

华宝新飞跃灵活配置混合型证券投资基金 2021 年中期报告

2021 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：2021 年 8 月 27 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 2021 年 8 月 25 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 2021 年 01 月 01 日起至 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	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	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	13
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、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内容的真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	46
7.1 期末基金资产组合情况	46
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	46
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	47
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	52
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	53
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	54

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	54
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	54
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	54
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	54
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	55
7.12 投资组合报告附注	55
§ 8 基金份额持有人信息	57
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	57
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	57
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	57
§ 9 开放式基金份额变动	57
§ 10 重大事件揭示	58
10.1 基金份额持有人大会决议	58
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	58
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	58
10.4 基金投资策略的改变	58
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	58
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	58
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	59
10.8 其他重大事件	62
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	62
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	62
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	63
§ 12 备查文件目录	63
12.1 备查文件目录	63
12.2 存放地点	63
12.3 查阅方式	63

§ 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	114,359,131.79 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	李申
	联系电话	021-38505888	021-60637102
	电子邮箱	xxpl@fsfund.com	lishen.zh@ccb.com
客户服务电话		400-700-5588、400-820-5050、 021-38924558	021-60637111
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	北京市西城区金融大街 25 号

	58 楼	
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	XIAOYI HELEN HUANG	田国立

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(2021 年 1 月 1 日-2021 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	26,402,300.88
本期利润	17,556,278.74
加权平均基金份额本期利润	0.1527
本期加权平均净值利润率	7.87%
本期基金份额净值增长率	8.17%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	102,739,860.12
期末可供分配基金份额利润	0.8984
期末基金资产净值	231,753,328.01
期末基金份额净值	2.0265
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	102.65%

注：1、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。

2、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）

3、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。

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

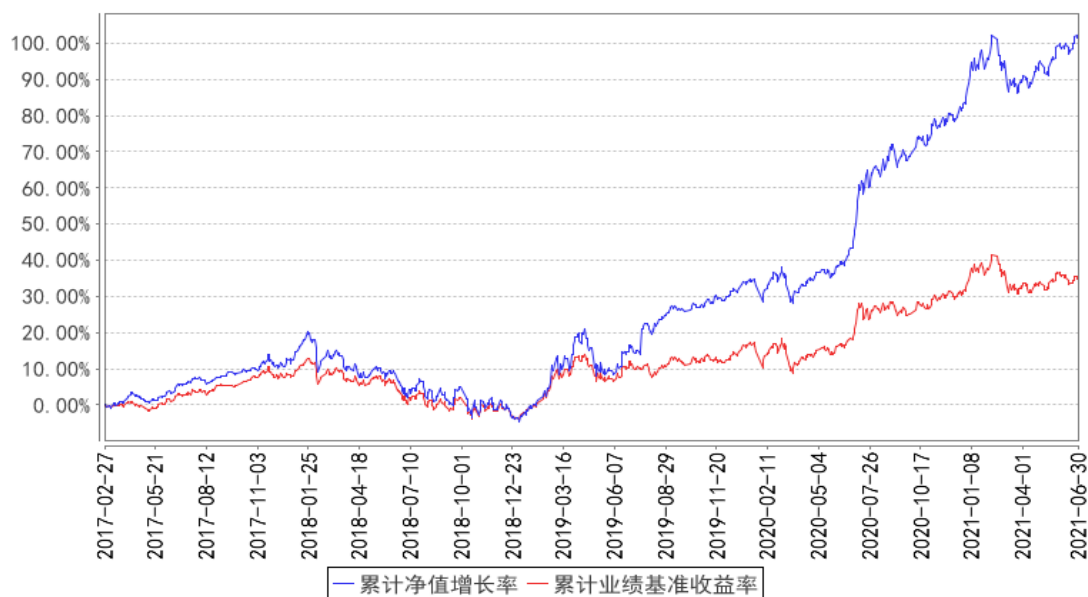
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	1.47%	0.45%	-0.94%	0.41%	2.41%	0.04%
过去三个月	7.06%	0.51%	2.23%	0.49%	4.83%	0.02%
过去六个月	8.17%	0.73%	1.21%	0.66%	6.96%	0.07%
过去一年	39.42%	0.77%	13.98%	0.67%	25.44%	0.10%
过去三年	93.76%	0.87%	31.90%	0.68%	61.86%	0.19%
自基金合同生效起至今	102.65%	0.78%	35.30%	0.62%	67.35%	0.16%

注：1、本基金业绩比较基准为：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

华宝新飞跃混合累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：按照基金合同的约定，基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定，截至 2017 年 8 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，公司注册资本为人民币 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与美国华平资产管理有限合伙（Warburg Pincus Asset Management, L.P.），持有股权占比分别为 51% 和 49%。公司在北京、深圳等地设有分公司，在香港设有子公司——华宝资产管理（香港）有限公司。

截至本报告期末（2021 年 6 月 30 日），本公司正在管理运作的证券投资基金包括：华宝宝康债券投资基金、华宝宝康消费品证券投资基金、华宝宝康灵活配置证券投资基金、华宝现金宝货币市场基金、华宝动力组合混合型证券投资基金、华宝先进成长混合型证券投资基金、华宝行业精选混合型证券投资基金、华宝海外中国成长混合型证券投资基金、华宝大盘精选混合型证券投资

资基金、华宝增强收益债券型证券投资基金、华宝中证 100 指数证券投资基金、华宝可转债债券型证券投资基金、华宝标普石油天然气上游股票指数证券投资基金 (LOF)、华宝资源优选混合型证券投资基金、华宝现金添益交易型货币市场基金、华宝创新优选混合型证券投资基金、华宝量化对冲策略混合型发起式证券投资基金、华宝标普美国品质消费股票指数证券投资基金 (LOF)、华宝标普香港上市中国中小盘指数证券投资基金 (LOF)、华宝中证军工交易型开放式指数证券投资基金、华宝中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金、华宝标普中国 A 股红利机会指数证券投资基金 (LOF)、华宝中证银行交易型开放式指数证券投资基金、华宝绿色主题混合型证券投资基金、华宝稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF)、华宝中证医疗交易型开放式指数证券投资基金、华宝中证科技龙头交易型开放式指数证券投资基金、华宝 MSCI 中国 A 股国际通 ESG 通用指数证券投资基金 (LOF)、华宝中证科技龙头交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、华宝浮动净值型发起式货币市场基金、华宝致远混合型证券投资基金 (QDII)、华宝中证消费龙头指数证券投资基金 (LOF) 等共 108 只基金。

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、混合资产部副总经理	2017 年 2 月 27 日	-	18 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研究和投资。2010 年 9 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、固定收益部总经理助理、固定收益部副总经理等职务，现任混合资产部副总经理。2011 年 6 月起担任华宝宝康债券投资基金基金经理。2014 年 10 月起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) 和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 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 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 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。
唐雪倩	本基金的基金经理助理	2018 年 1 月 23 日	-	6 年	硕士。2015 年加入华宝基金管理有限公司，先后担任助理量化分析师、分析师、基金经理助理等。2018 年 1 月至 2018 年 6 月任华宝新动力一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理。2018 年 1 月至 2018 年 7 月任华宝新回报一年定期开放混合型证券投资基金基金经理助理。2018 年 1 月至 2018 年 8 月任华宝新优选一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理。2018 年 1 月起任华宝量化对冲策略混合型发起式证券投资基金、华宝沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金、华宝新价值灵活配置混合型证券投资基金、华宝新机遇灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)、华宝新起点灵活配置混合型证券投资基金、华宝新飞跃灵活配置混合型证券投资基金。2019 年 2 月起任华宝科技先锋混合型证券投资基金基金经理助理。2019 年 7 月起任华宝新活力灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理。

