

# 新华红利回报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：新华基金管理股份有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二四年八月二十九日

## 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。本中期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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 8 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>1 重要提示及目录</b> .....	2
1.1 重要提示.....	2
<b>2 基金简介</b> .....	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
<b>3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
<b>4 管理人报告</b> .....	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
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.....	14
<b>5 托管人报告</b> .....	14
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	14
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.....	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	15
<b>6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	15
6.1 资产负债表.....	15
6.2 利润表.....	16
6.3 净资产变动表.....	17
6.4 报表附注.....	19
<b>7 投资组合报告</b> .....	37
7.1 期末基金资产组合情况.....	37
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.....	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	39
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	42
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.....	43
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.....	43
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.....	43
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.....	43
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	43
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	43
7.12 投资组合报告附注.....	43
<b>8 基金份额持有人信息</b> .....	46
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	46

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的情况 .....	46
<b>9 开放式基金份额变动</b> .....	<b>46</b>
<b>10 重大事件揭示</b> .....	<b>47</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	47
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 .....	47
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	47
10.4 基金投资策略的改变 .....	47
10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件 .....	47
10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	47
10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	47
10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	48
10.9 其他重大事件 .....	50
<b>11 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 .....	51
<b>12 备查文件目录</b> .....	<b>51</b>
12.1 备查文件目录 .....	51
12.2 存放地点 .....	51
12.3 查阅方式 .....	51

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	新华红利回报混合型证券投资基金
基金简称	新华红利回报混合
基金主代码	003025
交易代码	003025
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年3月27日
基金管理人	新华基金管理股份有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	166,354,923.65 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	综合运用多种投资策略，在严格控制基金资产净值下行风险的基础上追求基金资产净值的持续、稳定增长，力争为基金份额持有人提供长期稳定的投资回报。
投资策略	投资策略方面，本基金将以大类资产配置策略为基础，采取积极的股票投资策略和稳健的债券投资策略。大类资产配置策略主要运用战略性资产配置策略和战术性资产配置策略。股票投资策略采用定量分析与定性分析相结合的方法，选取主业清晰，具有持续的核心竞争力，管理透明度较高，流动性好且估值具有高安全边际的个股构建股票组合。债券投资策略主要运用久期调整策略、收益率曲线配置策略、债券类属配置策略、骑乘策略、可转换债券投资策略等。本基金的主要投资策略包括：资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、资产支持证券的投资策略、金融衍生品投资策略等。
业绩比较基准	50%×沪深 300 指数收益率+50%×中国债券总指数收益率
风险收益特征	本基金为混合型基金，属于证券投资基金中的中等风险中等预期收益品种，预期风险和收益低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金

### 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	新华基金管理股份有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	齐岩
	联系电话	010-68779688
	电子邮箱	qiyan@ncfund.com.cn
客户服务电话	4008198866	95588
传真	010-68779528	010-66105798

注册地址	重庆市江北区聚贤岩广场6号 力帆中心2号楼19层	北京市西城区复兴门内大街55 号
办公地址	重庆市江北区聚贤岩广场6号 力帆中心2号楼19层,北京市西 城区平安里西大街26号新时代 大厦9层、11层	北京市西城区复兴门内大街55 号
邮政编码	400010	100140
法定代表人	于春玲	廖林

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.ncfund.com.cn
基金中期报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公地

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	新华基金管理股份有限公司	重庆市江北区聚贤岩广场 6 号力帆中心 2 号楼 19 层

## 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日至2024年6月30日）
本期已实现收益	4,800,938.84
本期利润	10,043,770.02
加权平均基金份额本期利润	0.0586
本期加权平均净值利润率	5.74%
本期基金份额净值增长率	5.90%
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	3,746,951.34
期末可供分配基金份额利润	0.0225
期末基金资产净值	174,856,340.06
期末基金份额净值	1.0511
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	62.64%

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，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

2、以上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（例如基金申购费赎回费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字；

3、对期末可供分配利润，采用期末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（为期末余额，不是当期发生数）。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	1.76%	0.56%	-1.31%	0.24%	3.07%	0.32%
过去三个月	1.46%	0.52%	-0.55%	0.36%	2.01%	0.16%
过去六个月	5.90%	0.53%	1.69%	0.44%	4.21%	0.09%
过去一年	-3.93%	0.50%	-3.41%	0.43%	-0.52%	0.07%
过去三年	-8.02%	0.33%	-15.21%	0.52%	7.19%	-0.19%
自基金合同生效起至今	62.64%	0.55%	8.31%	0.57%	54.33%	-0.02%

#### 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

新华红利回报混合型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2017年3月27日至2024年6月30日）



## 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

新华基金管理股份有限公司经中国证券监督管理委员会批复，于 2004 年 12 月 9 日注册成立。注册地为重庆市，是我国西部首家公募基金管理公司。

截至 2024 年 6 月 30 日，新华基金管理股份有限公司旗下管理着四十三只开放式基金，即新华优选分红混合型证券投资基金、新华优选成长混合型证券投资基金、新华泛资源优势灵活配置混合型证券投资基金、新华钻石品质企业混合型证券投资基金、新华行业周期轮换混合型证券投资基金、新华中小市值优选混合型证券投资基金、新华优选消费混合型证券投资基金、新华纯债添利债券型发起式证券投资基金、新华行业轮换灵活配置混合型证券投资基金、新华趋势领航混合型证券投资基金、新华安享惠金定期开放债券型证券投资基金、新华壹诺宝货币市场基金、新华增怡债券型证券投资基金、新华鑫益灵活配置混合型证券投资基金、新华中证环保产业指数证券投资基金、新华活期添利货币市场基金、新华增盈回报债券型证券投资基金、新华策略精选股票型证券投资基金、新华稳健回报灵活配置混合型发起式证券投资基金、新华战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金、新华鑫回报混合型证券投资基金、新华积极价值灵活配置混合型证券投资基金、新华科技创新主题灵活配置混合型证券投资基金、新华鑫动力灵活配置混合型证券投资基金、新华双利债券型证



