮科技	277	8,822.45	0.00
128	301170	锡南科技	250	8,732.50	0.00
129	301281	科源制药	338	8,483.80	0.00
130	688535	华海诚科	161	8,248.03	0.00
131	601133	柏诚股份	664	8,140.64	0.00
132	301157	华塑科技	150	7,939.50	0.00
133	301203	国泰环保	225	7,740.00	0.00
134	300804	广康生化	226	7,451.22	0.00
135	301428	世纪恒通	229	7,007.40	0.00
136	001380	华纬科技	170	5,232.60	0.00
137	603125	常青科技	160	3,924.80	0.00
138	001328	登康口腔	145	3,696.05	0.00
139	001282	三联锻造	105	3,468.15	0.00
140	001360	南矿集团	177	2,631.99	0.00
141	603137	恒尚节能	139	2,375.51	0.00
142	001324	长青科技	114	2,234.40	0.00
143	001367	海森药业	55	2,171.40	0.00
144	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	002555	三七互娱	306,655,216.53	15.01
2	002517	恺英网络	149,262,771.46	7.31
3	002624	完美世界	146,723,510.15	7.18
4	300502	新易盛	133,388,414.23	6.53
5	002463	沪电股份	111,235,523.10	5.44
6	300308	中际旭创	105,614,849.13	5.17
7	300638	广和通	104,288,996.16	5.10
8	002878	元隆雅图	100,820,741.73	4.93
9	002558	巨人网络	98,207,226.85	4.81
10	605168	三人行	97,866,195.51	4.79
11	600519	贵州茅台	92,851,414.00	4.54
12	603444	吉比特	89,804,563.50	4.40
13	002436	兴森科技	85,098,765.08	4.17
14	002174	游族网络	79,401,345.38	3.89
15	300820	英杰电气	68,358,255.46	3.35
16	002475	立讯精密	68,031,042.84	3.33
17	300413	芒果超媒	66,801,385.48	3.27
18	603258	电魂网络	66,119,211.00	3.24
19	000063	中兴通讯	64,725,837.00	3.17
20	688037	芯源微	60,998,538.34	2.99

21	688498	源杰科技	58,476,693.53	2.86
22	002402	和而泰	57,668,401.89	2.82
23	601377	兴业证券	57,355,577.00	2.81
24	600809	山西汾酒	57,015,260.00	2.79
25	688008	澜起科技	56,902,825.03	2.79
26	688052	纳芯微	56,179,989.95	2.75
27	688205	德科立	55,012,415.83	2.69
28	600079	人福医药	54,947,685.98	2.69
29	600958	东方证券	53,125,680.00	2.60
30	003043	华亚智能	52,476,170.10	2.57
31	688025	杰普特	52,174,340.52	2.55
32	300613	富瀚微	50,879,372.69	2.49
33	301367	怡和嘉业	50,771,605.53	2.49
34	300661	圣邦股份	50,008,378.50	2.45
35	688332	中科蓝讯	49,777,771.69	2.44
36	300260	新莱应材	49,538,749.82	2.42
37	688668	鼎通科技	48,865,535.20	2.39
38	300314	戴维医疗	48,036,552.56	2.35
39	300770	新媒股份	47,655,223.76	2.33
40	300604	长川科技	47,590,275.43	2.33
41	002939	长城证券	46,687,770.34	2.29
42	603986	兆易创新	46,404,770.06	2.27
43	000799	酒鬼酒	45,423,386.00	2.22
44	688601	力芯微	45,316,197.90	2.22
45	605186	健麾信息	45,297,422.00	2.22
46	300031	宝通科技	44,835,624.00	2.19
47	688268	华特气体	44,827,664.94	2.19
48	688111	金山办公	44,805,131.01	2.19
49	600872	中炬高新	43,695,456.43	2.14
50	003000	劲仔食品	42,762,516.00	2.09
51	688235	百济神州	42,390,478.85	2.07
52	688141	杰华特	41,858,988.25	2.05

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	002555	三七互娱	243,089,952.63	11.90
2	600519	贵州茅台	142,840,873.00	6.99
3	600048	保利发展	125,781,250.36	6.16
4	002517	恺英网络	118,256,745.80	5.79
5	002878	元隆雅图	115,391,738.00	5.65
6	002624	完美世界	110,350,580.57	5.40