注：1、任职日期以及离任日期均以基金公告为准。

2、证券从业含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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，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

2021 年经济延续复苏但较为分化，年初疫情反复，防疫升级、鼓励就地过年。疫情导致低基数，一季度 GDP 实际同比增速为 18.3%，两年复合增速为 5%，生产和出口较强、消费和投资偏弱。二季度 GDP 实际同比增速为 7.9%，低于市场预期，但两年平均增速仍较一季度提速 0.5 个百分点。出口、投资是增长的主要支撑项，消费恢复偏慢，经济边际走弱，PMI 连续三个月缓步回落。6 月工业增加值两年复合增速 6.5%，生产边际回落 0.1 个百分点。1-6 月固定资产投资累计两年复合增速 4.4%，增速较前值回升 0.2 个百分点。6 月社会消费品零售总额两年复合增速 4.9%，好于上月的 4.5%，但结构分化，商品零售两年复合增速回升，但餐饮收入则回落。以美元计价，6 月出口两年复合增速 15.1%，较上月回升 4 个百分点，贸易顺差走阔至 515 亿美元。金融数据维持强劲增长、结构继续改善，6 月社会融资规模 3.67 万亿元，前值为 1.93 万亿元，社融存量同比增速为 11.0%，好于市场预期。6 月 M2 同比 8.6%，较上月回升 0.3 个百分点。6 月 CPI 同比较上月回落 0.2 个百分点至 1.1%，主要受猪价和终端消费需求疲弱拖累；上游原材料价格涨价斜率放缓，PPI 同比较上月回落 0.2 个百分点至 8.8%。

回顾上半年，央行延续正常化货币政策，市场流动性整体宽松，仅在一月末资金利率出现了

阶段性显著上行。进入二季度，央行操作由一季度显著净回笼转为小幅净投放。银行间隔夜加权利率的季度均值由上年末的 1.70%回升至半年末的 2.03%，7 天加权均值由 2.50%回落至 2.25%。债券市场方面，国债收益率曲线变动不大，短端下行幅度略小于长端。1Y 国债、1Y 国开债收益率分别由去年末的 2.47%、2.56%小幅下行至 2.43%、2.51%，10Y 国债、10Y 国开债收益率分别由去年末的 3.14%、3.53%小幅回落至 3.08%、3.49%。年初至今，权益市场呈现显著的结构分化，中证转债指数上涨 4.04%，上证综指上涨 3.40%，中证 500 指数上涨 6.93%，创业板指上涨 17.22%。行业主题中，锂电池、半导体等赛道股涨幅居前，机场、食品加工和保险等受线下消费疲弱拖累和利率下行、行业转型等因素影响跌幅居前。可转债的走势和股票市场基本一致。

新飞跃基金始终配置了一定比例的股票，配置以稳健的品种为主，债券配置以中等期限的利率债和信用债为主，并积极参与新股网下申购。

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 8.17%，业绩比较基准收益率为 1.21%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，经济动能面临边际走弱，支撑本轮经济回升的出口和地产两大主要驱动力预计将呈现趋弱走势。伴随海外供需缺口收敛，外需对中国经济的拉动或将逐步减弱。房地产投资在持续调控下已步入下行通道、严肃财政纪律背景下基建投资增速大幅抬升的概率偏低、制造业预计延续温和复苏。消费方面，由于收入增速和消费意愿尚难回到疫情前，预计消费增速修复高度有限。通胀方面，PPI 筑顶回落，但可能回落速度偏慢；受猪价低位、终端消费疲弱压制，CPI 涨幅年内预计温和。政策方面，7 月初超预期全面降准进行跨周期调节，提前确认增长放缓担忧，货币政策预计有望呈现稳健偏松，社融增速回落预计将见底。中国经济转型高质量发展，结构性紧信用预计仍将延续，优质资产供给不足现象较为显著，后续政府债券后置发行逐步放量，预计引发利率上行的幅度较为有限。综合来看，货币平稳偏松+稳信用的政策组合，利好长端利率打开下行空间，也有助于权益资产估值提升。当前可转债市场整体估值已达近年高点，部分优质个券已开始出现对正股未来涨幅空间的透支。股市震荡择券难度加大，成长股逻辑未破但分化和波动加大，短期操作空间有所减少，未来更需要自下而上精选个券、把握结构性行情。

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。

(1) 日常估值流程

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。

(2) 特殊业务估值流程

根据中国证券监督管理委员会[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、中国证券投资基金业协会《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》、《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》、《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》等有关规定及本公司的估值制度，对特殊品种或由于特殊原因导致投资品种不存在活跃市场的情况，量化投资部根据估值委员会确定的对停牌股票或异常交易股票估值调整的方法（比如：指数收益法）进行估值，并兼顾行业研究员基于上市公司估值模型计算结果所提出的估值建议或意见。必要时基金经理也会就估值模型及估值方法的确定提出建议和意见，但由估值委员会做最终决策。

上述参与估值流程的人员均具备估值业务所需的专业胜任能力，参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

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：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	8,690,818.46	8,708,803.51
结算备付金		3,360,699.86	2,652,614.47
存出保证金		2,830,919.84	3,057,869.27
交易性金融资产	6.4.7.2	205,446,301.27	196,068,521.88
其中：股票投资		124,083,395.87	134,197,441.58
基金投资		-	-
债券投资		81,362,905.40	61,871,080.30
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-

衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	5,000,000.00	10,700,000.00
应收证券清算款		6,510,456.94	202,738.34
应收利息	6.4.7.5	1,113,360.49	995,696.52
应收股利		-	-
应收申购款		124,465.94	145,567.70
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		233,077,022.80	222,531,811.69
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021年6月30日	上年度末 2020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		-	-
应付证券清算款		-	5,700,000.00
应付赎回款		552,484.73	58,930.20
应付管理人报酬		111,756.71	106,189.38
应付托管费		27,939.17	26,547.35
应付销售服务费		46,565.30	44,245.59
应付交易费用	6.4.7.7	489,633.33	308,541.00
应交税费		6,055.40	669.70
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	89,260.15	170,000.00
负债合计		1,323,694.79	6,415,123.22
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	114,359,131.79	115,356,315.36
未分配利润	6.4.7.10	117,394,196.22	100,760,373.11
所有者权益合计		231,753,328.01	216,116,688.47
负债和所有者权益总计		233,077,022.80	222,531,811.69

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额净值 2.0265 元，基金份额总额份 114,359,131.79 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：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
-----	-----	----	---------

		2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		19,413,502.15	14,406,561.53
1. 利息收入		1,410,290.07	1,148,974.96
其中：存款利息收入	6.4.7.11	43,164.34	30,596.09
债券利息收入		1,281,825.60	1,069,973.54
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		85,300.13	48,405.33
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		26,842,837.61	13,334,142.74
其中：股票投资收益	6.4.7.12	27,778,095.59	11,780,579.52
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-30,092.35	683,582.50
资产支持证券投资	6.4.7.13.5	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-1,815,720.00	-19,968.00
股利收益	6.4.7.16	910,554.37	889,948.72
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-8,846,022.14	-77,767.07
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	6,396.61	1,210.90
减：二、费用		1,857,223.41	1,206,728.41
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	664,971.03	462,729.24
2. 托管费	6.4.10.2.2	166,242.78	115,682.34
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	277,071.30	192,803.86
4. 交易费用	6.4.7.19	635,765.05	327,134.24
5. 利息支出		-	1,211.51
其中：卖出回购金融资产支出		-	1,211.51
6. 税金及附加		2,523.00	2,654.22
7. 其他费用	6.4.7.20	110,650.25	104,513.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		17,556,278.74	13,199,833.12
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		17,556,278.74	13,199,833.12

