

华宝新飞跃灵活配置混合型证券投资基金 2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：华宝基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2024 年 8 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 08 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 01 月 01 日起至 2024 年 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 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	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	11
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等内容真实、准确和完整发表意见	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	16
§ 7 投资组合报告	41
7.1 期末基金资产组合情况	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	41
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	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	55
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	56
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	57
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	57
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	57

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	57
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	57
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	57
7.12 投资组合报告附注	58
§ 8 基金份额持有人信息	60
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	60
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	60
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	60
§ 9 开放式基金份额变动	60
§ 10 重大事件揭示	61
10.1 基金份额持有人大会决议	61
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	61
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	61
10.4 基金投资策略的改变	61
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	61
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	61
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	61
10.8 其他重大事件	65
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	66
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	66
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	66
§ 12 备查文件目录	66
12.1 备查文件目录	66
12.2 存放地点	66
12.3 查阅方式	66

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华宝新飞跃灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	华宝新飞跃混合
基金主代码	004335
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017 年 2 月 27 日
基金管理人	华宝基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	128,003,504.96 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的前提下，本基金通过大类资产间的灵活配置和多样的投资策略，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	<p>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的因素，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。</p> <p>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、中观行业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。</p>
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×50%+上证国债指数收益率×50%
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	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	周雷	王小飞
	联系电话	021-38505888	021-60637103
	电子邮箱	xxpl@fsfund.com	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		400-700-5588、400-820-5050	021-60637228
传真		021-38505777	021-60635778
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	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		200120	100033

法定代表人	黄孔威	张金良
-------	-----	-----

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办公场所。

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	基金管理人	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-1,250,885.81
本期利润	6,647,444.43
加权平均基金份额本期利润	0.0591
本期加权平均净值利润率	3.11%
本期基金份额净值增长率	3.19%
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	110,676,001.86
期末可供分配基金份额利润	0.8646
期末基金资产净值	246,363,040.80
期末基金份额净值	1.9247
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	92.47%

注：1. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润等于本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2. 所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3. 净值相关数据计算中涉及天数的，包括所有交易日以及季末最后一自然日（如非交易日）。

4. 期末可供分配利润采用资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

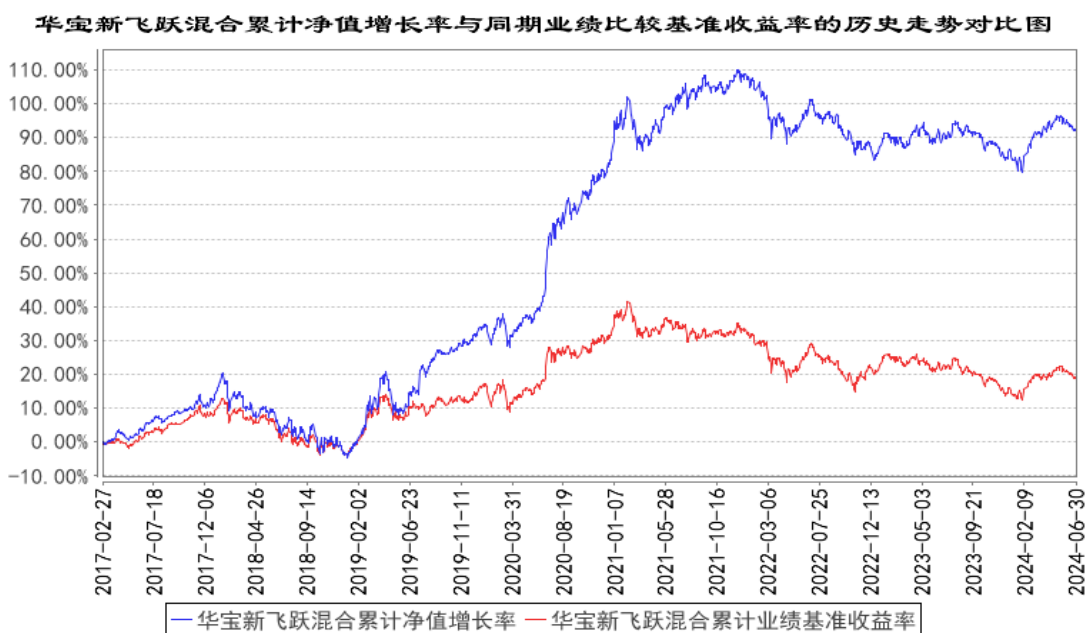
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-0.80%	0.26%	-1.33%	0.24%	0.53%	0.02%
过去三个月	0.34%	0.37%	-0.08%	0.37%	0.42%	0.00%
过去六个月	3.19%	0.45%	2.53%	0.44%	0.66%	0.01%
过去一年	1.12%	0.40%	-2.23%	0.43%	3.35%	-0.03%
过去三年	-5.02%	0.46%	-11.97%	0.52%	6.95%	-0.06%
自基金合同生效起至今	92.47%	0.67%	19.10%	0.58%	73.37%	0.09%

注：（1）基金业绩基准：沪深 300 指数收益率×50%+上证国债指数收益率×50%；

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

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：按照基金合同的约定，基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定，截至 2017 年 08 月 27 日，本基金已达到合同规定的资产配置比例。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

华宝基金管理有限公司（公司原名“华宝兴业基金管理有限公司”）于 2003 年 2 月 12 日经中国证监会批准设立，2003 年 3 月 7 日在国家工商总局注册登记并正式开业，是国内首批中外合资基金管理公司。成立之初，公司注册资本为 1 亿元人民币，2007 年经中国证监会批准，公司注册资本增加至 1.5 亿元人民币。2017 年公司名称变更为“华宝基金管理有限公司”。目前公司股东为华宝信托有限责任公司、美国华平资产管理有限合伙（Warburg Pincus Asset Management, L.P.）和江苏省铁路集团有限公司，持有股权占比分别为 51%、29%、20%。公司在北京和深圳设有分公司。截至本报告期末（2024 年 06 月 30 日），本公司正在管理运作的公开募集证券投资基金共 141 只，涵盖股票型基金、混合型基金、债券型基金、货币市场基金、FOF 等。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李栋梁	本基金基金经理、固定收益投资总监、混合资产部总经理、固定收益部总经理	2017-02-27	-	21 年	硕士。曾在国联证券有限责任公司、华宝信托有限责任公司和太平资产管理有限公司从事固定收益的证券研究和投资管理工作。2010 年 10 月加入华宝基金管理有限公司，先后担任债券分析师、基金经理助理、固定收益部副总经理、混合资产部副总经理等职务，现任固定收益投资总监、混合资产部总经理、固定收益部总经理。2011 年 6 月起任华宝宝康债券投资基金基金经理，2014 年 10 月至 2023 年 3 月任华宝增强收益债券型证券投资基金基金经理，2015 年 10 月至 2017 年 12 月任华宝新机遇灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)、华宝新价值灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2016 年 4 月至 2019 年 6 月任华宝宝鑫纯债一年定期开放债券型证券投资基金基金经理，2016 年 6 月起任华宝可转债债券型证券投资基金基金经理，2016 年 9 月至 2017 年 12 月任华宝新活力灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2016 年 12 月至 2021 年 3 月任华宝新起点灵活配置混合型证

					券投资基金基金经理,2017年1月至2018年6月任华宝新动力一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金经理,2017年2月起任华宝新飞跃灵活配置混合型证券投资基金基金经理,2017年3月至2018年8月任华宝新优选一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金经理,2017年3月至2018年7月任华宝新回报一年定期开放混合型证券投资基金基金经理,2017年6月至2019年3月任华宝新优享灵活配置混合型证券投资基金基金经理,2021年4月起任华宝双债增强债券型证券投资基金基金经理,2022年5月起任华宝安宜六个月持有期债券型证券投资基金基金经理,2022年11月起任华宝安悦一年持有期混合型证券投资基金基金经理,2023年1月起任华宝安融六个月持有期债券型证券投资基金基金经理,2023年8月起任华宝安元债券型证券投资基金基金经理。
唐雪倩	本基金基金经理	2023-09-23	-	9年	硕士。2015年7月加入华宝基金管理有限公司,先后担任分析师、基金经理助理等职务。2021年10月至2022年6月任华宝安益混合型证券投资基金基金经理,2021年10月起任华宝安享混合型证券投资基金基金经理,2022年6月起任华宝红利精选混合型证券投资基金基金经理,2022年8月至2023年11月任华宝高端装备股票型发起式证券投资基金基金经理,2023年4月起任华宝新机遇灵活配置混合型证券投资基金(LOF)基金经理,2023年4月至2024年1月任华宝未来主导产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理,2023年9月起任华宝新飞跃灵活配置混合型证券投资基金基金经理,2024年6月起任华宝新价值灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

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《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期内,本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《华宝新飞跃灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋取最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，基金管理人通过严格执行投资决策委员会议事规则、公司股票库管理制度、中央交易室制度、防火墙机制、系统中的公平交易程序、每日交易日结报告、定期基金投资绩效评价等机制，确保所管理的所有投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。同时，基金管理人严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定和公司内部制度要求，分析了本公司旗下所有投资组合之间的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异以及连续四个季度期间内、不同时间窗下同向交易的交易价差；分析结果未发现异常情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

本报告期内，本基金未发现异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年国民经济运行总体平稳，稳中有进，生产稳定增长，需求持续恢复，就业物价总体稳定，居民收入继续增加，新动能加快成长，高质量发展取得新进展。上半年国内生产总值 616836 亿元，按不变价格计算，同比增长 5.0%。分季度看，一季度国内生产总值同比增长 5.3%，二季度增长 4.7%。从环比看，二季度国内生产总值增长 0.7%。上半年，全国规模以上工业增加值同比增长 6.0%。上半年，服务业增加值同比增长 4.6%。上半年，社会消费品零售总额 235969 亿元，同比增长 3.7%。上半年，全国固定资产投资（不含农户）245391 亿元，同比增长 3.9%；扣除房地产开发投资，全国固定资产投资增长 8.5%。上半年，货物进出口总额 211688 亿元，同比增长 6.1%。其中，出口 121298 亿元，增长 6.9%；进口 90390 亿元，增长 5.2%。进出口相抵，贸易顺差 30909 亿元。上半年，全国居民消费价格（CPI）同比上涨 0.1%，一季度为同比持平。上半年，全国工业生产者出厂价格同比下降 2.1%，降幅比一季度收窄 0.6 个百分点。