7	601318	中国平安	108,508,204.04	5.31
8	605168	三人行	102,349,976.64	5.01
9	600036	招商银行	89,427,879.97	4.38
10	000858	五粮液	84,863,302.28	4.15
11	300413	芒果超媒	73,842,952.20	3.61
12	002475	立讯精密	67,476,823.00	3.30
13	002463	沪电股份	66,018,225.34	3.23
14	300638	广和通	56,190,991.42	2.75
15	601377	兴业证券	55,420,312.90	2.71
16	603885	吉祥航空	52,308,278.64	2.56
17	688697	纽威数控	52,070,060.98	2.55
18	600958	东方证券	49,138,624.96	2.41
19	601166	兴业银行	48,210,763.61	2.36
20	002223	鱼跃医疗	46,796,496.50	2.29
21	600809	山西汾酒	46,212,036.12	2.26
22	003043	华亚智能	45,998,900.12	2.25
23	603517	绝味食品	45,882,825.70	2.25
24	688268	华特气体	45,810,350.32	2.24
25	002271	东方雨虹	45,519,510.00	2.23
26	300737	科顺股份	44,924,516.50	2.20
27	301367	怡和嘉业	44,540,389.94	2.18
28	000568	泸州老窖	44,175,135.91	2.16
29	002939	长城证券	43,549,858.00	2.13
30	002558	巨人网络	43,369,387.00	2.12
31	000063	中兴通讯	43,179,013.28	2.11
32	603444	吉比特	43,005,678.10	2.10
33	002020	京新药业	42,487,224.92	2.08
34	600566	济川药业	42,347,034.94	2.07
35	603369	今世缘	41,974,644.00	2.05
36	603986	兆易创新	41,734,720.53	2.04
37	601021	春秋航空	41,721,983.08	2.04
38	300003	乐普医疗	41,695,373.73	2.04
39	600867	通化东宝	41,638,461.40	2.04
40	600233	圆通速递	41,112,730.00	2.01
41	603893	瑞芯微	40,861,786.00	2.00

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	5,977,944,851.60
卖出股票收入（成交）总额	5,455,110,168.44

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

本基金本报告期末未持有债券投资。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券投资。

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

本基金未投资股指期货。

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

华宝动力组合混合截止 2023 年 06 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中,人福医药集团股份有限公司因资金占用,违规经营,未依法履行职责,信息披露不及时,未按规定披露定期报告,违规超比例增/减持,违规提供担保及财务资助;于 2023 年 02 月 01 日收到上海证券交易所公开谴责的处罚措施。

华宝动力组合混合截止 2023 年 06 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中,三七互娱网络科技集团股份有限公司因重大事项信息披露不及时或违规;于 2023 年 06 月 28 日收到证监会立案调查的处罚措施。

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	1,007,316.21
2	应收清算款	18,558,094.16
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	3,183,981.36
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	22,749,391.73

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

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基 金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份 额比例 (%)	持有份额	占总 份额 比例 (%)
华宝动力 组合混合 A	67,589	9,722.23	198,977,764.96	30.28	458,138,229.15	69.72
华宝动力 组合混合 C	20,134	6,597.35	110,589,333.88	83.26	22,241,773.29	16.74
合计	87,723	9,005.02	309,567,098.84	39.19	480,380,002.44	60.81

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	华宝动力组合混合 A	425,042.46	0.0647
	华宝动力组合混合 C	3,832.92	0.0029
	合计	428,875.38	0.0543

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	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	华宝动力组合混合 A	0
	华宝动力组合混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	华宝动力组合混合 A	0
	华宝动力组合混合 C	0
	合计	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华宝动力组合混合 A	华宝动力组合混合 C
基金合同生效日 （2005 年 11 月 17 日）基金份额总额	535,410,310.23	-
本报告期期初基金份 额总额	534,967,348.72	144,772,381.18
本报告期基金总申购 份额	286,853,910.54	159,213,090.17
减：本报告期基金总 赎回份额	164,705,265.15	171,154,364.18
本报告期基金拆分变 动份额	-	-
本报告期期末基金份 额总额	657,115,994.11	132,831,107.17

§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：本基金合同生效之日起至本报告期末。

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	2,001,012,219.29	17.53	1,843,532.88	17.47	-
方正证券	1	1,332,825,154.01	11.68	1,227,910.70	11.63	-
东方财富	2	1,067,341,359.69	9.35	985,594.16	9.34	-
中信建投	2	878,023,845.18	7.69	816,384.31	7.73	-
中金国际	2	812,761,972.09	7.12	748,796.78	7.09	-