6.3 所有者权益（基金净值）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：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	115,356,315.36	100,760,373.11	216,116,688.47
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	17,556,278.74	17,556,278.74
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-997,183.57	-922,455.63	-1,919,639.20
其中：1. 基金申购款	7,460,836.87	7,154,904.30	14,615,741.17
2. 基金赎回款	-8,458,020.44	-8,077,359.93	-16,535,380.37
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	114,359,131.79	117,394,196.22	231,753,328.01
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	120,283,896.16	40,109,693.12	160,393,589.28
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	13,199,833.12	13,199,833.12
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-11,743,958.96	-4,084,322.57	-15,828,281.53

（净值减少以“-”号填列）			
其中：1. 基金申购款	1,772,435.57	648,618.03	2,421,053.60
2. 基金赎回款	-13,516,394.53	-4,732,940.60	-18,249,335.13
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	108,539,937.20	49,225,203.67	157,765,140.87

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：

黄小蕙

向辉

张幸骏

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华宝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。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%。

本财务报表由本基金的基金管理人华宝基金管理有限公司于 2021 年 8 月 27 日批准报出。

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、解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)和在财务报表附注所列示依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。同时,对于在具体会计核算和信息披露方面,也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证监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 2 号《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>》、其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

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 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年上半年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

无。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

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‰；

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，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，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；

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，自 2018 年 1 月 1 日起，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，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。

（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暂行条例（2011 年修订）》、《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 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
活期存款	8,690,818.46
定期存款	-
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	-
合计	8,690,818.46

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	107,825,963.26	124,083,395.87	16,257,432.61	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	30,511,204.80	30,501,905.40	-9,299.40
	银行间市场	50,679,225.47	50,861,000.00	181,774.53
	合计	81,190,430.27	81,362,905.40	172,475.13
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	189,016,393.53	205,446,301.27	16,429,907.74	

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 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	-23,106,600.00	-	-
其中：股指期货投资	-23,106,600.00	-	-
其他衍生工具	-	-	-
合计	-23,106,600.00	-	-

注：衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为人民币 0.00 元。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货投资产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指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人民币 0.00 元。于本报告期末，本基金持有 15 手 IF2107 空头持仓，合约市值为人民币 -23,360,400.00 元，公允价值变动为人民币 -253,800.00 元，抵销相关期货暂收款 253,800.00 元后的净额为人民币 0.00 元。

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 2021年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	5,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	5,000,000.00	-

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 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应收活期存款利息	435.06
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	1,479.31
应收债券利息	1,108,791.16

应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	2,642.46
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	12.50
合计	1,113,360.49

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
交易所市场应付交易费用	489,283.33
银行间市场应付交易费用	350.00
合计	489,633.33

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021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	-
预提费用	89,260.15
合计	89,260.15

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	115,356,315.36	115,356,315.36
本期申购	7,460,836.87	7,460,836.87
本期赎回(以“-”号填列)	-8,458,020.44	-8,458,020.44
- 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	114,359,131.79	114,359,131.79

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。

6.4.7.10 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	77,148,922.29	23,611,450.82	100,760,373.11
本期利润	26,402,300.88	-8,846,022.14	17,556,278.74
本期基金份额交易产生的变动数	-811,363.05	-111,092.58	-922,455.63
其中：基金申购款	5,877,207.98	1,277,696.32	7,154,904.30
基金赎回款	-6,688,571.03	-1,388,788.90	-8,077,359.93
本期已分配利润	-	-	-
本期末	102,739,860.12	14,654,336.10	117,394,196.22

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
活期存款利息收入	9,257.92
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	33,613.95
其他	292.47
合计	43,164.34

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	27,778,095.59
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	27,778,095.59

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出股票成交总额	214,270,821.98
减：卖出股票成本总额	186,492,726.39
买卖股票差价收入	27,778,095.59

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-30,092.35
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	-30,092.35

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	68,042,515.39
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	66,556,462.50
减：应收利息总额	1,516,145.24
买卖债券差价收入	-30,092.35

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2021年1月1日至2021年6月30日
股指期货投资收益	-1,815,720.00

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	910,554.37
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	910,554.37

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
1. 交易性金融资产	-9,634,542.14
股票投资	-9,772,477.14
债券投资	137,935.00
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	788,520.00
权证投资	-
期货投资	788,520.00
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	-8,846,022.14

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
----	----------------------------

基金赎回费收入	5,086.17
基金转换费收入	1,310.44
合计	6,396.61

注：（1）本基金的赎回费率按持有期间递减，对于持续持有期少于 30 日的投资者收取的赎回费，基金管理人将其全额计入基金财产。

（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，其中转出基金的赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	630,180.30
银行间市场交易费用	725.00
期货交易费用	4,859.75
合计	635,765.05

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
审计费用	29,752.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	2,790.10
账户维护费	18,000.00
上清所 CFCA 证书服务费	600.00
合计	110,650.25

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

截至本财务报表批准报出日，本基金无其它需作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、基金销售机构
华宝信托有限责任公司(“华宝信托”)	基金管理人的股东
华平资产管理有限合伙 (Warburg Pincus Asset Management, L.P.)	基金管理人的股东
中国宝武钢铁集团有限公司(“宝武集团”)	华宝信托的最终控制人
华宝证券股份有限公司(“华宝证券”)	受宝武集团控制的公司、基金销售机构
华宝投资有限公司(“华宝投资”)	受宝武集团控制的公司
宝武集团财务有限责任公司(“宝武财务”)	受宝武集团控制的公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行交易。

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 2021年1月1日至2021年6 月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	664,971.03	462,729.24
其中：支付销售机构的客户维护费	6,917.59	5,412.85

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 2021年1月1日至2021年6 月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年 6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	166,242.78	115,682.34

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
	2021 年 1 月 1 日至 2021 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	269,727.96
合计	269,727.96
获得销售服务费的各关联方 名称	上年度可比期间
	2020 年 1 月 1 日至 2020 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	182,390.40
合计	182,390.40

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给华宝基金，再由华宝基金计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日基金份额基金资产净值} \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间均未发生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无运用固有资金投资本基金的情况。

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 2021年6月30日		上年度末 2020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	104,603,500.00	91.47	107,113,500.00	92.8500

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 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020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
中国建设银行股份有限公司	8,690,818.46	9,257.92	2,622,414.32	24,894.44

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(2021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	可流通日	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
300614	百川畅银	2021年5月18日	2021年11月25日	新股锁定	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02	-