上半年债券市场表现较好,收益率曲线中短端收益率持续下行,长短收益率波动中下行。股票和转债市场波动中出现结构性行情,红利类资产表现较好。

上半年基金股票投资比例相对稳定,股票配置以稳健的品种为主。债券方面,一季度转债下跌之后增加了转债的配置,二季度全部卖出转债并提高了债券组合的久期。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金份额净值增长率为 3.19%,业绩比较基准收益率为 2.53%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

当前外部环境变化带来的不利影响增多,国内有效需求不足,经济运行出现分化,重点领域风险隐患仍然较多,新旧动能转换存在阵痛。海外经济衰退可能降低出口的增速,国内有效需求不足。后期重点关注经济高频数据以及经济政策的时点和力度,包括专项债发行使用进度、超长期特别国债使用情况、大规模设备更新和大宗耐用消费品以旧换新的进度、央行货币政策的力度、地产和消费等的高频数据等,据此做出大类资产配置的判断和类属资产配置的判断,改善业绩。

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

本基金本报告期末未进行利润分配,符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人低于二百人或基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

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

本托管人复核审查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。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华宝新飞跃灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	1,700,445.18	15,922,078.61
结算备付金		4,122,845.42	1,765,016.96
存出保证金		2,235,557.29	1,260,593.61
交易性金融资产	6.4.7.2	217,277,509.80	216,891,252.89
其中：股票投资		126,286,552.50	124,296,728.67
基金投资		-	-
债券投资		90,990,957.30	92,594,524.22
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	21,616,000.00	9,913,000.00
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		3,978.75	-
应收股利		-	-
应收申购款		22,678.25	9,380.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		246,979,014.69	245,761,322.07
负债和净资产	附注号	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023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		84,886.28	14,041,923.43
应付赎回款		157,828.31	3,375.39
应付管理人报酬		104,371.81	116,354.79
应付托管费		26,092.96	29,088.70
应付销售服务费		43,488.24	48,481.14
应付投资顾问费		-	-
应交税费		1,521.63	36,186.79
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	197,784.66	323,797.36
负债合计		615,973.89	14,599,207.60
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	128,003,504.96	123,932,240.85
未分配利润	6.4.7.8	118,359,535.84	107,229,873.62
净资产合计		246,363,040.80	231,162,114.47
负债和净资产总计		246,979,014.69	245,761,322.07

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.9247 元，基金份额总额 128,003,504.96 份。

6.2 利润表

会计主体：华宝新飞跃灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
一、营业总收入		7,826,253.50	7,147,044.16
1. 利息收入		76,028.59	55,428.33
其中：存款利息收入	6.4.7.9	25,282.97	34,179.26
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		50,745.62	21,249.07
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-154,040.89	-1,074,673.95
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-2,074,425.53	-2,086,078.20
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	601,825.34	-228,823.68
资产支持证券投资	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-683,191.52	-129,193.27
股利收益	6.4.7.15	2,001,750.82	1,369,421.20
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	7,898,330.24	8,165,984.98
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	5,935.56	304.80
减：二、营业总支出		1,178,809.07	1,181,592.05
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	638,482.53	646,034.78
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	159,620.57	161,508.68
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	266,034.33	269,181.16
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		6,758.30	-
其中：卖出回购金融资产支出		6,758.30	-

6. 信用减值损失	6.4.7.18	-	-
7. 税金及附加		3,047.98	1,829.87
8. 其他费用	6.4.7.19	104,865.36	103,037.56
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		6,647,444.43	5,965,452.11
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		6,647,444.43	5,965,452.11
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		6,647,444.43	5,965,452.11

6.3 净资产变动表

会计主体：华宝新飞跃灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	123,932,240.85	-	107,229,873.62	231,162,114.47
二、本期期初净资产	123,932,240.85	-	107,229,873.62	231,162,114.47
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	4,071,264.11	-	11,129,662.22	15,200,926.33
（一）、综合收益总额	-	-	6,647,444.43	6,647,444.43
（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）	4,071,264.11	-	4,482,217.79	8,553,481.90
其中：1. 基金申购款	33,749,388.46	-	31,077,013.29	64,826,401.75
2. 基金赎回款	-29,678,124.35	-	-26,594,795.50	-56,272,919.85
（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	128,003,504.96	-	118,359,535.84	246,363,040.80
项目	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	118,591,742.21	-	101,074,536.90	219,666,279.11
二、本期期初净资产	118,591,742.21	-	101,074,536.90	219,666,279.11
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-7,850,705.30	-	-1,027,130.81	-8,877,836.11
(一)、综合收益总额	-	-	5,965,452.11	5,965,452.11
(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)	-7,850,705.30	-	-6,992,582.92	-14,843,288.22
其中：1. 基金申购款	2,316,351.56	-	2,081,332.57	4,397,684.13
2. 基金赎回款	-10,167,056.86	-	-9,073,915.49	-19,240,972.35
(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	110,741,036.91	-	100,047,406.09	210,788,443.00

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

向辉

基金管理人负责人

向辉

主管会计工作负责人

张幸骏

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华宝新飞跃灵活配置混合型证券投资基金（原名华宝兴业新飞跃灵活配置混合型证券投资基金，以下简称“本基金”）系由基金管理人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》、《华宝兴业新飞跃灵活配置混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)及其他有关法律法规的规定,经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)以证监许可[2016]2909 号文批准公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限为不定期,首次设立募集基金份额为 300,097,996.34 份,经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)验证,并出具了编号为德师报(验)字(17)第 00038 号的验资报告。基金合同于 2017 年 2 月 27 日正式生效。本基金的基金管理人为华宝基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《华宝基金管理有限公司关于旗下基金更名事宜的公告》,华宝兴业新飞跃灵活配置混合型证券投资基金于 2017 年 12 月 30 日起更名为华宝新飞跃灵活配置混合型证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、截至报告期末最新公告的基金合同及《华宝新飞跃灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板、存托凭证及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、资产支持证券、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、权证、股指期货以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但需符合中国证监会的相关规定。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

本基金的投资组合比例为:本基金投资于股票的比例为基金资产的 0-95%;每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,本基金保留的现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%;股指期货的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

本基金的业绩比较基准为:沪深 300 指数收益率 \times 50%+上证国债指数收益率 \times 50%。

本财务报表已于 2024 年 8 月 30 日经本基金的基金管理人批准。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《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”)编制,同时,在信息披露和估值方面,也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金

信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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于 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

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

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

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

(1) 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

(2) 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开

放式证券投资基金) 管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税; 国债、地方政府债券利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税; 存款利息收入不征收增值税;

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《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》的规定, 金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入;

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定, 金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入;

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《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》的规定, 本基金运营过程中发生的增值税应税行为, 以本基金的基金管理人为增值税纳税人;

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定, 证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金过程中发生的增值税应税行为, 暂适用简易计税方法, 按照 3% 的征收率缴纳增值税。对证券投资基金在 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, 已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

(3) 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税法》、《征收教育费附加的暂行规定(2011 年修订)》及相关地方教育附加的征收规定, 凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人, 都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加(除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外)及地方教育费附加。

(4) 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定, 自 2004 年 1 月 1 日起, 对证券投资基金(封闭式证券投资基金, 开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入, 继续免征企业所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定, 股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入, 暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资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，股权的股息、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。

(5) 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《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》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，暂减按 25% 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；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《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》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	1,700,445.18
等于：本金	1,699,937.72
加：应计利息	507.46
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-

其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	1,700,445.18

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	124,173,995.13	-	126,286,552.50	2,112,557.37
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	245,315.76	18,821,875.76	35,984.61
	银行间市场	71,392,165.08	735,081.54	41,834.92
	合计	89,932,740.47	980,397.30	90,990,957.30
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	214,106,735.60	980,397.30	217,277,509.80	2,190,376.90

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-18,843,120.00	-	-	-
其中： 股指期货投资	-18,843,120.00	-	-	-

其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-18,843,120.00	-	-	-

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IF2407	IF2407	-18.00	-18,559,800.00	283,320.00
合计				283,320.00
减：可抵销期货暂收款				283,320.00
净额				0.00

注：（1）买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

（2）衍生金融资产项下的利率/权益/其他衍生工具为国债/股指/商品期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指/商品/国债期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指/商品/国债期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为 0。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	21,616,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	21,616,000.00	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-

应付交易费用	113,249.30
其中：交易所市场	110,189.30
银行间市场	3,060.00
应付利息	-
预提费用	84,535.36
合计	197,784.66

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	123,932,240.85	123,932,240.85
本期申购	33,749,388.46	33,749,388.46
本期赎回（以“-”号填列）	-29,678,124.35	-29,678,124.35
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	128,003,504.96	128,003,504.96

注：申购含红利再投以及转换入份(金)额，赎回含转换出份(金)额。

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	108,464,420.91	-1,234,547.29	107,229,873.62
本期期初	108,464,420.91	-1,234,547.29	107,229,873.62
本期利润	-1,250,885.81	7,898,330.24	6,647,444.43
本期基金份额交易产生的变动数	3,462,466.76	1,019,751.03	4,482,217.79
其中：基金申购款	29,243,276.92	1,833,736.37	31,077,013.29
基金赎回款	-25,780,810.16	-813,985.34	-26,594,795.50
本期已分配利润	-	-	-
本期末	110,676,001.86	7,683,533.98	118,359,535.84

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	7,223.66
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	17,945.43
其他	113.88
合计	25,282.97

