

# 华宝宝康消费品证券投资基金

## 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

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
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	5
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	6
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>7</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
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	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	10
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	10
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>11</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
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	11
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	11
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>11</b>
6.1 资产负债表	11
6.2 利润表	12
6.3 净资产变动表	14
6.4 报表附注	15
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>35</b>
7.1 期末基金资产组合情况	35
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	36
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	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	38
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	39
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	39

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 .....	40
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 .....	40
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 .....	40
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	40
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	40
7.12 投资组合报告附注 .....	40
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>41</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	41
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	41
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 .....	41
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>41</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>42</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	42
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 .....	42
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	42
10.4 基金投资策略的改变 .....	42
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	42
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 .....	42
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	42
10.8 其他重大事件 .....	46
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>46</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	46
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	46
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>46</b>
12.1 备查文件目录 .....	46
12.2 存放地点 .....	46
12.3 查阅方式 .....	46

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华宝宝康消费品证券投资基金
基金简称	华宝宝康消费品混合
基金主代码	240001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2003 年 7 月 15 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	295,897,471.73 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	分享我国全面建设小康社会过程中消费品各相关行业的稳步成长；为基金持有人谋求长期稳定回报。
投资策略	本基金看好消费品的发展前景，长期持有消费品组合，并注重资产在其各相关行业的配置，适当进行时机选择。在正常的市场情况下，本基金的股票投资比例范围为基金资产净值的 50%—75%；债券为 20%—45%，现金比例在 5%以上。在极端情况下，比如市场投机气氛浓烈、系统性风险急剧增加时，投资比例可作一定调整，但在合理时间内，投资比例将恢复正常水平。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×80%+中证综合债指数收益率×20%
风险收益特征	-

### 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	www.fsfund.com

址	
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	-64,999,912.15
本期利润	-87,937,353.67
加权平均基金份额本期利润	-0.2936
本期加权平均净值利润率	-9.52%
本期基金份额净值增长率	-9.32%
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	730,172,575.81
期末可供分配基金份额利润	2.4677
期末基金资产净值	849,115,226.06
期末基金份额净值	2.8696
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	983.74%

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	-7.31%	0.53%	-2.48%	0.38%	-4.83%	0.15%
过去三个月	-8.30%	0.68%	-1.35%	0.60%	-6.95%	0.08%

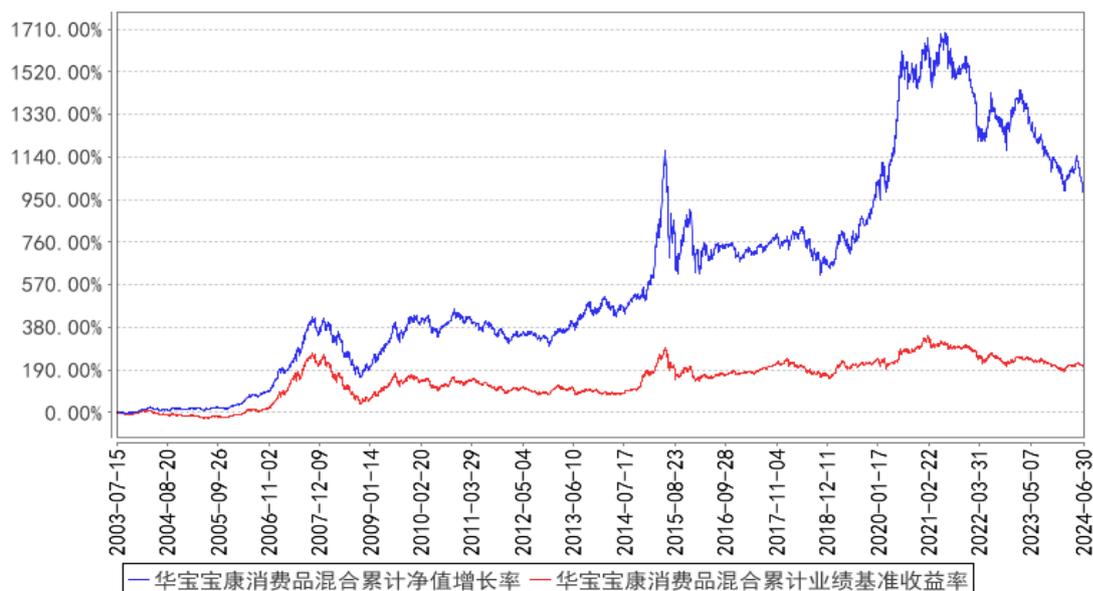
过去六个月	-9.32%	0.78%	1.56%	0.72%	-10.88%	0.06%
过去一年	-17.28%	0.72%	-6.79%	0.70%	-10.49%	0.02%
过去三年	-39.51%	0.92%	-25.42%	0.83%	-14.09%	0.09%
自基金合同生效起至今	983.74%	1.28%	206.05%	1.27%	777.69%	0.01%