300926	博俊科技	2020年12月29日	2021年7月12日	新股锁定	10.76	22.2	359	3,862.84	7,969.80	-
300927	江天化学	2020年12月29日	2021年7月7日	新股锁定	13.39	30.1	217	2,905.63	6,531.70	-
300929	华骐环保	2021年1月12日	2021年7月21日	新股锁定	13.87	29.55	183	2,538.21	5,407.65	-
300930	屹通新材	2021年1月13日	2021年7月21日	新股锁定	13.11	24.48	322	4,221.42	7,882.56	-
300931	通用电梯	2021年1月13日	2021年7月21日	新股锁定	4.31	13.11	672	2,896.32	8,809.92	-
300933	中辰股份	2021年1月15日	2021年7月22日	新股锁定	3.37	10.44	1,112	3,747.44	11,609.28	-
300937	药易购	2021年1月20日	2021年7月27日	新股锁定	12.25	53.71	244	2,989.00	13,105.24	-
300940	南极光	2021年1月27日	2021年8月3日	新股锁定	12.76	43.38	307	3,917.32	13,317.66	-
300942	易瑞生物	2021年2月2日	2021年8月9日	新股锁定	5.31	28.52	443	2,352.33	12,634.36	-
300943	春晖智控	2021年2月3日	2021年8月10日	新股锁定	9.79	23.01	255	2,496.45	5,867.55	-
300945	曼卡龙	2021年2月3日	2021年8月10日	新股锁定	4.56	18.88	474	2,161.44	8,949.12	-
300948	冠中生态	2021年2月18日	2021年8月25日	新股锁定	13	27.42	324	2,808.00	8,884.08	-
300950	德固特	2021年2月24日	2021年9月3日	新股锁定	8.41	39.13	219	1,841.79	8,569.47	-
300952	恒辉安防	2021年3月3日	2021年9月13日	新股锁定	11.72	27.08	340	3,984.80	9,207.20	-
300953	震裕科技	2021年3月11日	2021年9月22日	新股锁定	28.77	99.85	240	6,904.80	23,964.00	-

		日	日								
300955	嘉亨家化	2021年 3月16 日	2021年 9月24 日	新股锁 定	16.53	46.07	232	3,834.96	10,688.24		-
300956	英力股份	2021年 3月16 日	2021年 9月27 日	新股锁 定	12.85	25.8	371	4,767.35	9,571.80		-
300957	贝泰妮	2021年 3月18 日	2021年 9月27 日	新股锁 定	47.33	251.96	163	7,714.79	41,069.48		-
300958	建工修复	2021年 3月18 日	2021年 9月29 日	新股锁 定	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00		-
300960	通业科技	2021年 3月22 日	2021年 9月29 日	新股锁 定	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04		-
300961	深水海纳	2021年 3月23 日	2021年 9月30 日	新股锁 定	8.48	22.07	394	3,341.12	8,695.58		-
300962	中金辐照	2021年 3月29 日	2021年 10月 11日	新股锁 定	3.4	16.37	576	1,958.40	9,429.12		-
300963	中洲特材	2021年 3月30 日	2021年 10月 11日	新股锁 定	12.13	22.49	283	3,432.79	6,364.67		-
300966	共同药业	2021年 3月31 日	2021年 10月 11日	新股锁 定	8.24	31.54	286	2,356.64	9,020.44		-
300967	晓鸣股份	2021年 4月2日	2021年 10月 13日	新股锁 定	4.54	11.54	507	2,301.78	5,850.78		-
300968	格林精密	2021年 4月6日	2021年 10月 15日	新股锁 定	6.87	12.07	976	6,705.12	11,780.32		-
300971	博亚精工	2021年 4月7日	2021年 10月 15日	新股锁 定	18.24	28.29	245	4,468.80	6,931.05		-
300972	万辰生物	2021年 4月8日	2021年 10月 19日	新股锁 定	7.19	12.65	430	3,091.70	5,439.50		-
300973	立高食品	2021年 4月8日	2021年 10月 15日	新股锁 定	28.28	115.71	201	5,684.28	23,257.71		-
300975	商络	2021年	2021年	新股锁	5.48	13.03	492	2,696.16	6,410.76		-

	电子	4月14日	10月21日	定						
300978	东箭科技	2021年4月15日	2021年10月26日	新股锁定	8.42	13.6	593	4,993.06	8,064.80	-
300979	华利集团	2021年4月15日	2021年10月26日	新股锁定	33.22	87.5	282	9,368.04	24,675.00	-
300981	中红医疗	2021年4月19日	2021年10月27日	新股锁定	48.59	90.39	172	8,357.48	15,547.08	-
300982	苏文电能	2021年4月19日	2021年10月27日	新股锁定	15.83	45.29	317	5,018.11	14,356.93	-
300985	致远新能	2021年4月21日	2021年10月29日	新股锁定	24.9	24.81	233	5,801.70	5,780.73	-
300986	志特新材	2021年4月21日	2021年11月1日	新股锁定	14.79	30.57	264	3,904.56	8,070.48	-
300987	川网传媒	2021年4月28日	2021年11月11日	新股锁定	6.79	26.81	301	2,043.79	8,069.81	-
300991	创益通	2021年5月12日	2021年11月22日	新股锁定	13.06	26.51	254	3,317.24	6,733.54	-
300992	泰福泵业	2021年5月17日	2021年11月25日	新股锁定	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00	-
300993	玉马遮阳	2021年5月17日	2021年11月24日	新股锁定	12.1	19.29	410	4,961.00	7,908.90	-
300995	奇德新材	2021年5月17日	2021年11月26日	新股锁定	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	-
300996	普联软件	2021年5月26日	2021年12月3日	新股锁定	20.81	42.23	241	5,015.21	10,177.43	-
300997	欢乐家	2021年5月26日	2021年12月2日	新股锁定	4.94	13.05	928	4,584.32	12,110.40	-
300998	宁波方正	2021年5月25日	2021年12月2日	新股锁定	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	-

301002	崧盛股份	2021年5月27日	2021年12月7日	新股锁定	18.71	57.62	201	3,760.71	11,581.62	-
301004	嘉益股份	2021年6月18日	2021年12月27日	新股锁定	7.81	21.94	312	2,436.72	6,845.28	-
301006	迈拓股份	2021年5月31日	2021年12月7日	新股锁定	14.42	24.89	5,051	72,835.42	125,719.39	-
301007	德迈仕	2021年6月4日	2021年12月16日	新股锁定	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	-
301010	晶雪节能	2021年6月9日	2021年12月20日	新股锁定	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	-
301011	华立科技	2021年6月9日	2021年12月17日	新股锁定	14.2	33.84	175	2,485.00	5,922.00	-
301012	扬电科技	2021年6月15日	2021年12月22日	新股锁定	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20	-
301015	百洋医药	2021年6月22日	2021年12月30日	新股锁定	7.64	38.83	462	3,529.68	17,939.46	-
301016	雷尔伟	2021年6月23日	2021年12月30日	新股锁定	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50	-
301017	漱玉平民	2021年6月23日	2021年7月5日	新股流通受限	8.86	8.86	4,995	44,255.70	44,255.70	-
301017	漱玉平民	2021年6月23日	2022年1月5日	新股锁定	8.86	8.86	555	4,917.30	4,917.30	-
301018	申菱环境	2021年6月28日	2021年7月7日	新股流通受限	8.29	8.29	7,029	58,270.41	58,270.41	-
301018	申菱环境	2021年6月28日	2022年1月7日	新股锁定	8.29	8.29	782	6,482.78	6,482.78	-
301021	英诺激光	2021年6月28日	2021年7月6日	新股流通受限	9.46	9.46	2,609	24,681.14	24,681.14	-
301021	英诺激光	2021年6月28日	2022年1月6日	新股锁定	9.46	9.46	290	2,743.40	2,743.40	-