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
卖出股票成交总额	58,603,394.17
减：卖出股票成本总额	60,534,827.01
减：交易费用	142,992.69
买卖股票差价收入	-2,074,425.53

6.4.7.10.3 股票投资收益——证券出借差价收入

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
债券投资收益——利息收入	865,573.70
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-263,748.36
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	601,825.34

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	103,937,676.01
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	102,994,885.53
减：应计利息总额	1,203,218.03
减：交易费用	3,320.81
买卖债券差价收入	-263,748.36

6.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

6.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 贵金属投资收益

6.4.7.13.1 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
股指期货投资收益	-683,191.52

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	2,001,750.82
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	2,001,750.82

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
1. 交易性金融资产	7,353,050.24
股票投资	7,033,779.81
债券投资	319,270.43
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	545,280.00
权证投资	-
期货投资	545,280.00

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	7,898,330.24

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
基金赎回费收入	5,913.39
基金转换费收入	22.17
合计	5,935.56

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

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

6.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
审计费用	24,863.02
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行费用	1,730.00
账户维护费	18,000.00
上清所 CFCA 证书服务费	600.00
合计	104,865.36

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
中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	基金托管人
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
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

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行交易。

6.4.10.1.2 债券交易

6.4.10.1.3 债券回购交易

6.4.10.1.4 权证交易

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 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	638,482.53	646,034.78
其中：应支付销售机构的客户维护费	19,369.59	7,185.06
应支付基金管理人的净管理费	619,112.94	638,849.72

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.60%的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.60\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值。

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	159,620.57	161,508.68

注：基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.15% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
	华宝新飞跃混合
华宝基金	241,823.05
合计	241,823.05
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
	华宝新飞跃混合
华宝基金	261,218.64
合计	261,218.64

注：销售服务费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：日销售服务费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期内及上年度可比期间无转融通证券出借业务。

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

本基金本报告期内及上年度可比期间无转融通证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2024年6月30日		上年度末 2023年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份 额的比例 (%)	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份 额的比例 (%)
华宝投资有 限公司	94,603,500.00	73.91	104,603,500.00	84.40

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月 30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	1,700,445.18	7,223.66	4,820,625.86	9,558.93

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2024年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券 代码	证 券 名 称	成 功 认 购 日	受 限 期	流 通 受 限 类 型	认 购 价 格	期 末 估 值 单 价	数 量 （ 单 位： 股）	期 末 成 本 总 额	期 末 估 值 总 额	备 注

001359	平安电工	2024年3月19日	6个月	新股锁定	17.39	20.60	149	2,591.11	3,069.40	-
001379	腾达科技	2024年1月11日	6个月	新股锁定	16.98	13.48	176	2,988.48	2,372.48	-
001389	广合科技	2024年3月26日	6个月	新股锁定	17.43	34.56	185	3,224.55	6,393.60	-
301392	汇成真空	2024年5月28日	6个月	新股锁定	12.20	41.66	219	2,671.80	9,123.54	-
301502	华阳智能	2024年1月26日	6个月	新股锁定	28.01	37.83	138	3,865.38	5,220.54	-
301536	星辰科技	2024年3月20日	6个月	新股锁定	16.16	32.27	428	6,916.48	13,811.56	-
301538	骏鼎达	2024年3月13日	6个月	新股锁定	55.82	91.24	107	5,972.74	9,762.68	-
301538	骏鼎达	2024年5月22日	3个月	新股锁定-送股	-	91.24	43	-	3,923.32	-
301539	宏鑫科技	2024年4月3日	6个月	新股锁定	10.64	19.82	361	3,841.04	7,155.02	-
301565	中仑新材	2024年6月13日	6个月	新股锁定	11.88	18.98	454	5,393.52	8,616.92	-
301566	达利凯普	2023年12月22日	6个月	新股锁定	8.90	16.97	576	5,126.40	9,774.72	-

301580	爱迪特	2024年6月19日	6个月	新股锁定	44.95	65.93	119	5,349.05	7,845.67	-
301587	中瑞股份	2024年3月27日	6个月	新股锁定	21.73	25.26	266	5,780.18	6,719.16	-
301588	美新科技	2024年3月6日	6个月	新股锁定	14.50	21.25	257	3,726.50	5,461.25	-
603082	北自科技	2024年1月23日	6个月	新股锁定	21.28	29.49	96	2,042.88	2,831.04	-
603285	键邦股份	2024年6月28日	6个月	新股锁定	18.65	18.65	101	1,883.65	1,883.65	-
603285	键邦股份	2024年6月28日	1个月内(含)	新股流通受限	18.65	18.65	907	16,915.55	16,915.55	-
603312	西典新能	2024年1月4日	6个月	新股锁定	29.02	25.36	86	2,495.72	2,180.96	-
603325	博隆技术	2024年1月3日	6个月	新股锁定	72.46	68.06	36	2,608.56	2,450.16	-
603350	安乃达	2024年6月26日	6个月	新股锁定	20.56	20.56	103	2,117.68	2,117.68	-
603350	安乃达	2024年6月26日	1个月内(含)	新股流通受限	20.56	20.56	924	18,997.44	18,997.44	-
603381	永臻股份	2024年6月19日	6个月	新股锁定	23.35	25.13	82	1,914.70	2,060.66	-

688530	欧莱新材	2024年4月29日	6个月	新股锁定	9.60	16.10	344	3,302.40	5,538.40	-
688584	XD上海合	2024年2月1日	6个月	新股锁定	22.66	15.89	363	8,225.58	5,768.07	-
688691	灿芯股份	2024年4月2日	6个月	新股锁定	19.86	42.51	236	4,686.96	10,032.36	-
688692	达梦数据	2024年6月4日	6个月	新股锁定	86.96	174.93	70	6,087.20	12,245.10	-
688695	中创股份	2024年3月6日	6个月	新股锁定	22.43	31.55	186	4,171.98	5,868.30	-
688709	成都华微	2024年1月31日	6个月	新股锁定	15.69	18.79	439	6,887.91	8,248.81	-

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

本基金是一只主动投资的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。本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	13,674,729.18	13,762,292.05
合计	13,674,729.18	13,762,292.05

注：债券信用评级取自第三方评级机构的债项评级。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
AAA	62,027,309.49	71,285,908.20
AAA 以下	-	7,546,323.97
未评级	15,288,918.63	-

合计	77,316,228.12	78,832,232.17
----	---------------	---------------

注：债券信用评级取自第三方评级机构的债项评级。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于本报告期末，除附注中列示的卖出回购金融资产款将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)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时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%，本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

本报告期内，基金管理人坚持组合管理、分散投资的基本原则，严格按照法律法规的有关规定和基金合同约定的投资范围与比例限制实施投资管理。本基金所持大部分证券在证券交易所上市或银行间同业市场交易，不存在具有重大流动性风险的投资品种。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度，按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

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。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货币资金、结算备付金、存出保证金、债券投资及买入返售金融资产等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	1,700,445.18	-	-	-	1,700,445.18
结算备付金	4,122,845.42	-	-	-	4,122,845.42
存出保证金	8,381.29	-	-	2,227,176.00	2,235,557.29
交易性金融资产	34,122,894.67	56,868,062.63	-	126,286,552.50	217,277,509.80
买入返售金融资产	21,616,000.00	-	-	-	21,616,000.00
应收申购款	-	-	-	22,678.25	22,678.25
应收清算款	-	-	-	3,978.75	3,978.75
资产总计	61,570,566.56	56,868,062.63	-	128,540,385.50	246,979,014.69
负债					
应付赎回款	-	-	-	157,828.31	157,828.31
应付管理人报酬	-	-	-	104,371.81	104,371.81
应付托管费	-	-	-	26,092.96	26,092.96
应付清算款	-	-	-	84,886.28	84,886.28
应付销售服务费	-	-	-	43,488.24	43,488.24
应交税费	-	-	-	1,521.63	1,521.63
其他负债	-	-	-	197,784.66	197,784.66
负债总计	-	-	-	615,973.89	615,973.89
利率敏感度缺口	61,570,566.56	56,868,062.63	-	127,924,411.61	246,363,040.80
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	15,922,078.61	-	-	-	15,922,078.61
结算备付金	1,765,016.96	-	-	-	1,765,016.96
存出保证金	19,961.61	-	-	1,240,632.00	1,260,593.61
交易性金融资产	64,670,086.59	24,596,535.99	3,327,901.64	124,296,728.67	216,891,252.89
买入返售金融资产	9,913,000.00	-	-	-	9,913,000.00
应收申购款	-	-	-	9,380.00	9,380.00
资产总计	92,290,143.77	24,596,535.99	3,327,901.64	125,546,740.67	245,761,322.07
负债					
应付赎回款	-	-	-	3,375.39	3,375.39
应付管理人报酬	-	-	-	116,354.79	116,354.79
应付托管费	-	-	-	29,088.70	29,088.70
应付清算款	-	-	-	14,041,923.43	14,041,923.43
应付销售服务费	-	-	-	48,481.14	48,481.14
应交税费	-	-	-	36,186.79	36,186.79
其他负债	-	-	-	323,797.36	323,797.36
负债总计	-	-	-	14,599,207.60	14,599,207.60
利率敏感度缺口	92,290,143.77	24,596,535.99	3,327,901.64	110,947,533.07	231,162,114.47

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）
	2. 市场利率下降 25个基点	502,503.30	226,702.70
1. 市场利率上升 25个基点	-500,911.08	-225,082.43	

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下和自下而上相结合”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及投资组合构建的策略；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于股票的比例为基金资产的 0-95%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日		上年度末 2023年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	126,286,552.50	51.26	124,296,728.67	53.77
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	126,286,552.50	51.26	124,296,728.67	53.77

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）
	1. 业绩比较基准上升5%	11,754,118.41	9,723,526.88
	2. 业绩比较基准下降5%	-11,754,118.41	-9,723,526.88

