

华宝安盈混合型证券投资基金

2024 年第 2 季度报告

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

报告送出日期：2024 年 7 月 19 日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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 07 月 17 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 04 月 01 日起至 06 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华宝安盈混合
基金主代码	010868
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021 年 6 月 8 日
报告期末基金份额总额	240,208,130.85 份
投资目标	在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，通过积极主动的管理，追求基金资产的长期稳定回报。
投资策略	本基金采取积极的大类资产配置策略，通过宏观策略研究，综合考虑宏观经济、国家财政政策、货币政策、产业政策、以及市场流动性等方面因素，对相关资产类别的预期收益进行动态跟踪，决定大类资产配置比例。本基金采取积极的股票选择策略，将“自上而下”的行业配置策略和“自下而上”的股票精选策略相结合，根据对宏观经济和市场风险特征变化的判断，进行投资组合的动态优化，实现基金资产长期稳定增值。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*18%+中证综合债指数收益率*80%+恒生指数收益率*2%
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。本基金可通过港股通机制投资港股通标的股票，还可能面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2024 年 4 月 1 日-2024 年 6 月 30 日）
1. 本期已实现收益	315,770.32
2. 本期利润	-1,928,812.28
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0073
4. 期末基金资产净值	238,913,426.68
5. 期末基金份额净值	0.9946

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。

3.2 基金净值表现

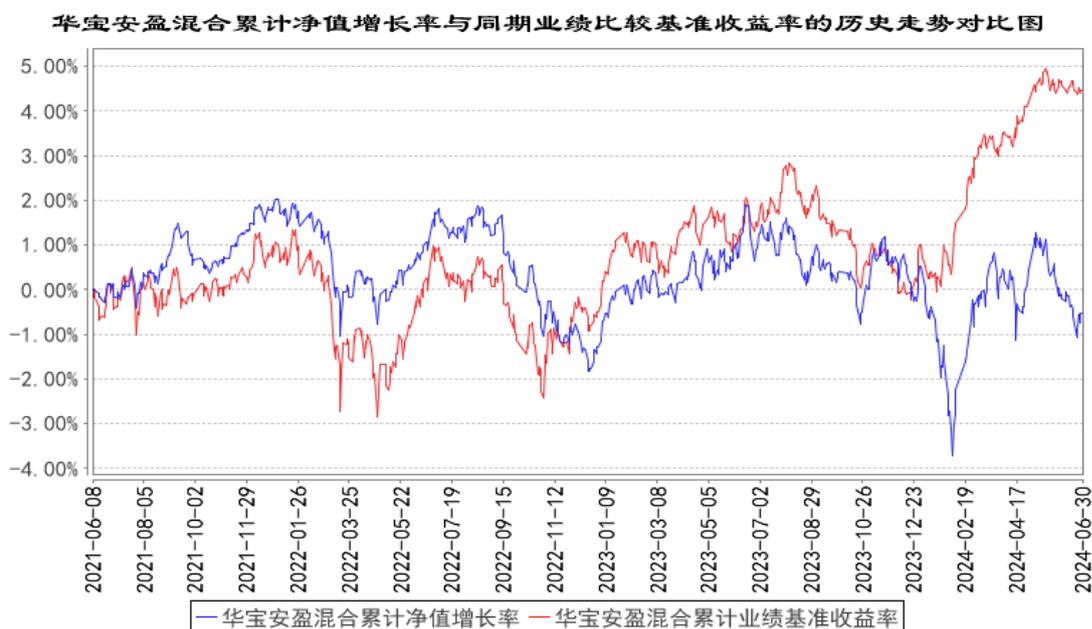
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率 ①	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
过去三个月	-0.81%	0.26%	1.19%	0.14%	-2.00%	0.12%
过去六个月	-1.05%	0.30%	3.44%	0.17%	-4.49%	0.13%
过去一年	-1.78%	0.25%	2.84%	0.17%	-4.62%	0.08%
过去三年	-0.64%	0.20%	4.41%	0.21%	-5.05%	-0.01%
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同 生效起至今	-0.54%	0.20%	4.47%	0.21%	-5.01%	-0.01%