		日	日								
605162	新中港	2021年 6月29 日	2021年 7月7 日	新股流 通受限	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39		-
605287	德才股份	2021年 6月28 日	2021年 7月6 日	新股流 通受限	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44		-
688087	英科再生	2021年 6月30 日	2021年 7月9 日	新股流 通受限	21.96	21.96	2,296	50,420.16	50,420.16		-
688191	智洋创新	2021年 3月30 日	2021年 10月8 日	新股锁 定	11.38	17.74	3,203	36,450.14	56,821.22		-
688201	信安世纪	2021年 4月13 日	2021年 10月 21日	新股锁 定	26.78	45.41	2,129	57,014.62	96,677.89		-
688216	气派科技	2021年 6月15 日	2021年 12月 23日	新股锁 定	14.82	47.64	2,000	29,640.00	95,280.00		-
688226	威腾电气	2021年 6月28 日	2021年 7月7 日	新股流 通受限	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06		-
688239	航宇科技	2021年 6月25 日	2021年 7月5 日	新股流 通受限	11.48	11.48	4,926	56,550.48	56,550.48		-
688276	百克生物	2021年 6月17 日	2021年 12月 27日	新股锁 定	36.35	79.48	1,528	55,542.80	121,445.44		-
688565	力源科技	2021年 5月6日	2021年 11月 15日	新股锁 定	9.39	14	2,464	23,136.96	34,496.00		-
688575	亚辉龙	2021年 5月10 日	2021年 11月 17日	新股锁 定	14.8	32.09	3,184	47,123.20	102,174.56		-
688611	杭州柯林	2021年 4月1日	2021年 10月 12日	新股锁 定	33.44	42.34	1,400	46,816.00	59,276.00		-
688613	奥精医疗	2021年 5月13 日	2021年 11月 22日	新股锁 定	16.43	63.5	2,617	42,997.31	166,179.50		-
688625	呈和科技	2021年 5月31 日	2021年 12月7 日	新股锁 定	16.48	42.63	2,672	44,034.56	113,907.36		-
688686	奥普	2020年	2021年	新股锁	78.49	451	815	63,969.35	367,565.00		-

特	12月24日	7月1日	定							
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
127038	国微转债	2021年6月10日	2021年07月14日	新债未上市	100.00	100.00	250	25,000.00	25,000.00	-
113049	长汽转债	2021年6月10日	2021年7月8日	新债未上市	100.00	100.00	140	14,000.00	14,000.00	-
113050	南银转债	2021年6月17日	2021年7月1日	新债未上市	100.00	100.00	580	58,000.00	58,000.00	-

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。

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购，因此没有在银行间市场债券正回购交易中作为

抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购，因此没有在交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只混合型的证券投资基金，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相对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“相对收益高、风险适中”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信用良好的银行，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，因此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。

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 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	5,500,000.00	-
合计	5,500,000.00	-

注：上述评级均由经中国证监会核准从事证券市场资信评级业务的评级机构做出。

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均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均未持有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 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
AAA	51,329,005.40	-
AAA 以下	25,000.00	-
未评级	24,508,900.00	-
合计	75,862,905.40	-

注：未评级债券为国债、政策性金融债。上述评级均由经中国证监会核准从事证券市场资信评级业务的评级机构做出。

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均未持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均未持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，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、流通受限的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司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。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银行存款、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 2021年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	8,690,818.46	-	-	-	8,690,818.46
结算备付金	3,360,699.86	-	-	-	3,360,699.86
存出保证金	27,671.84	-	-	2,803,248.00	2,830,919.84
交易性金融资产	14,192,005.40	65,207,500.00	1,963,400.00	124,083,395.87	205,446,301.27
买入返售金融资产	5,000,000.00	-	-	-	5,000,000.00
应收利息	-	-	-	1,113,360.49	1,113,360.49
应收申购款	-	-	-	124,465.94	124,465.94
应收证券清算款	-	-	-	6,510,456.94	6,510,456.94
资产总计	31,271,195.56	65,207,500.00	1,963,400.00	134,634,927.24	233,077,022.80
负债					
应付赎回款	-	-	-	552,484.73	552,484.73
应付管理人报酬	-	-	-	111,756.71	111,756.71
应付托管费	-	-	-	27,939.17	27,939.17
应付销售服务费	-	-	-	46,565.30	46,565.30
应付交易费用	-	-	-	489,633.33	489,633.33
应交税费	-	-	-	6,055.40	6,055.40

其他负债	-	-	-	89,260.15	89,260.15
负债总计	-	-	-	1,323,694.79	1,323,694.79
利率敏感度缺口	31,271,195.56	65,207,500.00	1,963,400.00	133,311,232.45	231,753,328.01
上年度末 2020 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	8,708,803.51	-	-	-	8,708,803.51
结算备付金	2,652,614.47	-	-	-	2,652,614.47
存出保证金	53,338.07	-	-	3,004,531.20	3,057,869.27
交易性金融资产	20,025,999.80	39,824,275.80	2,020,804.70	134,197,441.58	196,068,521.88
买入返售金融资产	10,700,000.00	-	-	-	10,700,000.00
应收利息	-	-	-	995,696.52	995,696.52
应收申购款	115,855.00	-	-	29,712.70	145,567.70
应收证券清算款	-	-	-	202,738.34	202,738.34
资产总计	42,256,610.85	39,824,275.80	2,020,804.70	138,430,120.34	222,531,811.69
负债					
应付赎回款	-	-	-	58,930.20	58,930.20
应付管理人报酬	-	-	-	106,189.38	106,189.38
应付托管费	-	-	-	26,547.35	26,547.35
应付证券清算款	-	-	-	5,700,000.00	5,700,000.00
应付销售服务费	-	-	-	44,245.59	44,245.59
应付交易费用	-	-	-	308,541.00	308,541.00
应交税费	-	-	-	669.70	669.70
其他负债	-	-	-	170,000.00	170,000.00
负债总计	-	-	-	6,415,123.22	6,415,123.22
利率敏感度缺口	42,256,610.85	39,824,275.80	2,020,804.70	132,014,997.12	216,116,688.47

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		
	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（2021 年 6 月 30 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
分析	1. 市场利率上升 25 个基点	-394,180.89	-321,686.17
	2. 市场利率下降 25 个基点	396,504.50	328,079.36

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 2021年6月30日		上年度末 2020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	124,083,395.87	53.54	134,197,441.58	62.09
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	124,083,395.87	53.54	134,197,441.58	62.09

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		
	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（2021年6月30日）	上年度末（2020年12月31日）
分析	1. 业绩比较基准上升 5%	12,909,396.22	11,015,548.69
	2. 业绩比较基准下降 5%	-12,909,396.22	-11,015,548.69

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

（1）公允价值

（a）不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括银行存款、结算备付金、存出保证金、应收证券清算款、应收利息、应收申购款以及其他金融负债，其因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

（b）以公允价值计量的金融工具

（i）各层次金融工具公允价值

于本报告期末，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币 121,926,809.25 元，第二层次的余额为人民币 83,519,492.02 元，无法分为第三层次的余额（于上年度末，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币 130,815,995.57 元，第二层次的余额为人民币 65,252,526.31 元，无法分为第三层次的余额）。

（ii）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。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

本基金于本报告期初未持有公允价值归属于第三层次的金融工具，本基金本报告期及上年度可比期间未发生第三层次公允价值转入转出情况。

(2) 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大承诺事项。

(3) 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的其他重要事项。

§ 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	124,083,395.87	53.24
	其中：股票	124,083,395.87	53.24
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	81,362,905.40	34.91
	其中：债券	81,362,905.40	34.91
	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	5,000,000.00	2.15
	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	12,051,518.32	5.17
8	其他各项资产	10,579,203.21	4.54
9	合计	233,077,022.80	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

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	1,006,305.48	0.43
B	采矿业	2,269,627.00	0.98
C	制造业	71,533,070.11	30.87

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,371,132.39	0.59
E	建筑业	957,231.37	0.41
F	批发和零售业	667,144.58	0.29
G	交通运输、仓储和邮政业	3,547,652.00	1.53
H	住宿和餐饮业	341,700.00	0.15
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,486,560.65	1.07
J	金融业	27,797,837.82	11.99
K	房地产业	2,252,652.00	0.97
L	租赁和商务服务业	2,833,937.10	1.22
M	科学研究和技术服务业	3,252,152.80	1.40
N	水利、环境和公共设施管理业	308,955.33	0.13
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	3,052,697.24	1.32
R	文化、体育和娱乐业	404,740.00	0.17
S	综合	-	-
	合计	124,083,395.87	53.54