券投资基金、新华丰利债券型证券投资基金、新华外延增长主题灵活配置混合型证券投资基金、新华红利回报混合型证券投资基金、新华安享多裕定期开放灵活配置混合型证券投资基金、新华恒稳添利债券型证券投资基金、新华鑫日享中短债债券型证券投资基金、新华聚利债券型证券投资基金、新华鼎利债券型证券投资基金、新华沪深 300 指数增强型证券投资基金、新华安享惠泽 39 个月定期开放债券型证券投资基金、新华景气行业混合型证券投资基金、新华安享惠融 88 个月定期开放债券型证券投资基金、新华安康多元收益一年持有期混合型证券投资基金、新华利率债债券型证券投资基金、新华行业龙头主题股票型证券投资基金、新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合型证券投资基金、新华中证云计算 50 交易型开放式指数证券投资基金、新华中债 1-5 年农发行债券指数证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

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		
姚海明	本基金基金经理，新华聚利债券型证券投资基金基金经理、新华安享多裕定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金经理。	2021-12-30	-	11	会计学硕士，曾任中国工商银行总行资产管理部交易员，新华基金固定收益与平衡投资部债券研究员、基金经理助理、投资经理。
朱韦康	本基金基金经理助理，新华活期添利货币市场基金基金经理助理、新华壹诺宝货币市场基金基金经理助理、新华安享惠融 88 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理助理、新华安享惠泽 39 个月定期开放债券型证券投资基金基	2022-12-28	-	7	经济学博士，曾任中金公司固定收益分析师，建信信托投资经理。

	<p>金经理助理、新华利率债债券型证券投资基金基金经理助理、新华中债 1-5 年农发行债券指数证券投资基金基金经理助理、新华安康多元收益一年持有期混合型证券投资基金基金经理助理、新华聚利债券型证券投资基金基金经理助理、新华丰利债券型证券投资基金基金经理助理、新华鼎利债券型证券投资基金基金经理助理、新华鑫日享中短债债券型证券投资基金基金经理助理、新华纯债添利债券型发起式证券投资基金基金经理助理、新华安享惠金定期开放债券型证券投资基金基金经理助理、新华双利债券型证券投资基金基金经理助理、新华鑫回报混合型证券投资基金基金经理助理、新华增盈回报债券型</p>				
--	--	--	--	--	--

	证券投资基金 基金经理助 理、新华增怡 债券型证券投 资基金基金经 理助理。				
--	---	--	--	--	--

注：1、首任基金经理，任职日期指基金合同生效日，离任日期指根据公司决定确定的解聘日期。

2、非首任基金经理，任职日期和离任日期均指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

3、证券从业的含义遵从《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》、《基金从业人员管理规则》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

本报告期末不存在基金经理同时兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

#### 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，新华基金管理股份有限公司作为新华红利回报混合型证券投资基金的管理人按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《新华红利回报混合型证券投资基金基金合同》以及其它有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上为持有人谋求最大利益。运作整体合法合规，无损害基金持有人利益的行为。

#### 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

本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司制定的公平交易相关制度，通过制度、流程、系统和技术手段落实公平交易原则，公平对待旗下管理的所有投资组合。本报告期，公平交易制度总体执行情况良好。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，本基金未发生违法违规或对基金财产造成损失的异常交易行为；本基金管理人旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，未发生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%情形。

#### 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 年上半年全球地缘政治紧张局势延续，俄乌冲突和巴以冲突持续扰动全球贸易格局，能源

和大宗商品价格大幅波动，美联储降息预期反复调整，投资者关于降息的博弈愈加激烈。上半年国内经济增长压力仍较大，专项债发行进度有所放缓，基建投资略有回落，全国各主要城市房地产放松政策陆续落地，但是房地产投资和销售仍承压，库存维持在历史高位，居民消费基本保持稳定，汽车消费有所拖累，出口贸易仍比较强劲，通胀缓慢回升。经济内生动力不强、有效需求不足问题仍存，后续经济改善的幅度和持续性仍需观察。

2024 年上半年股票市场先下后上然后震荡调整，整体呈现倒“N”型走势，AI 和大盘红利风格表现胜过成长和小盘风格。具体来看，上证 50 指数和沪深 300 指数领涨，分别上涨 2.95%和 0.89%，而代表小盘和微盘的国证 2000 指数和中证 1000 指数领跌，分别下跌 19.67%和 16.84%；分行业来看，银行、煤炭、公用事业和家电等行业领涨，综合、计算机、商贸零售、社会服务和传媒等行业领跌。上半年股票市场经历了触底反弹和震荡调整，政策资金入市提供流动性以及资本市场规则优化调整给市场带来了积极变化，但是由于基本面羸弱，市场主线尚待发掘，不同板块轮动速度仍然较快，避险情绪仍较强。组合管理方面，我们股票仓位略有提升，保持组合的均衡配置，力求控制组合波动，结构上适当提升了红利、资源和部分大市值央国企的配置，同时减少了消费和成长方向的配置，对于微盘小盘比较谨慎。

2024 年上半年债券市场整体处于牛市，节奏上债券收益率呈现快速下行-区间震荡-继续下行走势。1 月至 3 月初，降息预期不断发酵，权益弱势背景下机构有配置需求，同时政府债券供给偏慢，债市收益率突破前低；3 月初至 5 月底，受监管指导农商行购债行为、国债供给预期、地产小幅回暖、汇率贬值压力和央行提示长债风险等扰动，利率处于区间震荡小幅下行；6 月资金宽松格局延续，经济基本面承压，风险偏好回落，央行卖债低于预期，配置资金积极入场，利率进一步大幅下行。组合管理方面，我们债券投资以中等久期利率债和高等级信用债为主要持仓，期间对于债券组合久期略有提升，以获取票息收益为主，回避有潜在信用风险的个券，保持组合较高流动性。

2024 年上半年转债市场随着权益市场大幅波动，走势也呈现出倒“N”型走势，同时具有盘面风格切换的显著特点，大盘表现良好、中小盘持续走低。一月份转债市场延续偏弱运行，市场对于退市和信用风险的担忧增强，转债指数与正股共振回落；二月份初至五月中旬，大量流动性进入对市场形成有效纾困，叠加央行大幅调降 5 年期 LPR，股市表现出强劲修复，转债市场亦走出“V”型反转的超跌反弹；五月中下旬至六月，年报披露利空出尽，但对后续评级调整、问询函等风险事项担忧情绪仍加重，叠加半年报业绩的低预期扰动，市场风格偏向谨慎，转债及正股指数均转向回调，转债指数相对承压，市场向上突破动能相对偏弱。组合管理方面，考虑到转债在二月初出现了超跌，组合对于部分信用资质较好的高 YTM 债券和大盘银行转债进行了增配，以实现纯债的替代，同时基于自下而上对于部分平衡型转债个券也有小幅增配，整体仍是以债性品种为主要持仓。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2024 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.0511 元，本报告期份额净值增长率为 5.90%，同期比较基准的增长率为 1.69%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2024 年下半年国际环境和地缘政治博弈仍旧复杂，全球经济面临更多挑战，美国通胀回落同时就业数据恶化，美联储降息概率很高，随着日本央行开启加息，全球资本市场震荡可能加剧。下半年国内经济增长压力仍较大，地产销售和投资较弱拖累明显，有效需求不足始终压制经济活力，居民和企业风险偏好趋于保守，若下半年海外陷入衰退，出口也将承压，可以预期更加激进的货币政策和财政政策有望发力托底经济。二十届三中全会向市场传达了比较积极的信号，消费端刺激政策陆续推出，但是在居民收入预期没有得到扭转之前政策刺激的效果有待观察。