注：（1）基金业绩基准：沪深 300 指数收益率*18%+中证综合债指数收益率*80%+恒生指数收益率*2%；

（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累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：按照基金合同的约定，基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定，截至 2021 年 12 月 08 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 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
曾健飞	本基金基金经理	2023-03-04	-	10 年	硕士。曾任前海开源基金管理有限公司研究员、基金经理，2022 年 8 月加入华宝基金管理有限公司任高级产品经理。2023 年 3 月起任华宝安盈混合型证券投资基金、华宝新活力灵活配置混合型证券投资基金、华宝增强收益债券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。

4.1.1 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》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》及其各项实施细则、《华宝安盈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 公平交易专项说明

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 报告期内基金的投资策略和运作分析

国内经济回升势头略有放缓，制造业 PMI 未能保持在荣枯线以上，消费偏弱在延续。货币政策保持流动性稳健宽松，而因挤水分等因素导致社融走弱。一线城市集中出台一系列政策，更大力度放开房地产限购限贷后，二手房销售明显回升，带动一手房销售企稳。若销量持续，不排除一二线城市下半年房市企稳的可能性，则地产对经济的拖累将明显减少。

权益市场在二季度震荡下跌，沪深 300 指数跌幅 2.14%。债市震荡走牛，10 年期国债收益率曲线从上季末的 2.29% 下行超 8 个基点至 2.2058%。受股债综合影响，转债震荡，中证转债指数微涨 0.75%。

本基金优化持仓结构，维持哑铃策略。债券部分适当通过利率债波段操作增厚收益。力争在控制回撤的前提下提供稳健的收益。

4.5 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-0.81%，业绩比较基准收益率为 1.19%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	28,452,659.01	11.77
	其中：股票	28,452,659.01	11.77
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	173,935,107.46	71.98
	其中：债券	173,935,107.46	71.98
	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	38,546,213.66	15.95
8	其他资产	706,964.78	0.29
9	合计	241,640,944.91	100.00

注：1、通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 1,411,897.70 元，占基金资产净值的比例为 0.59%。

2、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）。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	3,162,218.00	1.32
C	制造业	21,799,252.31	9.12

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,079,291.00	0.87
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
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	-	-
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	-	-
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	27,040,761.31	11.32

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
通讯	-	-
科技	-	-
公用事业	373,614.68	0.16
非必须消费品	-	-
必须消费品	-	-
能源	449,768.70	0.19
金融	-	-
房地产	-	-
医疗保健	-	-
工业	243,110.57	0.10
材料	345,403.75	0.14
合计	1,411,897.70	0.59

注：本基金对以上行业分类采用彭博行业分类标准。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	301188	力诺特玻	244,800	3,566,736.00	1.49
2	300856	科思股份	59,200	1,894,992.00	0.79
3	600938	中国海油	26,100	861,300.00	0.36
3	00883	中国海洋石油	22,000	449,768.70	0.19

4	002463	沪电股份	29,100	1,062,150.00	0.44
5	300394	天孚通信	12,000	1,061,040.00	0.44
6	605077	华康股份	68,120	1,038,830.00	0.43
7	002532	天山铝业	123,700	1,003,207.00	0.42
8	600988	赤峰黄金	56,000	915,040.00	0.38
9	688301	奕瑞科技	7,006	807,301.38	0.34
10	002851	麦格米特	29,800	770,032.00	0.32

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	93,647,564.24	39.20
2	央行票据	-	-
3	金融债券	40,928,291.51	17.13
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	20,618,000.00	8.63
7	可转债（可交换债）	18,741,251.71	7.84
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	173,935,107.46	72.80

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	230023	23 付息国债 23	700,000	78,883,803.28	33.02
2	102101748	21 贵州高速 MTN007	200,000	20,618,000.00	8.63
3	188418	21 兴业 03	200,000	20,485,986.85	8.57
4	019727	23 国债 24	145,000	14,763,760.96	6.18
5	188571	21 海通 07	100,000	10,224,884.93	4.28