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	3,100	6,375,770.00	2.75
2	600036	招商银行	97,200	5,267,268.00	2.27
3	000858	五粮液	15,000	4,468,350.00	1.93
4	300059	东方财富	119,308	3,912,109.32	1.69
5	601318	中国平安	51,000	3,278,280.00	1.41
6	601012	隆基股份	32,480	2,885,523.20	1.25
7	603259	药明康德	17,720	2,774,774.80	1.20
8	000333	美的集团	33,101	2,362,418.37	1.02
9	601888	中国中免	7,101	2,131,010.10	0.92
10	002142	宁波银行	54,400	2,119,968.00	0.91
11	000001	平安银行	93,400	2,112,708.00	0.91
12	600030	中信证券	80,500	2,007,670.00	0.87
13	002415	海康威视	29,600	1,909,200.00	0.82
14	000568	泸州老窖	7,700	1,816,738.00	0.78

15	603986	兆易创新	9,620	1,807,598.00	0.78
16	300750	宁德时代	3,300	1,764,840.00	0.76
17	300015	爱尔眼科	24,738	1,755,903.24	0.76
18	600809	山西汾酒	3,900	1,747,200.00	0.75
19	002475	立讯精密	36,399	1,674,354.00	0.72
20	002594	比亚迪	6,600	1,656,600.00	0.71
21	002049	紫光国微	10,200	1,572,738.00	0.68
22	002179	中航光电	19,300	1,525,086.00	0.66
23	000725	京东方 A	231,200	1,442,688.00	0.62
24	000776	广发证券	89,900	1,361,086.00	0.59
25	600900	长江电力	65,800	1,358,112.00	0.59
26	603501	韦尔股份	3,900	1,255,800.00	0.54
27	300274	阳光电源	10,800	1,242,648.00	0.54
28	600309	万华化学	11,100	1,207,902.00	0.52
29	002821	凯莱英	3,200	1,192,320.00	0.51
30	601628	中国人寿	33,800	1,145,482.00	0.49
31	601211	国泰君安	66,400	1,138,096.00	0.49
32	002139	拓邦股份	60,500	1,088,395.00	0.47
33	002460	赣锋锂业	8,900	1,077,701.00	0.47
34	600031	三一重工	36,900	1,072,683.00	0.46
35	600690	海尔智家	41,300	1,070,083.00	0.46
36	300014	亿纬锂能	10,153	1,055,201.29	0.46
37	601899	紫金矿业	107,200	1,038,768.00	0.45
38	601633	长城汽车	23,600	1,028,724.00	0.44
39	600919	江苏银行	144,100	1,023,110.00	0.44
40	300529	健帆生物	11,800	1,019,048.00	0.44
41	600660	福耀玻璃	18,200	1,016,470.00	0.44
42	300760	迈瑞医疗	2,100	1,008,105.00	0.43
43	002714	牧原股份	16,360	995,015.20	0.43
44	000069	华侨城 A	130,500	970,920.00	0.42
45	600763	通策医疗	2,300	945,300.00	0.41
46	601668	中国建筑	200,400	931,860.00	0.40
47	601009	南京银行	85,500	899,460.00	0.39
48	601166	兴业银行	43,000	883,650.00	0.38
49	000063	中兴通讯	25,800	857,334.00	0.37
50	600436	片仔癀	1,900	851,770.00	0.37
51	000661	长春高新	2,200	851,400.00	0.37
52	603799	华友钴业	7,300	833,660.00	0.36
53	600132	重庆啤酒	4,100	811,595.00	0.35
54	002241	歌尔股份	18,900	807,786.00	0.35
55	002080	中材科技	30,800	806,036.00	0.35
56	300124	汇川技术	10,700	794,582.00	0.34

57	600018	上港集团	163,600	780,372.00	0.34
58	601006	大秦铁路	115,800	761,964.00	0.33
59	688169	石头科技	600	756,600.00	0.33
60	000932	华菱钢铁	113,400	748,440.00	0.32
61	603288	海天味业	5,620	724,699.00	0.31
62	300033	同花顺	6,300	710,514.00	0.31
63	002027	分众传媒	74,700	702,927.00	0.30
64	601838	成都银行	55,600	702,784.00	0.30
65	601919	中远海控	22,700	693,258.00	0.30
66	002311	海大集团	8,300	677,280.00	0.29
67	300782	卓胜微	1,260	677,250.00	0.29
68	002410	广联达	9,500	647,900.00	0.28
69	300496	中科创达	4,100	643,946.00	0.28
70	002230	科大讯飞	9,500	642,010.00	0.28
71	600887	伊利股份	17,300	637,159.00	0.27
72	300595	欧普康视	6,100	631,655.00	0.27
73	002563	森马服饰	51,300	613,035.00	0.26
74	600884	杉杉股份	26,100	608,652.00	0.26
75	600276	恒瑞医药	8,837	600,650.89	0.26
76	600999	招商证券	31,020	590,000.40	0.25
77	002271	东方雨虹	10,600	586,392.00	0.25
78	603195	公牛集团	2,900	585,800.00	0.25
79	300122	智飞生物	3,000	560,190.00	0.24
80	002677	浙江美大	30,300	553,884.00	0.24
81	002245	蔚蓝锂芯	27,900	549,630.00	0.24
82	601857	中国石油	103,100	545,399.00	0.24
83	002968	新大正	12,400	540,020.00	0.23
84	601636	旗滨集团	28,800	534,528.00	0.23
85	002709	天赐材料	4,820	513,715.60	0.22
86	601225	陕西煤业	41,400	490,590.00	0.21
87	300759	康龙化成	2,200	477,378.00	0.21
88	600048	保利地产	38,800	467,152.00	0.20
89	002352	顺丰控股	6,900	467,130.00	0.20
90	002129	中环股份	11,800	455,480.00	0.20
91	600585	海螺水泥	10,200	418,710.00	0.18
92	603605	珀莱雅	2,100	413,091.00	0.18
93	600111	北方稀土	19,900	411,930.00	0.18
94	300413	芒果超媒	5,900	404,740.00	0.17
95	300896	爱美客	500	394,440.00	0.17
96	600426	华鲁恒升	12,200	377,590.00	0.16
97	002920	德赛西威	3,400	374,272.00	0.16
98	688686	奥普特	815	367,565.00	0.16