展望 2024 年下半年债券市场，由于经济基本面仍旧承压，宽货币背景下“资产荒”延续，资金配置债券热情仍较高。由于美联储降息预期不断升温，美元走弱，人民币汇率贬值压力缓解，央行有望开启新一轮降息周期。债券市场面临的最大风险可能来自于财政政策的超预期发力、央行下场卖券或窗口指导大行卖券，这将导致长端利率波动加大；短端利率更多还是在资金面和政策利率综合作用下区间波动。我们维持组合久期在中性水平，整体杠杆率很低，总体以获取较高安全度的票息收益为主，对于信用资质下沉策略非常谨慎。

展望 2024 年下半年股票市场，经济基本面仍旧没有显著好转，企业盈利能力可能仍在恶化，房地产和消费对于经济拖累压力较大。A 股经过前期调整，整体估值水平回落至历史较低水平，权益风险溢价率处于较高水平，配置价值凸显，如果全球资本市场波动加大，A 股的比较优势可能会吸引部分外资小幅回流，但是考虑到通缩环境下企业盈利恶化、投资者风险偏好下降以及上市公司过度融资等因素，A 股指数层面仍有压力。前期强势的红利、周期、出海和 AI 相继调整后，市场风格逐步趋于平衡。我们会保持组合的均衡配置，对于微盘小盘比较谨慎，力求控制组合波动，我们继续坚持沿着业绩寻找主线，紧跟产业逻辑和公司业绩，重点关注红利、新能源后周期、国产替代、高端制造、出海和周期龙头等主要方向，坚持筛选基本面扎实、长期逻辑不断验证且估值性价比较高的投资标的进行积极布局。

展望 2024 年下半年转债市场，由于前期转债受信用风险事件频发出现集中调整，转债估值整体承压，本轮信用冲击的底层原因影响深远，存在部分低价券资质并没有太大风险且距到期还有很长时间，恐慌性抛售造成了非理性定价，这是我们需要识别和挖掘的方向，但是应当以更严格的标准来看待这种机会。考虑到正股基本面暂未出现趋势性改善，且小盘风格受到压制，正股的不确定性

不仅会影响偏股型品种行情，还会催化信用事件冲击。后续我们仍将继续重视高 YTM 转债的配置机会，标的选择上以国央企和业务稳定可持续的标的为主。对于平衡型和偏股型转债，我们更多自下而上筛选，在低价券和低溢价率等方向寻找投资机会。

#### 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相关指引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。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。本基金管理人设有估值小组，负责对各类投资品种的估值方法、估值模型等进行研究和论证，组织制定和适时修订估值政策和程序，指导和监督整个估值流程。本报告期内，参与估值流程各方之间不存在直接的重大利益冲突。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

本基金本报告期无利润分配。

#### 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

本报告期本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者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，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本基金的管理人——新华基金管理股份有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现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

本托管人依法对新华基金管理股份有限公司编制和披露的本基金 2024 年中期报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、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：新华红利回报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	2,446,856.44	3,141,930.31
结算备付金		1,210,583.41	828,618.65
存出保证金		74,021.02	53,199.98
交易性金融资产	6.4.7.2	164,882,362.39	169,752,836.01
其中：股票投资		85,257,920.00	62,729,191.06
基金投资		-	-
债券投资		79,624,442.39	107,023,644.95
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	6,500,000.00	699,863.57
应收清算款		834,917.18	1,254,111.88
应收股利		-	-
应收申购款		405.48	248.14
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		175,949,145.92	175,730,808.54
<b>负债和净资产</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		-	1,393,915.44
应付赎回款		185,362.82	225,564.78
应付管理人报酬		171,439.85	177,870.30
应付托管费		28,573.28	29,645.07
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		871.04	657.88
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	706,558.87	430,126.39
负债合计		1,092,805.86	2,257,779.86
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	166,354,923.65	174,781,634.38
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	8,501,416.41	-1,308,605.70
净资产合计		174,856,340.06	173,473,028.68
负债和净资产总计		175,949,145.92	175,730,808.54

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0511 元，基金份额总额 166,354,923.65 份。

## 6.2 利润表

会计主体：新华红利回报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>		<b>11,383,929.09</b>	<b>-4,857,889.84</b>
1.利息收入		147,009.95	54,678.28
其中：存款利息收入	6.4.7.9	22,413.98	16,100.90
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		124,595.97	38,577.38
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		5,993,994.08	-5,674,976.21
其中：股票投资收益	6.4.7.10	4,326,151.52	-8,601,997.36
基金投资收益	6.4.7.11	-	-
债券投资收益	6.4.7.12	820,610.74	2,404,731.03
资产支持证券投资收益	6.4.7.13	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	847,231.82	522,290.12



3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	5,242,831.18	759,576.32
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	93.88	2,831.77
<b>减：二、营业总支出</b>		1,340,159.07	2,435,447.28
1. 管理人报酬		<b>1,043,018.18</b>	<b>1,850,605.01</b>
其中：暂估管理人报酬（若有）		-	-
2. 托管费		173,836.31	308,434.22
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		1,543.53	147,879.60
其中：卖出回购金融资产支出		1,543.53	147,879.60
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		658.34	5,243.33
8. 其他费用	6.4.7.19	121,102.71	123,285.12
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>10,043,770.02</b>	<b>-7,293,337.12</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>10,043,770.02</b>	<b>-7,293,337.12</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		<b>10,043,770.02</b>	<b>-7,293,337.12</b>