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

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

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
第一层次	126,090,164.46	130,873,106.77
第二层次	91,030,871.62	85,070,706.25
第三层次	156,473.72	947,439.87
合计	217,277,509.80	216,891,252.89

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	126,286,552.50	51.13
	其中：股票	126,286,552.50	51.13
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	90,990,957.30	36.84
	其中：债券	90,990,957.30	36.84
	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	21,616,000.00	8.75
	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	5,823,290.60	2.36
8	其他各项资产	2,262,214.29	0.92
9	合计	246,979,014.69	100.00

注：本基金本报告期末“固定收益投资”、“买入返售金融资产”、“银行存款和结算备付金合计”等项目的列报金额已包含对应的“应计利息”和“减值准备”（若有），“其他资产”中的“应收利息”指本基金截至本报告期末已过付息期但尚未收到的利息金额（下同）。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	1,545,829.00	0.63
B	采矿业	11,610,441.00	4.71
C	制造业	69,494,821.56	28.21
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,438,871.00	2.21
E	建筑业	2,276,276.00	0.92
F	批发和零售业	1,100,521.32	0.45
G	交通运输、仓储和邮政业	5,465,823.16	2.22
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,538,139.36	1.44
J	金融业	24,252,579.98	9.84

K	房地产业	409,879.00	0.17
L	租赁和商务服务业	368,342.12	0.15
M	科学研究和技术服务业	19,635.00	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	73,471.00	0.03
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	10,332.00	0.00
R	文化、体育和娱乐业	681,591.00	0.28
S	综合	-	-
	合计	126,286,552.50	51.26

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
1	600519	贵州茅台	5,200	7,630,428.00	3.10
2	300750	宁德时代	23,620	4,252,308.60	1.73
3	601328	交通银行	503,000	3,757,410.00	1.53
4	601988	中国银行	701,400	3,240,468.00	1.32
5	000333	美的集团	41,201	2,657,464.50	1.08
6	001965	招商公路	223,866	2,655,050.76	1.08
7	600938	中国海油	75,804	2,501,532.00	1.02
8	000933	神火股份	121,600	2,459,968.00	1.00
9	601899	紫金矿业	138,200	2,428,174.00	0.99
10	600900	长江电力	82,900	2,397,468.00	0.97
11	002475	立讯精密	59,299	2,331,043.69	0.95
12	601288	农业银行	437,900	1,909,244.00	0.77
13	002371	北方华创	5,700	1,823,373.00	0.74
14	000776	广发证券	142,200	1,730,574.00	0.70
15	000651	格力电器	39,100	1,533,502.00	0.62
16	300498	温氏股份	76,400	1,514,248.00	0.61
17	601398	工商银行	257,800	1,469,460.00	0.60
18	600919	江苏银行	192,000	1,426,560.00	0.58
19	000568	泸州老窖	9,900	1,420,551.00	0.58
20	000725	京东方 A	334,000	1,366,060.00	0.55
21	601318	中国平安	32,900	1,360,744.00	0.55
22	000157	中联重科	176,000	1,351,680.00	0.55
23	600276	恒瑞医药	34,900	1,342,254.00	0.54
24	601668	中国建筑	251,600	1,335,996.00	0.54
25	002415	海康威视	41,900	1,295,129.00	0.53

26	300274	阳光电源	20,260	1,256,727.80	0.51
27	002594	比亚迪	4,900	1,226,225.00	0.50
28	000596	古井贡酒	5,800	1,224,206.00	0.50
29	002966	苏州银行	161,300	1,209,750.00	0.49
30	688981	中芯国际	26,160	1,205,976.00	0.49
31	300059	东方财富	109,468	1,155,982.08	0.47
32	600941	中国移动	10,700	1,150,250.00	0.47
33	002179	中航光电	29,472	1,121,409.60	0.46
34	000937	冀中能源	165,100	1,106,170.00	0.45
35	600150	中国船舶	25,500	1,038,105.00	0.42
36	000858	五粮液	7,800	998,712.00	0.41
37	600028	中国石化	157,200	993,504.00	0.40
38	000975	山金国际	60,300	982,287.00	0.40
39	600750	江中药业	42,100	972,931.00	0.39
40	300308	中际旭创	7,020	967,917.60	0.39
41	601319	中国人保	185,900	957,385.00	0.39
42	002422	科伦药业	31,500	955,395.00	0.39
43	600309	万华化学	10,800	873,288.00	0.35
44	601211	国泰君安	63,700	863,135.00	0.35
45	601088	中国神华	19,100	847,467.00	0.34
46	601857	中国石油	80,200	827,664.00	0.34
47	601225	陕西煤业	31,200	804,024.00	0.33
48	600285	羚锐制药	33,000	798,930.00	0.32
49	002126	银轮股份	45,000	783,450.00	0.32
50	601628	中国人寿	24,700	766,935.00	0.31
51	600030	中信证券	40,300	734,669.00	0.30
52	300124	汇川技术	14,000	718,200.00	0.29
53	600989	宝丰能源	41,000	710,530.00	0.29
54	600025	华能水电	65,200	702,856.00	0.29
55	601985	中国核电	64,700	689,702.00	0.28
56	600737	中粮糖业	69,500	666,505.00	0.27
57	601006	大秦铁路	91,200	652,992.00	0.27
58	002270	华明装备	29,200	649,408.00	0.26
59	000338	潍柴动力	39,000	633,360.00	0.26
60	601169	XD北京银	106,000	619,040.00	0.25
61	000063	中兴通讯	21,500	601,355.00	0.24
62	002533	金杯电工	60,000	597,000.00	0.24
63	600489	中金黄金	40,100	593,480.00	0.24
64	000538	云南白药	11,440	585,156.00	0.24
65	300760	迈瑞医疗	2,000	581,820.00	0.24
66	600350	山东高速	65,000	575,250.00	0.23
67	000100	TCL科技	129,650	560,088.00	0.23
68	000938	紫光股份	24,900	556,515.00	0.23

69	600660	福耀玻璃	11,600	555,640.00	0.23
70	002230	科大讯飞	12,600	541,170.00	0.22
71	000963	华东医药	19,400	539,514.00	0.22
72	601000	唐山港	113,100	531,570.00	0.22
73	002142	宁波银行	23,300	513,998.00	0.21
74	002601	龙佰集团	26,800	497,676.00	0.20
75	002540	亚太科技	94,000	497,260.00	0.20
76	000090	天健集团	122,500	492,450.00	0.20
77	601229	上海银行	67,200	487,872.00	0.20
78	002821	凯莱英	7,380	485,604.00	0.20
79	601728	中国电信	77,200	474,780.00	0.19
80	000625	长安汽车	33,400	448,562.00	0.18
81	003816	中国广核	96,500	446,795.00	0.18
82	002648	卫星化学	24,100	433,318.00	0.18
83	000977	浪潮信息	11,900	432,803.00	0.18
84	688012	中微公司	3,000	423,780.00	0.17
85	603019	中科曙光	9,800	406,700.00	0.17
86	603986	兆易创新	4,200	401,604.00	0.16
87	600104	上汽集团	28,700	397,782.00	0.16
88	600398	海澜之家	43,000	397,320.00	0.16
89	601658	邮储银行	75,500	382,785.00	0.16
90	601872	招商轮船	45,100	381,095.00	0.15
91	600373	中文传媒	25,600	379,904.00	0.15
92	600886	国投电力	20,700	377,568.00	0.15
93	600050	中国联通	79,900	375,530.00	0.15
94	600406	国电南瑞	14,600	364,416.00	0.15
95	600674	川投能源	19,400	363,750.00	0.15
96	600741	华域汽车	21,300	348,894.00	0.14
97	002920	德赛西威	4,000	348,360.00	0.14
98	600031	三一重工	20,700	341,550.00	0.14
99	000425	徐工机械	46,600	333,190.00	0.14
100	000895	双汇发展	14,000	332,780.00	0.14
101	600584	长电科技	10,400	329,784.00	0.13
102	000429	粤高速 A	31,600	328,956.00	0.13
103	600585	海螺水泥	13,900	327,901.00	0.13
104	000932	华菱钢铁	73,800	326,934.00	0.13
105	601012	隆基绿能	22,580	316,571.60	0.13
106	300129	泰胜风能	46,300	315,766.00	0.13
107	002236	大华股份	20,200	312,292.00	0.13
108	002327	富安娜	30,900	310,545.00	0.13
109	300054	鼎龙股份	13,000	294,840.00	0.12
110	605368	蓝天燃气	21,500	293,260.00	0.12
111	600188	兖矿能源	12,700	288,671.00	0.12

112	601186	中国铁建	32,100	275,097.00	0.11
113	600015	华夏银行	42,700	273,280.00	0.11
114	688111	金山办公	1,200	273,000.00	0.11
115	002384	东山精密	13,000	269,100.00	0.11
116	002600	领益智造	37,400	266,288.00	0.11
117	002050	三花智控	13,900	265,212.00	0.11
118	002049	紫光国微	4,920	258,792.00	0.11
119	601688	华泰证券	20,600	255,234.00	0.10
120	688036	传音控股	3,319	254,036.26	0.10
121	000786	北新建材	8,300	246,178.00	0.10
122	300033	同花顺	2,300	238,510.00	0.10
123	600887	伊利股份	9,100	235,144.00	0.10
124	002372	伟星新材	15,200	234,384.00	0.10
125	601901	方正证券	30,000	231,900.00	0.09
126	002737	葵花药业	9,900	231,462.00	0.09
127	600007	中国国贸	10,500	230,580.00	0.09
128	002818	富森美	18,500	226,810.00	0.09
129	002139	拓邦股份	21,100	224,082.00	0.09
130	600426	华鲁恒升	8,400	223,776.00	0.09
131	002531	天顺风能	24,600	219,924.00	0.09
132	600282	南钢股份	43,400	216,132.00	0.09
133	300782	卓胜微	2,500	194,350.00	0.08
134	300661	圣邦股份	2,300	190,394.00	0.08
135	600085	同仁堂	4,800	183,408.00	0.07
136	601928	凤凰传媒	16,700	183,032.00	0.07
137	601998	XD 中信银	27,200	182,240.00	0.07
138	000001	平安银行	17,700	179,655.00	0.07
139	601689	拓普集团	3,100	166,191.00	0.07
140	000708	中信特钢	11,400	154,698.00	0.06
141	688396	华润微	4,000	149,760.00	0.06
142	002555	三七互娱	10,500	137,025.00	0.06
143	300783	三只松鼠	6,200	135,594.00	0.06
144	603605	珀莱雅	1,200	133,188.00	0.05
145	601636	旗滨集团	16,700	107,715.00	0.04
146	000528	柳 工	9,600	107,424.00	0.04
147	600801	华新水泥	6,600	90,750.00	0.04
148	600219	南山铝业	21,100	80,391.00	0.03
149	000860	顺鑫农业	4,700	78,678.00	0.03
150	688169	石头科技	200	78,520.00	0.03
151	600066	宇通客车	2,900	74,820.00	0.03
152	601919	中远海控	4,300	66,607.00	0.03
153	300628	亿联网络	1,800	66,186.00	0.03
154	600480	凌云股份	6,700	65,861.00	0.03