99	601607	上海医药	17,200	363,436.00	0.16
100	601658	邮储银行	71,900	360,938.00	0.16
101	688111	金山办公	900	355,320.00	0.15
102	600298	安琪酵母	6,500	353,470.00	0.15
103	603882	金城医学	2,200	351,494.00	0.15
104	000012	南玻 A	34,200	350,208.00	0.15
105	600754	锦江酒店	6,000	341,700.00	0.15
106	000100	TCL 科技	44,500	340,425.00	0.15
107	000338	潍柴动力	18,800	335,956.00	0.14
108	002833	弘亚数控	8,200	317,750.00	0.14
109	001965	招商公路	40,900	295,298.00	0.13
110	601865	福莱特	7,400	292,522.00	0.13
111	000830	鲁西化工	15,600	292,188.00	0.13
112	601155	新城控股	6,600	274,560.00	0.12
113	600109	国金证券	19,700	249,993.00	0.11
114	300755	华致酒行	5,100	208,131.00	0.09
115	000786	北新建材	5,300	208,025.00	0.09
116	600988	赤峰黄金	13,000	194,870.00	0.08
117	603568	伟明环保	7,700	175,791.00	0.08
118	688613	奥精医疗	2,617	166,179.50	0.07
119	600522	中天科技	14,600	146,000.00	0.06
120	000739	普洛药业	4,500	132,300.00	0.06
121	301006	迈拓股份	5,051	125,719.39	0.05
122	688276	百克生物	1,528	121,445.44	0.05
123	688625	呈和科技	2,672	113,907.36	0.05
124	688575	亚辉龙	3,184	102,174.56	0.04
125	688201	信安世纪	2,129	96,677.89	0.04
126	688216	气派科技	2,000	95,280.00	0.04
127	300724	捷佳伟创	700	81,207.00	0.04
128	301018	申菱环境	7,811	64,753.19	0.03
129	688611	杭州柯林	1,400	59,276.00	0.03
130	688191	智洋创新	3,203	56,821.22	0.02
131	688239	航宇科技	4,926	56,550.48	0.02
132	002034	旺能环境	3,400	54,230.00	0.02
133	688087	英科再生	2,296	50,420.16	0.02
134	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.02
135	300957	贝泰妮	163	41,069.48	0.02
136	300894	火星人	511	34,748.00	0.01
137	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.01
138	688565	力源科技	2,464	34,496.00	0.01
139	600737	中粮糖业	3,300	33,033.00	0.01
140	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.01

141	300979	华利集团	282	24,675.00	0.01
142	300953	震裕科技	240	23,964.00	0.01
143	300973	立高食品	201	23,257.71	0.01
144	001207	联科科技	682	22,581.02	0.01
145	301015	百洋医药	462	17,939.46	0.01
146	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.01
147	300981	中红医疗	172	15,547.08	0.01
148	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.01
149	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.01
150	300925	法本信息	510	13,407.90	0.01
151	300940	南极光	307	13,317.66	0.01
152	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.01
153	300937	药易购	244	13,105.24	0.01
154	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.01
155	603171	税友股份	637	12,230.40	0.01
156	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.01
157	300968	格林精密	976	11,780.32	0.01
158	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.01
159	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
160	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
161	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
162	300996	普联软件	241	10,177.43	0.00
163	300956	英力股份	371	9,571.80	0.00
164	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
165	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
166	301016	雷尔伟	275	9,069.50	0.00
167	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
168	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
169	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
170	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
171	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
172	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
173	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
174	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
175	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
176	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
177	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
178	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
179	300993	玉马遮阳	410	7,908.90	0.00
180	300930	屹通新材	322	7,882.56	0.00
181	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
182	301004	嘉益股份	312	6,845.28	0.00

183	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
184	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
185	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
186	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
187	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
188	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
189	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
190	300985	致远新能	233	5,780.73	0.00
191	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
192	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
193	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
194	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
195	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
196	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
197	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
198	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
199	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
200	301010	晶雪节能	218	3,838.98	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	002142	宁波银行	4,786,847.48	2.21
2	600036	招商银行	4,406,528.00	2.04
3	000002	万科 A	4,033,732.55	1.87
4	002714	牧原股份	3,656,322.08	1.69
5	000001	平安银行	3,513,828.13	1.63
6	300059	东方财富	3,508,357.77	1.62
7	600048	保利地产	3,368,517.00	1.56
8	000157	中联重科	3,154,284.14	1.46
9	002128	露天煤业	3,019,892.00	1.40
10	600519	贵州茅台	2,978,099.00	1.38
11	600030	中信证券	2,892,719.00	1.34
12	000858	五粮液	2,656,037.00	1.23
13	603259	药明康德	2,597,596.00	1.20
14	601012	隆基股份	2,421,133.00	1.12
15	601398	工商银行	2,419,305.00	1.12
16	000568	泸州老窖	2,374,579.00	1.10
17	601225	陕西煤业	2,119,809.00	0.98
18	601318	中国平安	2,084,981.00	0.96
19	601211	国泰君安	1,784,528.00	0.83

20	300015	爱尔眼科	1,772,623.00	0.82
----	--------	------	--------------	------

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	000002	万科 A	6,511,808.75	3.01
2	601398	工商银行	4,556,246.00	2.11
3	300059	东方财富	4,441,147.51	2.05
4	601318	中国平安	4,295,416.00	1.99
5	000001	平安银行	4,230,358.00	1.96
6	600036	招商银行	3,926,436.39	1.82
7	600519	贵州茅台	3,915,736.00	1.81
8	601012	隆基股份	3,505,770.60	1.62
9	601328	交通银行	3,038,145.00	1.41
10	000157	中联重科	3,019,233.00	1.40
11	002128	露天煤业	2,976,710.00	1.38
12	600031	三一重工	2,836,082.89	1.31
13	600048	保利地产	2,792,615.00	1.29
14	002142	宁波银行	2,786,103.95	1.29
15	601377	兴业证券	2,755,208.00	1.27
16	601166	兴业银行	2,570,895.00	1.19
17	600000	浦发银行	2,528,694.42	1.17
18	601225	陕西煤业	2,493,678.00	1.15
19	002714	牧原股份	2,353,724.20	1.09
20	002594	比亚迪	2,328,718.00	1.08

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	186,151,157.82
卖出股票收入（成交）总额	214,270,821.98

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	7,463,400.00	3.22

2	央行票据	-	-
3	金融债券	22,545,500.00	9.73
	其中：政策性金融债	22,545,500.00	9.73
4	企业债券	1,006,505.40	0.43
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	41,022,000.00	17.70
7	可转债（可交换债）	9,325,500.00	4.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	81,362,905.40	35.11

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	101801068	18 浙能源 MTN003	100,000	10,376,000.00	4.48
2	101800487	18 赣国资 MTN002	100,000	10,355,000.00	4.47
3	101801227	18 京国资 MTN004	100,000	10,279,000.00	4.44
4	102001237	20 中金集 MTN003	100,000	10,012,000.00	4.32
5	200202	20 国开 02	100,000	9,839,000.00	4.25

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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
IF2107	IF2107	-15	-23,360,400.00	-253,800.00	-

公允价值变动总额合计（元）	-253,800.00
股指期货投资本期收益（元）	-1,815,720.00
股指期货投资本期公允价值变动（元）	788,520.00

注：持仓量和合约市值的负数代表产品投资的期货为空头。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金主要利用股指期货进行套期保值或仓位调节操作。当进行空头套期保值时，基金持有的卖出股指期货合约价值，不超过基金持有的股票总市值的 20%，基金通过空头套期保值，一定程度上可以规避市场的系统性风险。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 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金未投资国债期货。

7.11.3 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

新飞跃基金截至 2021 年 6 月 30 日持仓前十名证券中的招商银行（600036）的发行人招商银行股份有限公司于 2021 年 5 月 21 日公告，因公司存在以下违规行为：一、为同业投资提供第三方信用担保、为非保本理财产品出具保本承诺，部分未按规定计提风险加权资产；二、违规协助无衍生产品交易业务资格的银行发行结构性衍生产品；三、理财产品之间风险隔离不到位；四、理财资金投资非标准化债权资产认定不准确，实际余额超监管标准；五、同业投资接受第三方金融机构信用担保；六、理财资金池化运作；七、利用理财产品准备金调节收益；八、高净值客户认定不审慎；九、并表管理不到位，通过关联非银机构的内部交易，违规变相降低理财产品销售门槛；十、投资集合资金信托计划的理财产品未执行合格投资者标准；十一、投资集合资金信托