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资 明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量 (买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动 (元)	风险说明
IC2409	IC2409	-2	-1,950,080.00	21,220.00	-
IM2409	IM2409	-2	-1,912,080.00	25,040.00	-
公允价值变动总额合计 (元)					46,260.00
股指期货投资本期收益 (元)					-69,955.49
股指期货投资本期公允价值变动 (元)					43,160.00

注：持仓量和合约市值的负数代表产品投资的期货为空头。

5.9.2 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。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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金未投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金未投资国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

华宝安盈混合截止 2024 年 06 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中，中信证券股份有限公司因存在机房基础设施建设安全性不足，信息系统设备可靠性管理疏漏等问题；于 2023 年 07 月 07 日收到深圳证监局警示的处罚措施。

华宝安盈混合截止 2024 年 06 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中，海通证券股份有限公司因信息披露不合格；于 2023 年 07 月 15 日收到上海证券交易所监管工作函的处罚措施。

华宝安盈混合截止 2024 年 06 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中, 兴业证券股份有限公司因违规经营, 内部制度不完善; 于 2023 年 08 月 03 日收到福建证监局警示的处罚措施。

华宝安盈混合截止 2024 年 06 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中, 中信证券股份有限公司因内部制度不完善; 于 2023 年 09 月 22 日收到证监会监管谈话、谈话提醒的处罚措施。

华宝安盈混合截止 2024 年 06 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中, 中信证券股份有限公司因存在机房基础设施建设安全性不足, 信息系统设备可靠性管理疏漏等问题; 于 2023 年 09 月 22 日收到深圳证券交易所警示的处罚措施。

华宝安盈混合截止 2024 年 06 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中, 中信证券股份有限公司因存在机房基础设施建设安全性不足, 信息系统设备可靠性管理疏漏等问题, 导致 2023 年 6 月 19 日集中交易系统出现异常, 部分客户交易受到影响; 上述行为违反了《证券期货业网络和信息安全管理办法》(证监会令第 218 号, 以下简称《网络和信息安全管理办法》) 第十三条相关规定; 于 2023 年 09 月 25 日收到深圳证券交易所警示的处罚措施。

华宝安盈混合截止 2024 年 06 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中, 海通证券股份有限公司因未履行信披义务, 重大事项信息披露不及时或违规; 于 2023 年 11 月 17 日收到湖北证监局警示, 记入诚信档案的处罚措施。

华宝安盈混合截止 2024 年 06 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中, 海通证券股份有限公司因未依法履行职责; 于 2024 年 01 月 05 日收到深圳证券交易所警示的处罚措施。

华宝安盈混合截止 2024 年 06 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中, 中信证券股份有限公司因保荐的恒逸石化股份有限公司(发行人)可转债项目, 发行人证券发行上市当年即亏损、营业利润比上年下滑 50%以上; 于 2024 年 01 月 12 日收到证监会警示的处罚措施。

华宝安盈混合截止 2024 年 06 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中, 海通证券股份有限公司因: 1. 对境外子公司合规管理和风险管理不到位, 未健全覆盖境外子公司的风险指标体系; 未督促境外子公司有效处置风险指标超限额的情形; 未按规定就境外子公司相关议案进行集体讨论; 未对境外子公司部分董事、高级管理人员开展离任审计或离任审查。2. 场外期权业务相关内部控制不健全, 未建立健全覆盖场外期权业务各环节的内部管理制度; 未明确部门层级风险指标超限额的报告路径和处理办法。场外衍生品业务相关风险指标体系不健全。3. 未清晰划分另类投资公司业务范围; 未及时处理另类投资公司有关人员兼任利益冲突职务的行为; 于 2024 年 01 月 22 日收到上海市证监局责令改正的处罚措施。