155	601058	赛轮轮胎	4,600	64,400.00	0.03
156	002948	青岛银行	18,100	60,997.00	0.02
157	600420	国药现代	5,700	60,876.00	0.02
158	603236	移远通信	1,300	60,749.00	0.02
159	600690	海尔智家	2,100	59,598.00	0.02
160	603871	嘉友国际	3,360	59,438.40	0.02
161	603161	DR 科华控	3,900	58,383.00	0.02
162	002165	红宝丽	17,600	58,080.00	0.02
163	300251	光线传媒	6,800	57,188.00	0.02
164	600872	中炬高新	2,500	56,725.00	0.02
165	600761	安徽合力	2,600	56,264.00	0.02
166	000517	荣安地产	20,700	55,476.00	0.02
167	600966	博汇纸业	11,400	54,492.00	0.02
168	002532	天山铝业	6,700	54,337.00	0.02
169	002697	红旗连锁	11,700	54,171.00	0.02
170	000830	鲁西化工	4,400	50,996.00	0.02
171	603726	朗迪集团	3,800	50,920.00	0.02
172	603228	景旺电子	1,600	50,880.00	0.02
173	000758	中色股份	10,000	50,800.00	0.02
174	601975	招商南油	13,700	49,183.00	0.02
175	688389	普门科技	3,022	49,137.72	0.02
176	601615	明阳智能	5,200	49,088.00	0.02
177	603993	洛阳钼业	5,700	48,450.00	0.02
178	300428	立中集团	2,600	48,334.00	0.02
179	300677	英科医疗	1,800	48,258.00	0.02
180	601916	浙商银行	17,100	47,196.00	0.02
181	601126	四方股份	2,400	46,128.00	0.02
182	002078	太阳纸业	3,300	46,035.00	0.02
183	688208	道通科技	1,900	45,866.00	0.02
184	600284	浦东建设	8,400	44,856.00	0.02
185	600916	中国黄金	4,600	44,252.00	0.02
186	002035	华帝股份	7,000	43,610.00	0.02
187	603160	汇顶科技	600	41,250.00	0.02
188	688226	威腾电气	2,350	41,078.00	0.02
189	603025	大豪科技	2,900	40,078.00	0.02
190	603766	隆鑫通用	5,900	40,002.00	0.02
191	300836	佰奥智能	1,000	39,790.00	0.02
192	601933	永辉超市	15,900	39,432.00	0.02
193	301429	森泰股份	2,500	38,250.00	0.02
194	688578	艾力斯	600	38,244.00	0.02
195	603323	苏农银行	7,900	37,999.00	0.02
196	603486	科沃斯	800	37,744.00	0.02
197	003019	宸展光电	1,470	37,235.10	0.02

198	603733	仙鹤股份	2,100	36,918.00	0.01
199	000703	恒逸石化	5,100	36,159.00	0.01
200	600262	北方股份	2,200	36,146.00	0.01
201	603348	文灿股份	1,300	35,997.00	0.01
202	000551	创元科技	4,100	35,793.00	0.01
203	002027	分众传媒	5,900	35,754.00	0.01
204	300868	杰美特	1,700	35,615.00	0.01
205	002979	雷赛智能	1,900	34,580.00	0.01
206	002274	华昌化工	4,600	34,132.00	0.01
207	301036	双乐股份	1,300	33,826.00	0.01
208	000915	华特达因	1,100	33,176.00	0.01
209	600267	海正药业	4,700	32,994.00	0.01
210	002984	森麒麟	1,360	32,762.40	0.01
211	000921	海信家电	1,000	32,240.00	0.01
212	300226	上海钢联	1,900	32,186.00	0.01
213	605208	永茂泰	5,100	31,773.00	0.01
214	002215	诺普信	4,200	31,290.00	0.01
215	601886	江河集团	6,400	31,232.00	0.01
216	600327	大东方	9,600	30,720.00	0.01
217	603368	柳药集团	1,700	29,750.00	0.01
218	605081	太和水	2,500	29,225.00	0.01
219	688016	心脉医疗	298	29,218.90	0.01
220	300115	长盈精密	2,400	28,776.00	0.01
221	600711	盛屯矿业	7,800	28,626.00	0.01
222	300743	天地数码	2,100	28,434.00	0.01
223	301308	江波龙	300	28,422.00	0.01
224	300144	宋城演艺	3,500	28,105.00	0.01
225	601567	三星医疗	800	28,000.00	0.01
226	688018	乐鑫科技	280	27,630.40	0.01
227	601138	工业富联	1,000	27,400.00	0.01
228	600863	内蒙华电	5,900	27,376.00	0.01
229	601918	新集能源	2,800	27,300.00	0.01
230	601600	中国铝业	3,400	25,942.00	0.01
231	300241	瑞丰光电	6,300	25,830.00	0.01
232	300207	欣旺达	1,700	25,789.00	0.01
233	300872	天阳科技	1,900	25,175.00	0.01
234	002409	雅克科技	400	25,164.00	0.01
235	600531	豫光金铅	3,900	25,116.00	0.01
236	600469	风神股份	4,300	25,112.00	0.01
237	002008	大族激光	1,200	24,960.00	0.01
238	688029	南微医学	400	24,624.00	0.01
239	000990	诚志股份	3,300	24,552.00	0.01
240	601618	中国中冶	7,900	24,490.00	0.01

241	300529	健帆生物	900	24,489.00	0.01
242	000887	中鼎股份	2,000	24,480.00	0.01
243	600125	铁龙物流	4,100	24,477.00	0.01
244	002583	海能达	6,000	24,420.00	0.01
245	300679	电连技术	600	24,138.00	0.01
246	002876	三利谱	1,000	24,120.00	0.01
247	000923	河钢资源	1,400	24,108.00	0.01
248	002061	浙江交科	6,600	24,090.00	0.01
249	603893	瑞芯微	400	23,668.00	0.01
250	601528	瑞丰银行	5,000	23,600.00	0.01
251	300005	探路者	4,700	23,547.00	0.01
252	002019	亿帆医药	1,900	23,484.00	0.01
253	601113	华鼎股份	7,000	22,960.00	0.01
254	000581	威孚高科	1,400	22,792.00	0.01
255	688159	有方科技	600	22,716.00	0.01
256	601609	金田股份	4,000	22,640.00	0.01
257	000735	罗牛山	5,200	22,516.00	0.01
258	000848	承德露露	2,800	22,008.00	0.01
259	300482	万孚生物	900	21,960.00	0.01
260	300953	震裕科技	400	21,680.00	0.01
261	002787	华源控股	3,200	21,632.00	0.01
262	002277	友阿股份	10,000	21,600.00	0.01
263	600158	中体产业	2,800	21,532.00	0.01
264	600861	北京人力	1,300	21,216.00	0.01
265	603350	安乃达	1,027	21,115.12	0.01
266	603897	长城科技	1,200	21,060.00	0.01
267	600335	国机汽车	3,600	20,772.00	0.01
268	600699	均胜电子	1,400	20,748.00	0.01
269	688022	瀚川智能	1,500	20,565.00	0.01
270	002556	辉隆股份	4,900	20,433.00	0.01
271	300841	康华生物	400	20,256.00	0.01
272	300130	新国都	1,200	19,968.00	0.01
273	603501	韦尔股份	200	19,874.00	0.01
274	002557	洽洽食品	700	19,733.00	0.01
275	002191	劲嘉股份	5,400	19,494.00	0.01
276	300842	帝科股份	500	19,400.00	0.01
277	605258	协和电子	600	18,816.00	0.01
278	603285	C键邦	1,008	18,799.20	0.01
279	600719	大连热电	1,800	17,982.00	0.01
280	300386	飞天诚信	1,700	17,697.00	0.01
281	600575	淮河能源	4,400	17,116.00	0.01
282	300401	花园生物	1,100	15,774.00	0.01
283	600312	平高电气	800	15,560.00	0.01