注：（1）基金业绩基准：沪深 300 指数收益率×80%+中证综合债指数收益率×20%；

（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

华宝宝康消费品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 2004 年 01 月 15 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		
汤慧	本基金基金经理	2021-12-30	-	14 年	硕士。曾在海通证券研究所担任高级策略分析师。2015 年 6 月加入华宝基金管理有限公司，先后担任高级分析师、基金经理助等职务。2019 年 9 月至 2022 年 10 月任华宝消费升级混合型证券投资基金基金经理，2019 年 9 月至 2021 年 1 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，2019 年 12 月至 2021 年 12 月任华宝万物互联灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2020 年 5 月起任华宝成长策略混合型证券投资基金基金经理，2021 年 1 月起任华宝宝康灵活配置证券投资基金基金经理，2021 年 4 月至 2022 年 10 月任华宝品质生活股票型证券投资基金基金经理，2021 年 12 月起任华宝宝康消费品证券投资基金、华宝新兴消费混合型证券投资基金基金经理。

注：1、任职日期以及离任日期均以基金公告为准。

2、证券从业含义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期内，本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《华宝宝康消费品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

2024 年上半年，国内宏观整体平稳开局，经济结构逐步升级，外需整体表现突出，但是内需方面呈现出了一定疲弱的状态。这主要表现在 PPI 和 CPI 同比增速持续低迷，社会融资增速持续低迷，这使得整体的内需拉动力不足。从 GDP 的同比增速上看，1、2 季度分别增长为 5.3%、4.7%，内需的压力有所体现。从外部环境来看，美国整体的经济增长韧性较强，虽然各项数据有所波动，但是美联储的首次降息时间窗口还是不断推后，这一定程度上也约束了上半年国内货币和利率政策的操作空间。市场表现来看，上半年表现较好的板块主要集中在具备高股息特征的板块中，包括石油石化、煤炭、银行、电力、有色等，而表现落后的主要是内需强相关的板块，包括消费者服务、传媒、地产、商贸零售、医药、食品饮料等。

消费方向上，国内的消费在上半年估值压制的非常明显，EPS 角度也承受量和价的双重压力，相对表现较好的是出口链条相关的板块，主要代表是家电板块。

本基金的操作上，上半年保持了中性偏高的仓位，主要的配置方向集中在食品饮料、出口链方向。

#### 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-9.32%，业绩比较基准收益率为 1.56%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，对市场更加积极一些。一方面国内的宏观政策持续用力，更加给力，已经看到利率政策开始积极调整，财政政策也逐步蓄力，考虑到去年较低的基数效应，下半年有望看到价格指标和社融数据的企稳回升；另一方面市场的预期也修正到了比较低的水平，估值的压制已经处在历史上偏低的水平。

本基金的操作上，仓位保持在合理偏高的水平，下半年内需可能存在盈利和估值修复的机会，特别是考虑到部分的个股从股东回报角度也开始具备吸引力。此外，虽然出口链条可能受到外需波动、贸易扰动等影响，仍然看好这个方向长期的投资价值，特别是具备全球竞争力和国际化能力的企业。

#### 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及其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合规守信情况声明

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合规守信、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：华宝宝康消费品证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	112,048,644.77	154,117,185.95
结算备付金		737,293.26	343,367.70
存出保证金		182,087.54	162,903.17
交易性金融资产	6.4.7.2	736,804,907.70	809,135,844.24
其中：股票投资		535,917,132.90	603,659,586.99
基金投资		-	-
债券投资		200,887,774.80	205,476,257.25
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资		-	-

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		3,902,973.34	-
应收股利		-	-
应收申购款		93,919.42	179,586.41
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		853,769,826.03	963,938,887.47
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024年6月30日</b>	<b>上年度末 2023年12月31日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		1,805,091.43	3,233,734.70
应付赎回款		914,088.10	694,590.18
应付管理人报酬		879,113.74	973,825.14
应付托管费		146,518.96	162,304.21
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		14.11	14.58
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	909,773.63	1,072,185.08
负债合计		4,654,599.97	6,136,653.89
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	118,942,650.25	121,666,406.61
未分配利润	6.4.7.8	730,172,575.81	836,135,826.97
净资产合计		849,115,226.06	957,802,233.58
负债和净资产总计		853,769,826.03	963,938,887.47

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额净值 2.8696 元，基金份额总额 295,897,471.73 份。

## 6.2 利润表

会计主体：华宝宝康消费品证券投资基金

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	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
<b>一、营业总收入</b>		-81,397,955.66	-111,550,178.19
1. 利息收入		191,163.54	181,067.75
其中：存款利息收入	6.4.7.9	191,163.54	181,067.75
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		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-58,712,713.69	-14,168,360.26
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-67,060,694.82	-19,371,087.21
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	1,880,312.35	1,807,099.46
资产支持证券投资	6.4.7.12	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	6,467,668.78	3,395,627.49
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	-22,937,441.52	-97,681,482.94
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	61,036.01	118,597.26
<b>减：二、营业总支出</b>		6,539,398.01	10,413,498.05
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	5,512,415.38	8,833,257.81
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	918,735.92	1,472,209.64
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.18	-	-
7. 税金及附加		9.11	5.45
8. 其他费用	6.4.7.19	108,237.60	108,025.15
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-87,937,353.67	-121,963,676.24
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”</b>		-87,937,353.67	-121,963,676.24