### 6.3 净资产变动表

会计主体：新华红利回报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（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	174,781,634.38	-	-1,308,605.70	173,473,028.68
二、本期期初净资产	174,781,634.38	-	-1,308,605.70	173,473,028.68
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-8,426,710.73	-	9,810,022.11	1,383,311.38
（一）、综合收益总额	-	-	10,043,770.02	10,043,770.02
（二）、本期基金	-8,426,710.73	-	-233,747.91	-8,660,458.64

份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）				
其中：1.基金申购款	321,270.86	-	4,477.57	325,748.43
2.基金赎回款	-8,747,981.59	-	-238,225.48	-8,986,207.07
（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	166,354,923.65	-	8,501,416.41	174,856,340.06
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（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	237,740,764.52	-	30,264,238.98	268,005,003.50
二、本期期初净资产	237,740,764.52	-	30,264,238.98	268,005,003.50
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-33,304,568.77	-	-11,036,870.34	-44,341,439.11
（一）、综合收益总额	-	-	-7,293,337.12	-7,293,337.12
（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）	-33,304,568.77	-	-3,743,533.22	-37,048,101.99
其中：1.基金申购款	250,427.01	-	29,345.23	279,772.24
2.基金赎回款	-33,554,995.78	-	-3,772,878.45	-37,327,874.23
（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	204,436,195.75	-	19,227,368.64	223,663,564.39

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：

基金管理人负责人：于春玲，主管会计工作负责人：杨金亮，会计机构负责人：徐端骞

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

新华红利回报混合型证券投资基金(以下简称“本基金”),系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[2016]1483 号文的核准,由新华基金管理股份有限公司向社会公开募集,基金合同于 2017 年 3 月 27 日正式生效,首次设立募集规模为 272,798,500.29 份基金份额。本基金为契约型开放式,存续期限为不定期。本基金的基金管理人为新华基金管理股份有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表按照财政部颁布的《企业会计准则--基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定(统称“企业会计准则”)、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》、《新华红利回报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

本基金编制的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的财务状况、经营成果和基金净值变动情况等相关信息。

### 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估计与最近一期年度报告相一致,所采用的会计政策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

本基金报告期内未发生会计政策变更。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金报告期内未发生会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金报告期内未发生会计差错更正。

#### 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。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	2,446,856.44
等于：本金	2,446,547.26
加：应计利息	309.18
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
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	-
合计	2,446,856.44

##### 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	80,367,215.54	-	85,257,920.00	4,890,704.46
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	27,168,684.89	27,965,306.38	545,840.29
	银行间市场	50,266,258.72	710,136.01	51,659,136.01

	合计	77,434,943.61	960,917.21	79,624,442.39	1,228,581.57
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		157,802,159.15	960,917.21	164,882,362.39	6,119,286.03

### 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

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

### 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	6,500,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	6,500,000.00	-

#### 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因买断式逆回购而取得的债券。

### 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	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	598,104.97
其中：交易所市场	591,901.99
银行间市场	6,202.98

应付利息	-
账户维护费	9,000.00
上海证券报	59,672.34
审计费	39,781.56
合计	706,558.87

#### 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	174,781,634.38	174,781,634.38
本期申购	321,270.86	321,270.86
本期赎回（以“-”号填列）	-8,747,981.59	-8,747,981.59
本期末	166,354,923.65	166,354,923.65

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 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	-985,983.30	-322,622.40	-1,308,605.70
本期期初	-985,983.30	-322,622.40	-1,308,605.70
本期利润	4,800,938.84	5,242,831.18	10,043,770.02
本期基金份额交易产生的变动数	-68,004.20	-165,743.71	-233,747.91
其中：基金申购款	2.69	4,474.88	4,477.57
基金赎回款	-68,006.89	-170,218.59	-238,225.48
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,746,951.34	4,754,465.07	8,501,416.41

#### 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
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	16,430.72
其他	-
合计	22,413.98

注：结算备付金利息包含存出保证金利息。

**6.4.7.10 股票投资收益**

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出股票成交总额	427,483,774.09
减：卖出股票成本总额	422,194,623.11
减：交易费用	962,999.46
买卖股票差价收入	4,326,151.52

**6.4.7.11 基金投资收益**

本基金本报告期无基金投资收益。

**6.4.7.12 债券投资收益****6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
债券投资收益——利息收入	1,177,243.84
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-356,633.10
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	820,610.74

**6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 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	215,295,575.76
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	213,572,768.69
减：应计利息总额	2,073,063.96
减：交易费用	6,376.21
买卖债券差价收入	-356,633.10

**6.4.7.13 资产支持证券投资收益**



**6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益项目构成**

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

**6.4.7.14 贵金属投资收益**

本基金本报告期无贵金属投资收益。

**6.4.7.15 衍生工具收益**

本基金本报告期无衍生工具投资收益。

**6.4.7.16 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	847,231.82
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	847,231.82

**6.4.7.17 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	5,242,831.18
——股票投资	3,904,785.05
——债券投资	1,338,046.13
——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	5,242,831.18

**6.4.7.18 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	93.88
合计	93.88

#### 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	39,781.56
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行汇划费	3,048.81
账户维护费	18,000.00
查询费	600.00
合计	121,102.71

#### 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，本基金无需要披露的重大或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报告批准日，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

本报告期内本基金不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。

##### 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
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
新华基金管理股份有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构

注：以下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
恒泰证券股份有限公司	-	-	45,632,876.84	16.67%

注：本基金本报告期无通过关联方交易单元进行股票交易。

#### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间，均无通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 6.4.10.1.3 债券交易

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	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
恒泰证券股份有限公司	-	-	1,271,804.54	13.40%

注：本基金本报告期无通过关联方交易单元进行债券交易。

#### 6.4.10.1.4 债券回购交易

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	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
恒泰证券股份有限公司	-	-	7,550,000.00	5.88%

注：本基金本报告期无通过关联方交易单元进行债券回购交易。

#### 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
恒泰证券股份有限公 司	-	-	-	-
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
恒泰证券股份有限公 司	33,371.18	15.91%	33,371.18	12.09%

注：1、上述佣金按合同约定的佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的监管费和经手费后的净额列示。

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服务。

#### 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	1,043,018.18
其中：应支付销售机构的客户维护费	515,033.25	908,545.57
应支付基金管理人的净管理费	527,984.93	942,059.44

注：1、2023年1月1日至2023年8月20日基金管理费按前一日基金资产净值1.5%的年费率计提，每日计提，按月支付。其计算公式为：每日应计提的基金管理费=前一日基金资产净值×1.5%/当年天数。