计划人数超限；十二、面向不合格个人投资者销售投资高风险资产或权益性资产的理财产品；十三、信贷资产非真实转让；十四、全权委托业务不规范；十五、未按要求向监管机构报告理财投资合作机构，被监管否决后仍未及时停办业务；十六、通过关联机构引入非合格投资者，受让以本行信用卡债权设立的信托次级受益权；十七、“智能投资受托计划业务”通过其他方式规避整改，扩大业务规模，且业务数据和材料缺失；十八、票据转贴现假卖断屡查屡犯；十九、贷款、理财或同业投资资金违规投向土地储备项目；二十、理财资金违规提供棚改项目资本金融资，向地方政府提供融资并要求地方政府提供担保；二十一、同业投资、理财资金等违规投向地价款或四证不全的房地产项目；二十二、理财资金认购商业银行增发的股票；二十三、违规为企业发行短期融资券提供搭桥融资，并用理财产品投资本行主承债券以承接表内类信贷资产；二十四、为定制公募基金提供投资顾问；二十五、为本行承销债券兑付提供资金支持；二十六、协助发行人以非市场化的价格发行债券；二十七、瞒报案件信息；于 2021 年 5 月 17 日收到中国银行保险监督管理委员会罚款 7170 万元的处罚。

本基金管理人通过对上述上市公司进行进一步了解和视为，认为上述处分不会对公司的投资价值构成实质性影响，因此本基金管理人对上述证券的投资判断未发生改变。报告期内，本基金投资的前十名证券的其余九名证券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	2,830,919.84
2	应收证券清算款	6,510,456.94
3	应收股利	-
4	应收利息	1,113,360.49
5	应收申购款	124,465.94
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,579,203.21

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	132015	18 中油 EB	5,112,500.00	2.21
2	132009	17 中油 EB	4,116,000.00	1.78

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的情况。

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 (%)
1,114	102,656.31	105,662,384.32	92.40	8,696,747.47	7.60

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	683,559.63	0.5977

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、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	50~100
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	115,356,315.36
本报告期基金总申购份额	7,460,836.87

减：本报告期基金总赎回份额	8,458,020.44
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	114,359,131.79

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

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，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产和基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未发生变更。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

基金管理人为本基金聘任的会计师事务所向本基金提供的审计服务持续期限为：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

本报告期内，基金管理人、托管人及其高级管理人员未有受到稽查或处罚的情况。

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	
东北证券	2	78,247,771.18	19.87%	72,077.90	19.84%	-
中信证券	2	66,646,773.28	16.92%	60,751.26	16.72%	-
平安证券	1	60,612,687.62	15.39%	56,449.38	15.54%	-
安信证券	1	55,463,575.08	14.08%	50,543.78	13.91%	-
兴业证券	2	53,429,615.16	13.57%	49,758.75	13.70%	-
海通证券	2	26,971,944.92	6.85%	25,119.40	6.91%	-
国泰君安	2	18,427,672.33	4.68%	17,161.61	4.72%	-
华安证券	2	6,951,429.96	1.76%	6,474.08	1.78%	-
长江证券	1	6,780,859.67	1.72%	6,314.96	1.74%	-
上海证券	1	5,400,335.06	1.37%	4,921.47	1.35%	-
方正证券	3	4,529,352.38	1.15%	4,218.36	1.16%	-
民生证券	1	4,075,539.83	1.03%	3,714.09	1.02%	-
东方财富	1	3,009,988.28	0.76%	2,743.02	0.76%	-
长城证券	2	2,388,474.24	0.61%	2,224.40	0.61%	-
申港证券	2	343,499.83	0.09%	315.65	0.09%	-
西部证券	1	291,388.75	0.07%	213.10	0.06%	-
中信建投	2	237,792.14	0.06%	221.45	0.06%	-
浙商证券	1	48,239.88	0.01%	43.96	0.01%	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-
德邦证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
国联证券	2	-	-	-	-	-

国盛证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
宏信证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中金国际	1	-	-	-	-	-
中山证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-

注：1、基金管理人选择交易单元的标准和程序如下：

(1) 选择标准： 资质雄厚，信誉良好，注册资本不少于 5 亿元人民币；财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；经营行为规范，最近两年未因重大违规行为受到中国证监会和中国人民银行处罚；内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；具备基金运作所需要的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需 要，并能为本基金提供全面的信息服 务；研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人 员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告；适当的地域分散化。

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

2、本基金本报告期券商交易单元新增：太平洋证券、方正证券、德邦证券、华安证券、国联证券。

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	成交金额	占当期债券	成交金额	占当期权

		成交总额的 比例		回购 成交总额的 比例		证 成交总额 的比例
东北证券	2,043,099.28	2.68%	62,900,000.00	8.61%	-	-
中信证券	2,066,405.40	2.71%	12,300,000.00	1.68%	-	-
平安证券	20,757,053.42	27.22%	169,500,000.00	23.21%	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	26,557,133.84	34.82%	175,200,000.00	23.99%	-	-
海通证券	-	-	48,100,000.00	6.59%	-	-
国泰君安	-	-	18,200,000.00	2.49%	-	-
华安证券	-	-	48,900,000.00	6.70%	-	-
长江证券	175,300.00	0.23%	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	22,900,000.00	3.14%	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	100,400,000.00	13.75%	-	-
申港证券	-	-	10,200,000.00	1.40%	-	-
西部证券	-	-	21,900,000.00	3.00%	-	-
中信建投	24,668,108.43	32.34%	39,700,000.00	5.44%	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
爱建证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
宏信证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
太平洋证 券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-

中金国际	-	-	-	-	-	-
中山证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-

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	华宝新飞跃灵活配置混合型证券投资基金 2020 年第 4 季度报告	基金管理人网站	2021-1-22
2	关于警惕冒用华宝基金管理有限公司名义进行诈骗活动的特别提示公告	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	2021-2-19
3	华宝现金添益交易型货币市场基金 B 类基金份额开放转换业务的公告	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	2021-2-26
4	华宝基金管理有限公司关于提示投资者完善身份信息公告	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	2021-3-9
5	华宝新飞跃灵活配置混合型证券投资基金 2020 年年度报告	基金管理人网站	2021-3-31
6	华宝新飞跃灵活配置混合型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	基金管理人网站	2021-4-22
7	华宝新优选一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金开放日常申购、赎回及转换业务的公告	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	2021-5-18
8	华宝资源优选混合型证券投资基金 C 类基金份额开放转换业务及开通定期定额投资业务的公告	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	2021-5-18
9	华宝基金管理有限公司关于深圳分公司负责人变更的公告	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	2021-6-22
10	华宝基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加鼎信汇金(北京)投资管理有限公司为代销机构及费率优惠的公告	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	2021-6-23
11	华宝基金关于旗下部分开放式基金参加交通银行申购及定投手续费率优惠活动的公告	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	2021-6-30

§ 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	报告期内持有基金份额变化情况	报告期末持有基金情况
------	----------------	------------

别	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	20210101~20210630	107,113,500.00	0.00	2,510,000.00	104,603,500.00	91.47
产品特有风险							
<p>报告期内本基金出现单一投资者持有基金份额比例超过 20%的情况。在单一投资者持有基金份额比例较高的情况下，如该投资者集中赎回，可能会增加基金的流动性风险。此外，由于基金在遇到大额赎回的时候可能需要变现部分资产，可能对持有资产的价格形成冲击，增加基金的市场风险。基金管理人将专业审慎、勤勉尽责地运作基金资产，加强防范流动性风险、市场风险，保护持有人利益。</p>							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

中国证监会批准基金设立的文件；
 华宝新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。

华宝基金管理有限公司

2021年8月27日