284	002273	水晶光电	900	15,282.00	0.01
285	688253	英诺特	400	15,244.00	0.01
286	600795	国电电力	2,500	14,975.00	0.01
287	300752	隆利科技	1,100	14,938.00	0.01
288	301012	扬电科技	600	14,856.00	0.01
289	301388	欣灵电气	600	14,826.00	0.01
290	600183	生益科技	700	14,742.00	0.01
291	300817	双飞股份	1,375	14,602.50	0.01
292	603050	科林电气	600	14,556.00	0.01
293	601233	桐昆股份	900	14,364.00	0.01
294	300947	德必集团	1,000	14,300.00	0.01
295	300644	南京聚隆	700	14,266.00	0.01
296	601156	东航物流	700	14,245.00	0.01
297	603129	春风动力	100	14,234.00	0.01
298	003006	百亚股份	600	14,220.00	0.01
299	000543	皖能电力	1,600	14,160.00	0.01
300	601128	常熟银行	1,870	14,155.90	0.01
301	603328	依顿电子	1,800	14,148.00	0.01
302	002311	海大集团	300	14,115.00	0.01
303	300458	全志科技	600	14,106.00	0.01
304	300200	高盟新材	1,800	14,004.00	0.01
305	600269	赣粤高速	2,700	13,959.00	0.01
306	600461	洪城环境	1,200	13,896.00	0.01
307	000875	吉电股份	2,600	13,858.00	0.01
308	001331	胜通能源	1,000	13,850.00	0.01
309	301536	星辰科技	428	13,811.56	0.01
310	301192	泰祥股份	800	13,808.00	0.01
311	002244	滨江集团	1,900	13,794.00	0.01
312	301538	骏鼎达	150	13,686.00	0.01
313	603267	鸿远电子	400	13,640.00	0.01
314	002571	德力股份	2,800	13,636.00	0.01
315	605376	博迁新材	600	13,542.00	0.01
316	000598	兴蓉环境	1,800	13,536.00	0.01
317	603836	海程邦达	1,000	13,470.00	0.01
318	301448	开创电气	650	13,468.00	0.01
319	601816	京沪高铁	2,500	13,425.00	0.01
320	301099	雅创电子	300	13,395.00	0.01
321	300521	爱司凯	1,300	13,390.00	0.01
322	601665	齐鲁银行	2,700	13,257.00	0.01
323	300855	图南股份	500	13,220.00	0.01
324	601001	晋控煤业	800	13,216.00	0.01
325	600491	龙元建设	4,800	13,152.00	0.01
326	000027	深圳能源	1,800	13,140.00	0.01

327	002106	莱宝高科	1,200	13,080.00	0.01
328	600926	杭州银行	1,000	13,050.00	0.01
329	300808	久量股份	800	13,032.00	0.01
329	600211	西藏药业	400	13,032.00	0.01
330	300100	双林股份	1,200	12,924.00	0.01
331	300933	中辰股份	2,100	12,915.00	0.01
332	300476	胜宏科技	400	12,904.00	0.01
333	300758	七彩化学	1,200	12,900.00	0.01
334	688510	航亚科技	700	12,887.00	0.01
335	002267	陕天然气	1,700	12,852.00	0.01
336	605111	新洁能	420	12,847.80	0.01
337	300102	乾照光电	2,000	12,840.00	0.01
338	601311	骆驼股份	1,600	12,832.00	0.01
339	301380	挖金客	400	12,816.00	0.01
340	300856	科思股份	400	12,804.00	0.01
341	600908	无锡银行	2,400	12,768.00	0.01
342	688799	华纳药厂	300	12,729.00	0.01
343	601333	广深铁路	3,900	12,636.00	0.01
344	600901	江苏金租	2,500	12,625.00	0.01
345	605196	华通线缆	1,200	12,624.00	0.01
346	301507	民生健康	1,000	12,620.00	0.01
347	000423	东阿阿胶	200	12,520.00	0.01
348	002111	威海广泰	1,200	12,504.00	0.01
349	300285	国瓷材料	700	12,495.00	0.01
349	300307	慈星股份	2,100	12,495.00	0.01
350	002839	张家港行	3,100	12,462.00	0.01
351	600820	隧道股份	1,900	12,407.00	0.01
352	002550	千红制药	2,300	12,397.00	0.01
353	605128	上海沿浦	444	12,383.16	0.01
354	002296	辉煌科技	1,200	12,372.00	0.01
355	603299	苏盐井神	1,300	12,350.00	0.01
356	002958	青农商行	4,600	12,328.00	0.01
356	301011	华立科技	800	12,328.00	0.01
357	600017	日照港	4,600	12,282.00	0.00
358	603995	甬金股份	700	12,264.00	0.00
359	688692	达梦数据	70	12,245.10	0.00
360	300950	德固特	800	12,192.00	0.00
361	300790	宇瞳光学	900	12,150.00	0.00
362	600132	重庆啤酒	200	12,140.00	0.00
363	002991	甘源食品	200	12,130.00	0.00
364	601997	贵阳银行	2,300	12,121.00	0.00
365	002053	云南能投	1,000	12,090.00	0.00
365	002745	木林森	1,500	12,090.00	0.00

365	301199	迈赫股份	500	12,090.00	0.00
366	603338	浙江鼎力	200	12,084.00	0.00
367	600697	欧亚集团	1,200	12,060.00	0.00
368	300737	科顺股份	2,800	12,040.00	0.00
369	600787	中储股份	2,500	12,025.00	0.00
370	001914	招商积余	1,200	12,024.00	0.00
371	002161	远望谷	2,600	12,012.00	0.00
371	002534	西子洁能	1,200	12,012.00	0.00
372	603699	XD 纽威股	700	11,984.00	0.00
373	002847	盐津铺子	280	11,975.60	0.00
374	300638	广和通	700	11,970.00	0.00
374	600320	振华重工	3,500	11,970.00	0.00
375	603588	高能环境	1,900	11,932.00	0.00
376	301118	恒光股份	800	11,928.00	0.00
377	002845	同兴达	900	11,898.00	0.00
378	688191	智洋创新	700	11,851.00	0.00
379	000155	川能动力	1,100	11,847.00	0.00
380	603727	博迈科	900	11,844.00	0.00
381	600684	珠江股份	4,500	11,835.00	0.00
382	688232	新点软件	600	11,832.00	0.00
383	300383	光环新网	1,400	11,830.00	0.00
383	603096	新经典	700	11,830.00	0.00
384	600399	抚顺特钢	2,100	11,823.00	0.00
384	601598	中国外运	2,100	11,823.00	0.00
385	002788	鹭燕医药	1,500	11,820.00	0.00
386	688520	神州细胞	300	11,805.00	0.00
387	002100	天康生物	1,700	11,781.00	0.00
388	600255	鑫科材料	6,800	11,764.00	0.00
389	002468	申通快递	1,400	11,760.00	0.00
390	603589	口子窖	300	11,757.00	0.00
391	002521	齐峰新材	1,000	11,750.00	0.00
392	301126	达嘉维康	1,300	11,739.00	0.00
393	300996	普联软件	800	11,736.00	0.00
394	300295	三六五网	1,300	11,674.00	0.00
395	603867	新化股份	500	11,665.00	0.00
396	600096	云天化	600	11,652.00	0.00
397	301280	珠城科技	300	11,640.00	0.00
398	300105	龙源技术	1,800	11,628.00	0.00
399	002245	蔚蓝锂芯	1,500	11,625.00	0.00
400	002442	龙星化工	2,700	11,610.00	0.00
401	600153	建发股份	1,300	11,609.00	0.00
402	600586	金晶科技	2,000	11,600.00	0.00
403	002755	奥赛康	1,200	11,580.00	0.00

404	688233	神工股份	600	11,562.00	0.00
405	600409	三友化工	2,300	11,546.00	0.00
406	002242	九阳股份	1,100	11,528.00	0.00
407	600967	内蒙一机	1,600	11,520.00	0.00
408	600114	东睦股份	800	11,512.00	0.00
409	300631	久吾高科	600	11,490.00	0.00
410	603612	索通发展	900	11,484.00	0.00
411	002340	格林美	1,800	11,466.00	0.00
412	600141	兴发集团	600	11,448.00	0.00
413	603518	XD 锦泓集	1,300	11,440.00	0.00
414	000927	中国铁物	4,800	11,424.00	0.00
415	002083	孚日股份	2,700	11,421.00	0.00
416	000488	晨鸣纸业	3,300	11,418.00	0.00
417	000926	福星股份	3,600	11,412.00	0.00
418	600864	哈投股份	2,400	11,400.00	0.00
419	300387	富邦股份	1,900	11,381.00	0.00
420	300463	迈克生物	1,000	11,380.00	0.00
421	002489	浙江永强	4,800	11,376.00	0.00
422	301098	金埔园林	1,500	11,355.00	0.00
423	002249	大洋电机	2,400	11,352.00	0.00
424	002146	荣盛发展	7,600	11,324.00	0.00
425	600475	华光环能	1,300	11,323.00	0.00
426	002376	新北洋	2,100	11,319.00	0.00
427	600223	福瑞达	1,600	11,312.00	0.00
428	000886	海南高速	2,700	11,286.00	0.00
429	000709	河钢股份	5,800	11,252.00	0.00
430	300973	立高食品	400	11,236.00	0.00
431	002423	中粮资本	1,500	11,235.00	0.00
432	002701	奥瑞金	2,700	11,232.00	0.00
433	000701	厦门信达	3,000	11,220.00	0.00
433	300194	福安药业	3,000	11,220.00	0.00
434	600293	三峡新材	4,500	11,205.00	0.00
435	601666	平煤股份	1,000	11,200.00	0.00
436	000797	中国武夷	4,800	11,184.00	0.00
436	603081	大丰实业	1,200	11,184.00	0.00
437	600729	重庆百货	500	11,180.00	0.00
438	600210	紫江企业	2,100	11,172.00	0.00
439	003023	彩虹集团	700	11,165.00	0.00
440	002615	哈尔斯	1,800	11,160.00	0.00
440	603967	中创物流	1,200	11,160.00	0.00
440	688139	海尔生物	300	11,160.00	0.00
441	600758	辽宁能源	3,900	11,154.00	0.00
442	600512	腾达建设	5,900	11,151.00	0.00