自2023年8月21日起基金管理费按前一日基金资产净值1.2%的年费率计提，每日计提，按月支付。其计算公式为：每日应计提的基金管理费=前一日基金资产净值×1.2%/当年天数。

2、客户维护费是指基金管理人与基金销售机构在基金销售协议中约定的依据销售机构销售基金的保有量提取一定比例的客户维护费，用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期		上年度可比期间	
	2024年1月1日至2024年6月30日		2023年1月1日至2023年6月30日	
当期发生的基金应支付的托管费	173,836.31		308,434.22	

注：2023年1月1日至2023年8月20日基金托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提，每日计提，按月支付。其计算公式为：每日应计提的基金托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

自2023年8月21日起基金托管费按前一日基金资产净值0.2%的年费率计提，每日计提，按月支付。其计算公式为：每日应计提的基金托管费=前一日基金资产净值×0.2%/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

本基金本报告期及上年度可比期间，均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

本报告期及上年度可比期间，本基金未发生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。

##### 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

本报告期及上年度可比期间，本基金未发生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。

#### 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

报告期内，基金管理人未运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金的基金份额。

##### 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

报告期末，除基金管理人之外的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		上年度可比期间	
	2024年1月1日至2024年6月30日		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
中国工商银行股份有限公司	2,446,856.44	5,983.26	2,898,574.25	7,460.18

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期内未参与关联方承销证券。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

##### 6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末未进行利润分配。

#### 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

截至报告期期末，本基金未持有因认购新发/增发证券产生的流通受限证券。

##### 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

截至本报告期末，本基金无银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金无证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

##### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末未持有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

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了以董事会下设的风险控制与审计委员会为核心的，由督察长、风险管理委

员会、监察稽核部、相关职能部门和业务部门构成的风险管理架构体系。

#### 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，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金管理人通过严格的投资备选库制度、交易对手库管理和分散化投资方式防范信用风险。

##### 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	上年末 2023年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	12,354,418.99	56,059,350.00
合计	12,354,418.99	56,059,350.00

##### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本报告期末及上年度末，本基金未持有按短期信用评级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

本报告期末及上年度末，本基金未持有按短期信用评级的同业存单投资。

##### 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	上年末 2023年12月31日
AAA	23,272,594.57	17,371,703.68
AAA 以下	19,094,830.88	15,760,939.69
未评级	24,902,597.95	17,831,651.58
合计	67,270,023.40	50,964,294.95

##### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本报告期末及上年度末，本基金未持有按长期信用评级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

本报告期末及上年度末，本基金未持有按长期信用评级的同业存单投资。

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。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。本基金采用分散投资、控制流通受限证券比例等方式防范流动性风险。本基金所持大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。

除卖出回购金融资产款余额(计息但该利息金额不重大)以外，本基金承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一年以内且不计息，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按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《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组合的流动性指标进行持续的监测和分析。本报告期内，本基金资产的投资比例符合基金流动性风险管理的相关规定，流动性风险较低。

### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

#### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。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。

##### 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	2,446,856.44	-	-	-	2,446,856.44
结算备付金	1,210,583.41	-	-	-	1,210,583.41
存出保证金	74,021.02	-	-	-	74,021.02
交易性金融资产	12,959,307.48	66,516,986.95	148,147.96	85,257,920.00	164,882,362.39



衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	6,500,000.00	-	-	-	6,500,000.00
债权投资	-	-	-	0.00	0.00
其他债权投资	-	-	-	0.00	0.00
其他权益工具投资	-	-	-	0.00	0.00
应收清算款	-	-	-	834,917.18	834,917.18
应收股利	-	-	-	0.00	0.00
应收申购款	-	-	-	405.48	405.48
递延所得税资产	-	-	-	0.00	0.00
其他资产	-	-	-	0.00	0.00
资产总计	23,190,768.35	66,516,986.95	148,147.96	86,093,242.66	175,949,145.92
负债					
短期借款	-	-	-	0.00	0.00
交易性金融负债	-	-	-	0.00	0.00
衍生金融负债	-	-	-	0.00	0.00
卖出回购金融资产款	0.00	-	-	-	0.00
应付清算款	-	-	-	0.00	0.00
应付赎回款	-	-	-	185,362.82	185,362.82
应付管理人报酬	-	-	-	171,439.85	171,439.85
应付托管费	-	-	-	28,573.28	28,573.28
应付销售服务费	-	-	-	0.00	0.00
应付投资顾问费	-	-	-	0.00	0.00
应交税费	-	-	-	871.04	871.04
应付利润	-	-	-	0.00	0.00
递延所得税负债	-	-	-	0.00	0.00
其他负债	-	-	-	706,558.87	706,558.87
负债总计	0.00	0.00	0.00	1,092,805.86	1,092,805.86
利率敏感度缺口	23,190,768.35	66,516,986.95	148,147.96	85,000,436.80	174,856,340.06
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	3,141,930.31	-	-	-	3,141,930.31
结算备付金	828,618.65	-	-	-	828,618.65
存出保证金	53,199.98	-	-	-	53,199.98
交易性金融资产	66,760,549.73	38,649,086.08	1,614,009.14	62,729,191.06	169,752,836.01
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	699,863.57	-	-	-	699,863.57
债权投资	-	-	-	0.00	0.00
其他债权投资	-	-	-	0.00	0.00
其他权益工具投资	-	-	-	0.00	0.00
应收清算款	-	-	-	1,254,111.88	1,254,111.88
应收股利	-	-	-	0.00	0.00
应收申购款	-	-	-	248.14	248.14
递延所得税资产	-	-	-	0.00	0.00
其他资产	-	-	-	0.00	0.00
资产总计	71,484,162.24	38,649,086.08	1,614,009.14	63,983,551.08	175,730,808.54
负债					
短期借款	-	-	-	0.00	0.00
交易性金融负债	-	-	-	0.00	0.00
衍生金融负债	-	-	-	0.00	0.00
卖出回购金融资产款	0.00	-	-	-	0.00
应付清算款	-	-	-	1,393,915.44	1,393,915.44
应付赎回款	-	-	-	225,564.78	225,564.78
应付管理人报酬	-	-	-	177,870.30	177,870.30
应付托管费	-	-	-	29,645.07	29,645.07
应付销售服务费	-	-	-	0.00	0.00
应付投资顾问费	-	-	-	0.00	0.00
应交税费	-	-	-	657.88	657.88
应付利润	-	-	-	0.00	0.00
递延所得税负债	-	-	-	0.00	0.00
其他负债	-	-	-	430,126.39	430,126.39
负债总计	0.00	0.00	0.00	2,257,779.86	2,257,779.86
利率敏感度缺口	71,484,162.24	38,649,086.08	1,614,009.14	61,725,771.22	173,473,028.68