华宝安盈混合截止 2024 年 06 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中, 海通证券股份有限公司因存在首发保荐业务履职尽责明显不到位、投行质控内核部门未识别项目重大风险及对尽职调查

把关不审慎等缺陷。有关责任人对公司上述行为负有责任，未能审慎勤勉执业；于 2024 年 01 月 29 日收到上海证券交易所监管(约见)谈话的处罚措施。

华宝安盈混合截止 2024 年 06 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中，兴业证券股份有限公司因保荐业务违规；于 2024 年 03 月 07 日收到北京证券交易所警示，监管关注，监管(约见)谈话，要求提交书面承诺的处罚措施。

华宝安盈混合截止 2024 年 06 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中，中信证券股份有限公司因定期报告披露超期限，内部制度不完善，未依法履行职责；于 2024 年 04 月 20 日收到中国证监会警告，罚款，没收违法所得、没收非法财物，责令改正的处罚措施。

华宝安盈混合截止 2024 年 06 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中，海通证券股份有限公司因内部制度不完善；于 2024 年 04 月 29 日收到上海市证监局责令改正的处罚措施。

华宝安盈混合截止 2024 年 06 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中，中信证券股份有限公司因在尽职调查过程中，未按照《保荐人尽职调查工作准则》第七十条以及《监管规则适用指引——发行类第 4 号》4-11 等执业规范要求，对发行人关联交易情况进行充分核查，导致招股说明书遗漏披露关联交易相关信息；在核查工作底稿已有记录的情况下，中信证券未充分关注并执行进一步的核查程序，在本所问询后仍未审慎核查，发表的核查意见不准确。上述行为违反本所《股票发行上市审核规则》（以下简称《审核规则》）第二十七条、第三十八条的规定；于 2024 年 04 月 30 日收到深圳证券交易所警示的处罚措施。

华宝安盈混合截止 2024 年 06 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中，海通证券股份有限公司因：（一）保荐核查工作履职尽责不到位；（二）保荐业务内部控制存在薄弱环节；于 2024 年 05 月 06 日收到上海证券交易所通报批评的处罚措施。

华宝安盈混合截止 2024 年 06 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中，海通证券股份有限公司因定期报告披露超期限，内部制度不完善，未依法履行职责；于 2024 年 05 月 06 日收到中国证监会罚款，没收违法所得、没收非法财物的处罚措施。

华宝安盈混合截止 2024 年 06 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中，海通证券股份有限公司因作为公司债券 21 格地 02、22 格地 02 的主承销商和受托管理人存在以下违规行为：未对个别存货周边楼盘开盘价格低于项目楼面价的情况予以审慎分析核查；在 22 格地 02 期后事项核查中，未对存货可变现净值的评估进行持续关注和尽职调查；未制作咨询审计机构工作底稿；未对发行人重大损失披露临时受托管理事务报告；对发行人差错更正事项披露临时受托管理事务报告不及时；于 2024 年 05 月 28 日收到上海证券交易所警示的处罚措施。

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

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	515,873.72
2	应收证券清算款	190,990.21
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	100.85
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	706,964.78

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	127086	恒邦转债	6,581,892.85	2.75
2	127020	中金转债	5,781,521.10	2.42
3	110059	浦发转债	3,308,261.10	1.38
4	132026	G 三峡 EB2	1,294,565.75	0.54
5	111012	福新转债	618,870.41	0.26
6	123209	聚隆转债	526,134.25	0.22
7	113651	松霖转债	261,638.36	0.11
8	127101	豪鹏转债	243,951.18	0.10
9	127035	濮耐转债	124,416.71	0.05

5.11.5 报告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。

5.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	284,087,588.82
报告期期间基金总申购份额	56,291.65
减：报告期期间基金总赎回份额	43,935,749.62
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	240,208,130.85

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

中国证监会批准基金设立的文件；
华宝安盈混合型证券投资基金基金合同；
华宝安盈混合型证券投资基金招募说明书；
华宝安盈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。

9.2 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。

9.3 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 7 月 19 日