443	605333	沪光股份	400	11,140.00	0.00
444	300193	佳士科技	1,500	11,130.00	0.00
445	002394	联发股份	1,800	11,088.00	0.00
446	601038	一拖股份	700	11,067.00	0.00
447	000042	中洲控股	2,800	11,060.00	0.00
448	603601	再升科技	4,000	11,040.00	0.00
449	600073	光明肉业	2,000	11,020.00	0.00
450	603983	丸美股份	400	11,012.00	0.00
451	002921	联诚精密	1,100	11,011.00	0.00
452	300254	仟源医药	1,400	11,004.00	0.00
453	603298	杭叉集团	560	10,998.40	0.00
454	300883	龙利得	2,600	10,998.00	0.00
455	603877	太平鸟	800	10,984.00	0.00
456	600623	华谊集团	1,900	10,982.00	0.00
457	600682	南京新百	2,200	10,978.00	0.00
458	300598	诚迈科技	390	10,951.20	0.00
459	002462	嘉事堂	1,000	10,940.00	0.00
460	603529	爱玛科技	400	10,932.00	0.00
461	300119	瑞普生物	800	10,896.00	0.00
461	600707	彩虹股份	1,600	10,896.00	0.00
462	300076	GQY 视讯	3,400	10,880.00	0.00
463	600597	光明乳业	1,400	10,878.00	0.00
464	002668	TCL 智家	1,200	10,872.00	0.00
465	000550	江铃汽车	500	10,855.00	0.00
466	003000	劲仔食品	900	10,845.00	0.00
467	301131	聚赛龙	300	10,839.00	0.00
468	688659	元琛科技	1,800	10,800.00	0.00
469	002357	富临运业	2,100	10,773.00	0.00
470	601168	西部矿业	600	10,770.00	0.00
471	000061	农产品	2,200	10,692.00	0.00
472	600315	上海家化	600	10,668.00	0.00
473	300768	迪普科技	900	10,665.00	0.00
474	601163	三角轮胎	700	10,654.00	0.00
475	603156	养元饮品	500	10,635.00	0.00
476	002493	荣盛石化	1,100	10,626.00	0.00
477	000811	冰轮环境	1,100	10,615.00	0.00
478	688286	敏芯股份	223	10,614.80	0.00
479	002403	爱仕达	1,600	10,592.00	0.00
480	002799	环球印务	1,800	10,584.00	0.00
480	300685	艾德生物	600	10,584.00	0.00
481	300002	神州泰岳	1,300	10,556.00	0.00
481	600643	爱建集团	2,800	10,556.00	0.00
482	300771	智莱科技	1,200	10,548.00	0.00

483	603567	珍宝岛	1,000	10,530.00	0.00
484	603903	中持股份	1,500	10,515.00	0.00
485	603187	海容冷链	900	10,494.00	0.00
486	300815	玉禾田	900	10,476.00	0.00
487	002630	华西能源	4,900	10,388.00	0.00
488	002172	澳洋健康	4,200	10,332.00	0.00
489	300390	天华新能	600	10,308.00	0.00
490	002565	顺灏股份	4,300	10,277.00	0.00
491	603611	诺力股份	600	10,224.00	0.00
492	002099	海翔药业	2,000	10,220.00	0.00
493	688222	成都先导	900	10,215.00	0.00
494	002437	誉衡药业	6,000	10,200.00	0.00
495	000589	贵州轮胎	2,000	10,140.00	0.00
496	300587	天铁股份	2,500	10,100.00	0.00
497	600201	生物股份	1,400	10,094.00	0.00
498	300203	聚光科技	1,000	10,090.00	0.00
499	600998	九州通	2,064	10,072.32	0.00
500	000930	中粮科技	2,000	10,060.00	0.00
501	688691	灿芯股份	236	10,032.36	0.00
502	002420	毅昌科技	2,200	10,032.00	0.00
503	000069	华侨城 A	4,900	9,996.00	0.00
504	000965	天保基建	3,800	9,956.00	0.00
505	600605	汇通能源	400	9,952.00	0.00
506	300652	雷迪克	500	9,915.00	0.00
507	002345	潮宏基	2,100	9,912.00	0.00
508	603613	国联股份	500	9,805.00	0.00
509	000757	浩物股份	3,900	9,789.00	0.00
510	301566	达利凯普	576	9,774.72	0.00
511	688186	广大特材	1,000	9,730.00	0.00
512	300662	科锐国际	600	9,678.00	0.00
513	002602	世纪华通	2,800	9,604.00	0.00
514	002570	贝因美	4,100	9,594.00	0.00
515	300492	华图山鼎	100	9,420.00	0.00
515	600557	康缘药业	600	9,420.00	0.00
516	603369	今世缘	200	9,240.00	0.00
517	002068	黑猫股份	1,300	9,230.00	0.00
518	301392	汇成真空	219	9,123.54	0.00
519	300511	雪榕生物	3,500	9,065.00	0.00
520	002727	一心堂	600	9,054.00	0.00
521	603939	益丰药房	360	8,838.00	0.00
522	301565	中仑新材	454	8,616.92	0.00
523	002919	名臣健康	720	8,359.20	0.00
524	688709	成都华微	439	8,248.81	0.00

525	002304	洋河股份	100	8,074.00	0.00
526	301580	爱迪特	119	7,845.67	0.00
527	301539	宏鑫科技	361	7,155.02	0.00
528	301587	中瑞股份	266	6,719.16	0.00
529	001389	广合科技	185	6,393.60	0.00
530	301486	致尚科技	145	6,134.95	0.00
531	688695	中创股份	186	5,868.30	0.00
532	688584	上海合晶	363	5,768.07	0.00
533	688530	欧莱新材	344	5,538.40	0.00
534	301588	美新科技	257	5,461.25	0.00
535	301502	华阳智能	138	5,220.54	0.00
536	301525	儒竞科技	69	3,883.32	0.00
537	001359	平安电工	149	3,069.40	0.00
538	603082	北自科技	96	2,831.04	0.00
539	603325	博隆技术	36	2,450.16	0.00
540	603373	安邦护卫	88	2,419.12	0.00
541	001379	腾达科技	176	2,372.48	0.00
542	603312	西典新能	86	2,180.96	0.00
543	301578	辰奕智能	54	2,136.78	0.00
544	603381	永臻股份	82	2,060.66	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	600519	贵州茅台	1,168,824.00	0.51
2	000425	徐工机械	623,778.00	0.27
3	600750	江中药业	623,488.00	0.27
4	601318	中国平安	557,288.00	0.24
5	000725	京东方 A	511,533.00	0.22
6	002422	科伦药业	509,829.00	0.22
7	300750	宁德时代	505,668.00	0.22
8	601988	中国银行	452,640.00	0.20
9	600036	招商银行	411,148.00	0.18
10	600309	万华化学	388,867.00	0.17
11	600031	三一重工	361,745.00	0.16
12	601328	XD 交通银	361,226.00	0.16
13	688036	传音控股	341,940.61	0.15
14	600886	国投电力	339,856.00	0.15
15	601899	紫金矿业	338,521.00	0.15
16	002179	中航光电	320,469.00	0.14
17	300308	中际旭创	310,016.00	0.13
18	600900	长江电力	305,306.00	0.13

19	601186	中国铁建	292,908.00	0.13
20	000651	格力电器	291,390.00	0.13

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	002966	苏州银行	915,736.00	0.40
2	601211	国泰君安	691,347.00	0.30
3	603259	药明康德	615,126.84	0.27
4	600519	贵州茅台	607,212.00	0.26
5	601318	中国平安	582,179.00	0.25
6	600085	同仁堂	578,753.00	0.25
7	001979	招商蛇口	551,176.00	0.24
8	600760	中航沈飞	528,292.40	0.23
9	600011	华能国际	474,733.00	0.21
10	300316	晶盛机电	472,150.00	0.20
11	000651	格力电器	445,194.00	0.19
12	601899	紫金矿业	440,707.00	0.19
13	300122	智飞生物	436,661.00	0.19
14	600036	招商银行	414,523.00	0.18
15	002459	晶澳科技	379,991.92	0.16
16	001965	招商公路	357,233.00	0.15
17	688777	中控技术	339,299.49	0.15
18	601898	中煤能源	320,528.00	0.14
19	002594	比亚迪	292,960.00	0.13
20	600153	建发股份	292,818.00	0.13

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	55,490,871.03
卖出股票收入（成交）总额	58,603,394.17

注：买入股票成本、卖出股票收入均不包括相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	18,821,875.76	7.64
2	央行票据	-	-
3	金融债券	51,720,916.05	20.99
	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	20,448,165.49	8.30
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	90,990,957.30	36.93

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	232380004	23 农行二级 资本债 01A	100,000	10,563,493.15	4.29
2	092280065	22 工行二级 资本债 03A	100,000	10,525,274.32	4.27
3	092280108	22 中行二级 资本债 02A	100,000	10,482,367.21	4.25
4	019709	23 国债 16	103,000	10,460,835.21	4.25
5	101901644	19 宁波港 MTN001	100,000	10,306,393.44	4.18

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

基金主要利用股指期货进行套期保值或仓位调节操作。当进行空头套期保值时，基金持有的卖出股指期货合约价值，不超过基金持有的股票总市值的 20%，基金通过空头套期保值，一定程度上可以规避市场的系统性风险。当进行多头仓位调节时，基金持有的买入股指期货合约价值，不超过基金资产净值的 10%，基金通过持有股指期货多头合约对股票资产进行替代，可以提高投资效率，赚取或有的基差收益和实现更好的头寸管理。截止报告期末，本基金对股指期货的投资符合基金合同的约定，符合既定的投资政策和投资目标。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金未投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

华宝新飞跃混合截止 2024 年 06 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中,中国农业银行股份有限公司因:一、农户贷款发放后流入房地产企业二、农村个人生产经营贷款贷后管理不到位三、农户小额贷款发放后转为定期存款四、违规向房地产开发企业提供融资五、违规发放流动资金贷款六、装修贷款发放不审慎七、商业用房贷款发放不审慎八、违规向关系人发放信用贷款九、贷款风险分类不准确导致不良率失实十、违规发放固定资产贷款十一、对不具备法人资格的分支公司客户单独办理授信十二、集团客户统一授信管理不到位十三、贷款回流用于归还本行贷款十四、贷款回流用于缴纳银承保证金十五、贷款回流用于转存定期存款十六、贴现资金回流出票人十七、信贷资金流入证券账户十八、贷后管理不尽责导致信贷资金实质被关联企业占用十九、扶贫小额信贷户贷企用;于 2023 年 08 月 15 日收到国家金融监督管理总局罚款,没收违法所得的处罚措施。