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同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	其他市场变量不变，市场利率上升或下降 25 个基点		
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
	市场利率上升 25.00 bp	-490,406.47	-395,696.14
市场利率下降 25.00 bp	420,869.77	324,878.10	

## 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的资产与负债均以人民币计价，因此无外汇风险。

## 6.4.13.4.3 其他价格风险

在其他价格风险分析中，本基金管理人主要分析市场价格风险的影响。市场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，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

## 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	85,257,920.00	48.76	62,729,191.06	36.16
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	79,624,442.39	45.54	107,023,644.9 5	61.69
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	164,882,362.39	94.30	169,752,836.01	97.86

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	其他市场变量不变,沪深 300 指数上升或下降 1%		
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
	沪深 300 指数上升 1%	704,501.75	483,190.72
	沪深 300 指数下降 1%	-704,501.75	-483,190.72

#### 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
第一层次	106,594,875.01
第二层次	58,287,487.38
第三层次	-
合计	164,882,362.39

###### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会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

间将相关股票的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票公允价值应属第二层次还是第三层次。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

#### 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	85,257,920.00	48.46
	其中：股票	85,257,920.00	48.46
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	79,624,442.39	45.25
	其中：债券	79,624,442.39	45.25
	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	6,500,000.00	3.69
	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	3,657,439.85	2.08
8	其他各项资产	909,343.68	0.52
9	合计	175,949,145.92	100.00

## 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

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	14,214,500.00	8.13
C	制造业	39,611,770.00	22.65
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	20,758,950.00	11.87
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	6,189,800.00	3.54
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,482,900.00	2.56
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	85,257,920.00	48.76

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本报告期末本基金未持有港股通股票。

## 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	占基金资产净值比例(%)
----	------	------	-------	------	--------------

1	000400	许继电气	146,000	5,023,860.00	2.87
2	600312	平高电气	250,000	4,862,500.00	2.78
3	601899	紫金矿业	240,000	4,216,800.00	2.41
4	600150	中国船舶	95,000	3,867,450.00	2.21
5	601766	中国中车	510,000	3,830,100.00	2.19
6	600938	中国海油	110,000	3,630,000.00	2.08
7	601872	招商轮船	400,000	3,380,000.00	1.93
8	300638	广和通	180,000	3,078,000.00	1.76
9	600795	国电电力	500,000	2,995,000.00	1.71
10	603993	洛阳钼业	350,000	2,975,000.00	1.70
11	002371	北方华创	9,000	2,879,010.00	1.65
12	600406	国电南瑞	115,000	2,870,400.00	1.64
13	600026	中远海能	180,000	2,809,800.00	1.61
14	002532	天山铝业	340,000	2,757,400.00	1.58
15	600023	浙能电力	380,000	2,701,800.00	1.55
16	600011	华能国际	255,000	2,453,100.00	1.40
17	600886	国投电力	130,000	2,371,200.00	1.36
18	002318	久立特材	95,000	2,216,350.00	1.27
19	001286	陕西能源	180,000	2,075,400.00	1.19
20	002465	海格通信	200,000	2,072,000.00	1.18
21	601225	陕西煤业	80,000	2,061,600.00	1.18
22	601985	中国核电	190,000	2,025,400.00	1.16
23	000543	皖能电力	215,000	1,902,750.00	1.09
24	600674	川投能源	100,000	1,875,000.00	1.07
25	605116	奥锐特	70,000	1,752,100.00	1.00
26	600941	中国移动	15,000	1,612,500.00	0.92
27	601600	中国铝业	200,000	1,526,000.00	0.87
28	600027	华电国际	200,000	1,388,000.00	0.79
29	601088	中国神华	30,000	1,331,100.00	0.76
30	601989	中国重工	250,000	1,232,500.00	0.70
31	601567	三星医疗	30,000	1,050,000.00	0.60
32	600642	申能股份	110,000	971,300.00	0.56
33	600685	中船防务	34,000	948,600.00	0.54
34	600031	三一重工	55,000	907,500.00	0.52
35	603025	大豪科技	60,000	829,200.00	0.47
36	600482	中国动力	40,000	779,200.00	0.45

#### 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	600519	贵州茅台	14,451,467.00	8.33
2	600026	中远海能	13,514,102.00	7.79
3	601899	紫金矿业	12,667,116.00	7.30
4	002371	北方华创	12,313,449.00	7.10
5	000400	许继电气	12,026,110.00	6.93
6	600150	中国船舶	10,994,335.00	6.34
7	002594	比亚迪	10,215,665.45	5.89
8	600027	华电国际	9,673,397.00	5.58
9	002517	恺英网络	9,102,123.00	5.25
10	600938	中国海油	8,988,005.00	5.18
11	002463	沪电股份	8,964,412.87	5.17
12	601985	中国核电	8,289,616.00	4.78
13	601179	中国西电	8,219,993.00	4.74
14	600941	中国移动	8,161,770.36	4.70
15	600312	平高电气	8,124,285.21	4.68
16	300795	米奥会展	7,830,087.00	4.51
17	601872	招商轮船	7,635,964.00	4.40
18	600011	华能国际	7,492,490.00	4.32
19	002465	海格通信	7,461,685.00	4.30
20	603993	洛阳钼业	7,135,656.00	4.11
21	601088	中国神华	6,929,481.00	3.99
22	600023	浙能电力	6,640,372.00	3.83
23	688041	海光信息	6,493,039.53	3.74
24	002179	中航光电	6,262,052.03	3.61
25	600406	国电南瑞	6,190,188.35	3.57
26	688012	中微公司	5,964,748.52	3.44
27	601225	陕西煤业	5,895,011.00	3.40
28	601168	西部矿业	5,792,976.00	3.34
29	300416	苏试试验	5,537,768.00	3.19
30	000960	锡业股份	5,432,833.07	3.13
31	002605	姚记科技	5,235,870.00	3.02
32	688676	金盘科技	5,050,849.76	2.91
33	600795	国电电力	4,442,275.00	2.56
34	300638	广和通	4,342,672.00	2.50
35	603871	嘉友国际	3,983,690.60	2.30
36	601766	中国中车	3,857,585.00	2.22
37	600482	中国动力	3,812,730.00	2.20
38	600803	新奥股份	3,768,807.00	2.17
39	002028	思源电气	3,680,044.00	2.12
40	600160	巨化股份	3,632,393.00	2.09
41	600710	苏美达	3,580,102.00	2.06
42	600760	中航沈飞	3,556,640.40	2.05