财通证券	3	615,965,349. 20	5.40	571,964.96	5.42	-
东亚前海 证券	1	600,595,310. 14	5.26	559,331.99	5.30	-
东方证券	1	570,213,597. 70	5.00	525,337.08	4.98	-
国泰君安	1	457,969,535. 75	4.01	426,516.40	4.04	-
浙商证券	2	422,557,801. 86	3.70	389,301.92	3.69	-
华泰证券	2	414,312,455. 15	3.63	384,950.55	3.65	-
华宝证券	1	411,578,246. 39	3.61	379,186.40	3.59	-
开源证券	2	320,567,885. 20	2.81	297,689.97	2.82	-
国联证券	3	235,903,580. 95	2.07	219,699.49	2.08	-
海通证券	2	218,247,816. 01	1.91	202,263.15	1.92	-
东海证券	2	206,761,908. 52	1.81	192,345.09	1.82	-
天风证券	3	188,459,361. 60	1.65	175,514.71	1.66	-
申万宏源	3	175,968,059. 38	1.54	162,120.08	1.54	-
上海证券	2	124,737,697. 59	1.09	116,171.60	1.10	-
光大证券	2	97,201,736.5 3	0.85	90,526.81	0.86	-
江海证券	2	81,333,761.5 5	0.71	74,932.93	0.71	-
国元证券	2	76,263,024.5 0	0.67	70,261.58	0.67	-
东吴证券	2	59,108,693.3 8	0.52	54,455.73	0.52	-
第一创业	1	27,807,323.1 2	0.24	25,896.92	0.25	-
华金证券	1	15,747,378.6 2	0.14	14,665.45	0.14	-
德邦证券	1	170,498.11	0.00	157.04	0.00	-
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	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
国海证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
宏信证券	2	-	-	-	-	-
华安证券	2	-	-	-	-	-
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	债券交易	债券回购交易	权证交易
-----	------	--------	------

称	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	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	700,000,000.00	45.16	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	200,000,000.00	12.90	-	-
中金国际	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
东亚前海证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	550,000,000.00	35.48	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	100,000,000.00	6.45	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-

江海证 券	-	-	-	-	-	-
国元证 券	-	-	-	-	-	-
东吴证 券	-	-	-	-	-	-
第一创 业	-	-	-	-	-	-
华金证 券	-	-	-	-	-	-
德邦证 券	-	-	-	-	-	-
安信证 券	-	-	-	-	-	-
长城证 券	-	-	-	-	-	-
长江证 券	-	-	-	-	-	-
诚通证 券	-	-	-	-	-	-
大和证 券	-	-	-	-	-	-
东北证 券	-	-	-	-	-	-
国海证 券	-	-	-	-	-	-
国金证 券	-	-	-	-	-	-
国信证 券	-	-	-	-	-	-
宏信证 券	-	-	-	-	-	-
华安证 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	华宝基金关于华宝动力组合混合型证券投资基金 C 类新增国元证券股份有限公司为代销机构的公告	基金管理人网站, 证券时报	2023-01-09
2	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
3	华宝基金关于旗下部分基金新增兴业银行(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	2023-01-10
4	华宝动力组合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
5	华宝基金关于华宝动力组合混合型证券投资基金 C 类新增西南证券股份有限公司为代销机构的公告	基金管理人网站, 证券时报	2023-02-06
6	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
7	华宝基金关于旗下部分基金新增海通证券股份有限公司为代销机构的公告	基金管理人网站, 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2023-02-27
8	华宝基金关于华宝动力组合混合型证券投资基金 C 类新增中国中金财富证券有限公司为代销机构的公告	基金管理人网站, 证券时报	2023-02-28
9	华宝基金关于旗下部分基金新增杭州	基金管理人网站, 上海	2023-03-17

	银行股份有限公司为代销机构的公告	证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	
10	华宝动力组合混合型证券投资基金 2022 年年度报告	基金管理人网站	2023-03-31
11	华宝基金关于旗下部分基金新增兴业证券股份有限公司为代销机构的公告	基金管理人网站, 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2023-04-14
12	华宝基金关于旗下部分基金新增中邮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	2023-04-17
13	关于华宝现金宝货币基金 E 类份额转换、赎回转申购、定期转换、定期赎回转申购业务费率优惠公告	基金管理人网站, 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2023-04-18
14	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
15	华宝动力组合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
16	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
17	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
18	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
19	华宝动力组合混合型证券投资基金(A类份额)基金产品资料概要(更新)	基金管理人网站	2023-06-06
20	华宝动力组合混合型证券投资基金(C类份额)基金产品资料概要(更新)	基金管理人网站	2023-06-06
21	华宝动力组合混合型证券投资基金招募说明书(更新)	基金管理人网站	2023-06-06

§ 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

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

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；
华宝动力组合混合型证券投资基金基金合同；
华宝动力组合混合型证券投资基金招募说明书；
华宝动力组合混合型证券投资基金托管协议；
基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
基金管理人报告期内在指定报刊上披露的各种公告；
基金托管人业务资格批件和营业执照。

12.2 存放地点

以上文件存于基金管理人及基金托管人住所备投资者查阅。

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