华宝新飞跃混合截止 2024 年 06 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中,中国农业银行股份有限公司因:一、流动资金贷款被用于固定资产投资二、贷款受托支付问题整改不到位三、贷款风险分类不准确四、个别精准扶贫贷款被挪用五、不良资产转让流程问题整改不到位六、小微企业划型不准确七、贷款资金转存银承汇票保证金问题整改不到位八、个人贷款违规流入房地产市场问题整改不到位九、审计人员配备不足问题未整改十、非现场数据报送不准确,整改不到位十一、人员内部问责不到位十二、向关系人发放信用贷款十三、个人贷款管理不到位,部分贷款资金被挪用;于 2023 年 11 月 16 日收到国家金融监督管理总局罚款,没收违法所得的处罚措施。

华宝新飞跃混合截止 2024 年 06 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中,中国农业银行股份有限公司因:1. 办理经常项目资金收付,未对交易单证的真实性及其与外汇收支的一致性进行合理审查 2. 违反规定办理资本项目资金收付 3. 违反规定办理结汇、售汇业务 4. 未按照规定报送财务会计报告、统计报表等资料;于 2023 年 11 月 17 日收到国家外汇管理局北京市分局警告,罚款,没收违法所得的处罚措施。

华宝新飞跃混合截止 2024 年 06 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中,中国银行股份有限公司因:1. 违反账户管理规定;2. 违反清算管理规定;3. 违反商户管理规定;4. 违反备付金管理规

定；5. 违反人民币反假有关规定；6. 违反信用信息采集、提供、查询及相关管理规定；7. 未按规定履行客户身份识别义务；8. 未按规定保存客户身份资料和交易记录；9. 未按规定报送大额交易报告或者可疑交易报告；10. 与身份不明的客户进行交易；11. 违反金融营销宣传管理规定；12. 违反个人金融信息保护规定。；于 2023 年 11 月 29 日收到中国人民银行警告, 罚款, 没收违法所得的处罚措施。

华宝新飞跃混合截止 2024 年 06 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中, 中国银行股份有限公司因：一、部分重要信息系统识别不全面, 灾备建设和灾难恢复能力不符合监管要求二、重要信息系统投产及变更未向监管部门报告, 且投产及变更长期不规范引发重要信息系统较大及以上突发事件三、信息系统运行风险识别不到位、处置不及时, 引发重要信息系统重大突发事件四、监管意见整改落实不到位, 引发重要信息系统重大突发事件五、信息科技外包管理不审慎六、网络安全域未开展安全评估, 网络架构重大变更未开展风险评估且未向监管部门报告七、信息系统突发事件定级不准确, 导致未按监管要求上报八、迟报重要信息系统重大突发事件九、错报漏报监管标准化 (EAST) 数据；于 2023 年 12 月 28 日收到国家金融监督管理总局罚款的处罚措施。

华宝新飞跃混合截止 2024 年 06 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中, 中国银行股份有限公司因办理经常项目资金收付, 未对交易单证的真实性及其与外汇收支的一致性进行合理审查；于 2024 年 04 月 03 日收到国家外汇管理局北京市分局罚款, 没收违法所得的处罚措施。

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

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	2,235,557.29
2	应收清算款	3,978.75

3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	22,678.25
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,262,214.29

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，合计数可能不等于分项之和。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比 例 (%)	持有份额	占总份额比 例 (%)
2,102	60,896.05	122,532,537.41	95.73	5,470,967.55	4.27

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	4,875.87	0.0038

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究 部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2017 年 2 月 27 日) 基金份额总额	300,097,996.34
本报告期期初基金份额总额	123,932,240.85

本报告期基金总申购份额	33,749,388.46
减：本报告期基金总赎回份额	29,678,124.35
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	128,003,504.96

§ 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，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

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

目前该会计师事务所向本基金提供的审计服务持续期限为：自 2019 年 11 月 20 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，基金托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚的情况。

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	

			(%)		(%)	
国盛证券	2	27,770,145.76	24.55	26,177.94	24.59	-
申万宏源	1	16,966,478.51	15.00	15,879.08	14.92	-
德邦证券	2	15,687,975.23	13.87	14,682.87	13.80	-
东吴证券	2	9,603,734.87	8.49	9,084.51	8.54	-
平安证券	1	8,540,175.92	7.55	8,078.20	7.59	-
麦高证券	1	7,926,573.51	7.01	7,497.74	7.04	-
华安证券	2	7,120,612.00	6.30	6,735.76	6.33	-
国投证券	1	7,106,479.38	6.28	6,650.83	6.25	-
民生证券	1	6,170,155.65	5.46	5,774.78	5.43	-
东北证券	2	5,555,616.48	4.91	5,254.90	4.94	-
海通证券	3	625,632.10	0.55	585.65	0.55	-
国泰君安	2	35,805.00	0.03	33.87	0.03	-
长城证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
东方财富	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	3	-	-	-	-	-
国联证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
申港证券	2	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-

中金国际	1	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-

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： 资力雄厚，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况况稳定；经营行为规范，最近两年未因重大违规行为受到中国证监会和中国人民银行处罚；内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；具备基金运作所需要的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需，并能为本基金提供全面的信息服；研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告；适当的地域分散化。

(2) 选择程序：(a) 服务评价；(b) 拟定备选交易单元；(c) 签约。

2、本报告期租用的证券公司交易单元退租的有：长城证券、申港证券。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
国盛证券	1,544,943.09	2.46	126,188,000.00	25.42	-	-
申万宏源	3,011,434.57	4.80	-	-	-	-
德邦证券	94,938.54	0.15	-	-	-	-
东吴证券	36,845,677.69	58.75	201,977,000.00	40.68	-	-
平安证券	2,796,492.57	4.46	17,939,000.00	3.61	-	-
麦高证券	11,599,943.67	18.50	107,316,000.00	21.62	-	-
华安证券	1,706,401.98	2.72	11,158,000.00	2.25	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
民生证	4,653,189.	7.42	-	-	-	-

券	06					
东北证 券	-	-	31,869,000.0 0	6.42	-	-
海通证 券	-	-	-	-	-	-
国泰君 安	460,186.29	0.73	-	-	-	-
长城证 券	-	-	-	-	-	-
长江证 券	-	-	-	-	-	-
东方财 富	-	-	-	-	-	-
东方证 券	-	-	-	-	-	-
方正证 券	-	-	-	-	-	-
国联证 券	-	-	-	-	-	-
国信证 券	-	-	-	-	-	-
华创证 券	-	-	-	-	-	-
华泰证 券	-	-	-	-	-	-
上海证 券	-	-	-	-	-	-
申港证 券	-	-	-	-	-	-
太平洋 证券	-	-	-	-	-	-
万联证 券	-	-	-	-	-	-
西部证 券	-	-	-	-	-	-
信达证 券	-	-	-	-	-	-
兴业证 券	-	-	-	-	-	-
银河证 券	-	-	-	-	-	-
招商证 券	-	-	-	-	-	-
浙商证	-	-	-	-	-	-

券						
中金国际	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华宝基金关于旗下部分基金新增银泰证券有限责任公司为代销机构的公告	基金管理人网站, 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2024-01-05
2	华宝基金管理有限公司旗下部分基金季度报告提示性公告	上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2024-01-19
3	华宝新飞跃灵活配置混合型证券投资基金 2023 年第 4 季度报告	基金管理人网站	2024-01-19
4	华宝基金关于旗下部分基金新增上海大智慧基金销售有限公司为代销机构的通知	基金管理人网站	2024-02-29
5	华宝基金管理有限公司旗下部分基金年度报告提示性公告	上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2024-03-29
6	华宝新飞跃灵活配置混合型证券投资基金 2024 年第 1 季度报告	基金管理人网站	2024-04-19
7	华宝基金管理有限公司旗下部分基金季度报告提示性公告	上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2024-04-19
8	华宝基金关于旗下部分基金新增华福证券有限责任公司为代销机构的公告	基金管理人网站, 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2024-05-16
9	华宝基金关于旗下部分基金新增国信证券股份有限公司为代销机构的公告	基金管理人网站, 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2024-05-21
10	华宝基金关于旗下部分基金新增平安证券股份有限公司为代销机构的公告	基金管理人网站, 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2024-06-07
11	华宝基金关于旗下部分基金新增湘财证券股份有限公司为代销机构的公告	基金管理人网站, 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2024-06-21
12	华宝新飞跃灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要(更新)	基金管理人网站	2024-06-28

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20240101~20240630	104,603,500.00	0.00	10,000,000.00	94,603,500.00	73.91

产品特有风险

报告期内本基金出现单一投资者持有基金份额比例超过 20%的情况。在单一投资者持有基金份额比例较高的情况下，如该投资者集中赎回，可能会增加基金的流动性风险。此外，由于基金在遇到大额赎回的时候可能需要变现部分资产，可能对持有资产的价格形成冲击，增加基金的市场风险。基金管理人将专业审慎、勤勉尽责地运作基金资产，加强防范流动性风险、市场风险，保护持有人利益。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

中国证监会批准基金设立的文件；
 华宝新飞跃灵活配置混合型证券投资基金基金合同；
 华宝新飞跃灵活配置混合型证券投资基金招募说明书；
 华宝新飞跃灵活配置混合型证券投资基金托管协议；
 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
 基金管理人报告期内在指定报刊上披露的各种公告；
 基金托管人业务资格批件和营业执照。

12.2 存放地点

以上文件存于基金管理人及基金托管人办公场所备投资者查阅。

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。

2024 年 8 月 30 日