注：本项“买入金额”均按买入成交金额（成交单价乘以数量）填列，不考虑相关费用。

#### 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	600519	贵州茅台	15,569,446.00	8.98
2	600026	中远海能	13,389,858.00	7.72
3	002463	沪电股份	13,161,028.76	7.59
4	002371	北方华创	12,451,682.00	7.18
5	600312	平高电气	10,589,357.88	6.10
6	002594	比亚迪	10,164,976.00	5.86
7	600027	华电国际	9,652,232.00	5.56
8	601899	紫金矿业	9,332,034.00	5.38
9	002179	中航光电	9,233,967.14	5.32
10	601179	中国西电	9,001,625.00	5.19
11	002517	恺英网络	8,809,837.00	5.08
12	002028	思源电气	8,796,402.45	5.07
13	601872	招商轮船	8,444,339.92	4.87
14	600150	中国船舶	8,233,377.88	4.75
15	601985	中国核电	8,043,663.00	4.64
16	000400	许继电气	7,936,034.00	4.57
17	300795	米奥会展	7,791,602.00	4.49
18	688012	中微公司	6,967,850.51	4.02
19	600900	长江电力	6,835,110.90	3.94
20	603556	海兴电力	6,539,597.00	3.77
21	600011	华能国际	6,504,868.60	3.75
22	600941	中国移动	6,471,954.00	3.73
23	600435	北方导航	6,350,815.01	3.66
24	688041	海光信息	6,282,875.85	3.62
25	601168	西部矿业	6,011,021.09	3.47
26	688676	金盘科技	5,903,968.22	3.40
27	002465	海格通信	5,849,912.00	3.37
28	600938	中国海油	5,687,024.00	3.28
29	601088	中国神华	5,619,328.00	3.24
30	300416	苏试试验	5,607,017.00	3.23
31	000960	锡业股份	5,551,448.00	3.20
32	002605	姚记科技	5,531,495.76	3.19
33	600760	中航沈飞	5,496,942.00	3.17
34	600160	巨化股份	4,613,659.00	2.66
35	600023	浙能电力	4,524,642.00	2.61

36	000530	冰山冷热	4,247,362.00	2.45
37	601600	中国铝业	4,003,997.00	2.31
38	600502	安徽建工	3,980,860.00	2.29
39	603993	洛阳钼业	3,854,257.00	2.22
40	603871	嘉友国际	3,825,115.00	2.21
41	601225	陕西煤业	3,783,180.00	2.18
42	600803	新奥股份	3,567,875.00	2.06

注：本项“卖出金额”均按卖出成交金额（成交单价乘以数量）填列，不考虑相关费用。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	440,818,567.00
卖出股票的收入（成交）总额	427,483,774.09

注：本项“买入股票的成本（成交）总额”与“卖出股票的收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以数量）填列，不考虑相关费用。

#### 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	6,628,351.37	3.79
2	央行票据	-	-
3	金融债券	41,550,955.19	23.76
	其中：政策性金融债	30,628,665.57	17.52
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	10,108,180.82	5.78
7	可转债（可交换债）	21,336,955.01	12.20
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	79,624,442.39	45.54

**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	092280094	22 河北银行永续债 02	100,000	10,922,289.62	6.25
2	190208	19 国开 08	100,000	10,344,065.57	5.92
3	230208	23 国开 08	100,000	10,219,545.21	5.84
4	102400740	24 河钢集 MTN006	100,000	10,108,180.82	5.78
5	240303	24 进出 03	100,000	10,065,054.79	5.76

**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**

本基金本报告期末未持有股指期货。

**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**

本基金本报告期末未持有国债期货。

**7.11.2 本期国债期货投资评价**

本基金本报告期末未持有国债期货。

**7.12 投资组合报告附注**

7.12.1 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

许继电气股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国证券监督管理委员会河南监管局的行政监

管措施。

本基金对以上证券的投资决策符合法律法规及公司制度的相关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期末本基金投资的其他前十名证券的发行主体没有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。

#### 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

本报告期,本基金投资的前十名股票没有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	74,021.02
2	应收清算款	834,917.18
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	405.48
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	909,343.68

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	110059	浦发转债	4,852,116.27	2.77
2	128129	青农转债	3,193,611.68	1.83
3	113042	上银转债	2,284,837.49	1.31
4	113052	兴业转债	1,082,176.71	0.62
5	127018	本钢转债	826,536.60	0.47
6	113516	苏农转债	604,888.49	0.35
7	113037	紫银转债	603,917.63	0.35
8	113056	重银转债	542,295.89	0.31
9	127024	盈峰转债	447,996.16	0.26

10	128134	鸿路转债	428,364.93	0.24
11	128116	瑞达转债	421,633.32	0.24
12	110082	宏发转债	379,845.21	0.22
13	127020	中金转债	361,345.07	0.21
14	127022	恒逸转债	357,730.01	0.20
15	123115	捷捷转债	354,353.97	0.20
16	113047	旗滨转债	328,955.75	0.19
17	110076	华海转债	325,806.99	0.19
18	113625	江山转债	325,547.26	0.19
19	113584	家悦转债	318,607.73	0.18
20	113046	金田转债	312,396.16	0.18
21	113652	伟 22 转债	226,223.18	0.13
22	113641	华友转债	223,227.43	0.13
23	127038	国微转债	165,508.56	0.09
24	127056	中特转债	164,007.82	0.09
25	113655	欧 22 转债	162,017.47	0.09
26	110087	天业转债	151,770.78	0.09
27	118005	天奈转债	149,834.59	0.09
28	123151	康医转债	149,095.20	0.09
29	127046	百润转债	140,663.56	0.08
30	118013	道通转债	137,042.79	0.08
31	128135	洽洽转债	113,525.07	0.06
32	123172	漱玉转债	106,476.99	0.06
33	123179	立高转债	102,201.70	0.06
34	127075	百川转 2	101,999.45	0.06
35	127044	蒙娜转债	98,109.18	0.06
36	128121	宏川转债	95,975.28	0.05
37	118046	诺泰转债	92,528.40	0.05
38	113065	齐鲁转债	79,798.33	0.05
39	127025	冀东转债	78,649.34	0.04
40	123176	精测转 2	64,993.04	0.04
41	110079	杭银转债	60,383.62	0.03
42	127088	赫达转债	55,619.56	0.03
43	123064	万孚转债	54,958.08	0.03
44	113605	大参转债	53,679.25	0.03
45	113059	福莱转债	53,406.03	0.03
46	123108	乐普转 2	53,122.88	0.03
47	123161	强联转债	49,174.11	0.03

#### 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，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## 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
1,856	89,630.89	4.41	0.00%	166,354,919.24	100.00%

### 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	39,974.33	0.02%

### 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的情况

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	0~10

## 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2017年3月27日）基金份额总额	272,798,500.29
本报告期期初基金份额总额	174,781,634.38
本报告期基金总申购份额	321,270.86
减：本报告期基金总赎回份额	8,747,981.59
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	166,354,923.65

## 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

2024 年 2 月 26 日，经基金管理人第三届董事会第九次（临时）会议审议通过，聘任蒋茜先生担任基金管理人副总经理。

本基金托管人的专门基金托管部门未有重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期未有涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期未有基金投资策略的改变。

### 10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

本报告期本基金未持有基金。

### 10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未有改聘会计师事务所的情况。

### 10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.7.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

措施 1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	管理人
受到稽查或处罚等措施的时间	2024-05-06
采取稽查或处罚等措施的机构	安徽证监局
受到的具体措施类型	警示函
受到稽查或处罚等措施的原因	专户产品未及时履行信息披露相关义务
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	已完成整改
其他	-

#### 10.7.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

## 10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

## 10.8.1 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	
国泰君安	1	132,369,767.50	15.26%	125,207.51	18.05%	-
长江证券	3	132,260,215.26	15.25%	98,652.04	14.22%	-
国海证券	2	97,605,093.07	11.25%	72,803.66	10.50%	-
国联证券	2	96,898,480.12	11.17%	72,275.94	10.42%	-
招商证券	1	80,263,720.80	9.25%	75,921.48	10.95%	-
财通证券	2	78,710,475.12	9.08%	58,710.84	8.46%	-
华泰证券	1	71,544,127.71	8.25%	53,366.05	7.69%	-
开源证券	2	69,064,591.49	7.96%	51,515.25	7.43%	-
华金证券	2	54,338,567.28	6.27%	40,529.47	5.84%	-
中泰证券	2	24,602,677.00	2.84%	18,351.03	2.65%	-
中信证券	5	20,883,874.40	2.41%	19,754.15	2.85%	-
方正证券	1	8,781,380.00	1.01%	6,549.88	0.94%	-
恒泰证券	2	-	-	-	-	-
德邦证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	2	-	-	-	-	-
中金财富	2	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
国投证券	1	-	-	-	-	-
中山证券	1	-	-	-	-	已退租
湘财证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	3	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	4	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	已退租
中信建投	2	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
华安证券	2	-	-	-	-	-

注：交易单元的选择标准和程序如下：

## 一、交易单元的选择标准：

(一) 基本情况：财务状况良好，财务指标符合证券公司监管要求；



(二) 合规风控：公司治理完善，内部管理规范，内控制度健全；

(三) 研究服务实力方面需满足以下条件：1、有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析报告及丰富全面的信息服务；2、能根据公司所管理基金的特定要求，提供专题研究报告；3、具备较强的服务意识，能主动为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

(四) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要。

## 二、交易单元的选择程序：

(一) 公司研究部根据上述标准考察后确定合作的证券公司名单。

(二) 公司与被选中的证券经营机构签订席位租用协议。

### 10.8.2 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		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
国泰君安	5,104,632.66	5.43%	100,300,000.00	11.96%	-	-
长江证券	15,089,726.34	16.06%	365,300,000.00	43.58%	-	-
国海证券	20,329,638.62	21.64%	126,800,000.00	15.13%	-	-
国联证券	941,257.73	1.00%	93,400,000.00	11.14%	-	-
招商证券	1,801,182.97	1.92%	-	-	-	-
财通证券	26,148,740.02	27.84%	44,200,000.00	5.27%	-	-
华泰证券	7,664,858.89	8.16%	7,000,000.00	0.84%	-	-
开源证券	3,126,001.60	3.33%	-	-	-	-
华金证券	1,710,621.09	1.82%	73,500,000.00	8.77%	-	-
中泰证券	351,160.80	0.37%	-	-	-	-
中信证券	9,272,109.75	9.87%	27,800,000.00	3.32%	-	-
方正证券	2,394,605.56	2.55%	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-

德邦证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
中金财富	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
中山证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-

### 10.9 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	新华基金管理股份有限公司旗下基金季度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-01-19
2	新华红利回报混合型证券投资基金 2023 年第 4 季度报告	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-01-19
3	新华基金管理股份有限公司基金行业高级管理人员变更公告	中国证券报、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-02-28
4	新华基金管理股份有限公司旗下基金年度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-03-30
5	新华红利回报混合型证券投资基金 2023 年年度报告	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-03-30
6	新华基金管理股份有限公司旗下基金季度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-04-19

7	新华红利回报混合型证券投资基金 2024 年第 1 季度报告	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-04-19
8	新华红利回报混合型证券投资基金招募说明书（更新）	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-04-30
9	新华红利回报混合型证券投资基金基金产品资料概要（更新）	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-04-30
10	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分证券投资基金增加销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-06-15
11	新华红利回报混合型证券投资基金基金产品资料概要（更新）	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-06-26

## 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

本报告期内本基金未有影响投资者决策的其他重要信息。

## 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- （一）中国证监会准予新华红利回报混合型证券投资基金注册的文件
- （二）《关于申请募集新华红利回报混合型证券投资基金之法律意见书》
- （三）《新华红利回报混合型证券投资基金托管协议》
- （四）《新华红利回报混合型证券投资基金基金合同》
- （五）《新华红利回报混合型证券投资基金招募说明书》（更新）
- （六）基金管理人业务资格批件、营业执照
- （七）基金托管人业务资格批件、营业执照

### 12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

### 12.3 查阅方式

投资者可在营业时间内免费查阅，也可按工本费购买复印件，或通过本基金管理人网站查阅。

新华基金管理股份有限公司

二〇二四年八月二十九日