号填列)			
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-87,937,353.67	-121,963,676.24

### 6.3 净资产变动表

会计主体：华宝宝康消费品证券投资基金

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	121,666,406.61	-	836,135,826.97	957,802,233.58
二、本期期初净资产	121,666,406.61	-	836,135,826.97	957,802,233.58
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-2,723,756.36	-	-105,963,251.16	-108,687,007.52
(一)、综合收益总额	-	-	-87,937,353.67	-87,937,353.67
(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)	-2,723,756.36	-	-18,025,897.49	-20,749,653.85
其中：1. 基金申购款	2,085,323.46	-	13,895,776.13	15,981,099.59
2. 基金赎回款	-4,809,079.82	-	-31,921,673.62	-36,730,753.44
(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	118,942,650.25	-	730,172,575.81	849,115,226.06
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	125,622,557.15	-	1,081,463,520.41	1,207,086,077.56

二、本期期初净资产	125,622,557.15	-	1,081,463,520.41	1,207,086,077.56
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-1,734,700.35	-	-136,209,395.40	-137,944,095.75
(一)、综合收益总额	-	-	-121,963,676.24	-121,963,676.24
(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)	-1,734,700.35	-	-14,245,719.16	-15,980,419.51
其中：1. 基金申购款	4,188,163.87	-	35,908,137.52	40,096,301.39
2. 基金赎回款	-5,922,864.22	-	-50,153,856.68	-56,076,720.90
(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	123,887,856.80	-	945,254,125.01	1,069,141,981.81

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：

<u>向辉</u>	<u>向辉</u>	<u>张幸骏</u>
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

华宝宝康系列开放式证券投资基金(原名为华宝兴业宝康系列开放式证券投资基金,以下简称“本系列基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2003]第 62 号《关于同意华宝兴业宝康系列证券投资基金设立的批复》核准,由华宝基金管理有限公司(原华宝兴业基金管理有限公司,已于 2017 年 10 月 17 日办理完成工商变更登记)依照《证券投资基金

管理暂行办法》及其实施细则、《开放式证券投资基金试点办法》等有关规定和《华宝兴业宝康系列开放式证券投资基金基金契约》(后更名为《华宝宝康系列开放式证券投资基金基金契约》)发起,并于 2003 年 7 月 15 日募集成立。本系列基金为契约型开放式,存续期限不定,目前下设三个子基金,分别为宝康消费品证券投资基金(以下简称“本基金”)、宝康灵活配置证券投资基金和宝康债券投资基金。本系列基金首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 3,893,701,931.41 元,其中包括本基金人民币 1,540,046,055.09 元、宝康灵活配置证券投资基金人民币 1,066,581,834.53 元和宝康债券投资基金人民币 1,287,074,041.79 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道验字(2003)第 96 号验资报告予以验证。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《华宝兴业宝康系列开放式证券投资基金更新的招募说明书》和《华宝兴业基金管理有限公司关于对华宝兴业宝康消费品证券投资基金实施基金份额拆分的公告》的有关规定,本基金于 2007 年 3 月 26 日进行了基金份额拆分,拆分比例为 2.487739364,并于 2007 年 3 月 26 日进行了变更登记。

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》,华宝兴业宝康系列开放式证券投资基金之宝康消费品证券投资基金于 2017 年 12 月 30 日起更名为华宝宝康系列开放式证券投资基金之宝康消费品证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华宝宝康系列开放式证券投资基金基金契约》的有关规定,本基金的投资范围为国内依法发行上市的公司股票(包括存托凭证)和债券及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具,其中投资于消费品类股票的比例不低于股票资产的 80%。在正常的市场情况下,本基金的股票投资比例范围为基金资产净值的 50%-75%;债券为 20%-45%;现金比例在 5%以上。本基金的业绩比较基准为:沪深 300 指数收益率 $\times$ 80%+中证综合债指数收益率 $\times$ 20%。

本财务报表由本基金的基金管理人华宝基金管理有限公司于 2024 年 8 月 30 日批准报出。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华宝宝康系列开放式证券投资基金基金契约》和在财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及 2024 年上半年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	112,048,644.77
等于：本金	112,037,947.70
加：应计利息	10,697.07
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	112,048,644.77

### 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	587,573,713.91	-	535,917,132.90	-51,656,581.01	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	197,312,110.00	1,725,730.30	200,887,774.80	1,849,934.50
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	197,312,110.00	1,725,730.30	200,887,774.80	1,849,934.50
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	784,885,823.91	1,725,730.30	736,804,907.70	-49,806,646.51	

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

#### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

#### 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

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

### 6.4.7.5 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	1,455.54
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	811,993.49

其中：交易所市场	811,993.49
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	89,507.60
其他	6,817.00
合计	909,773.63

#### 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	302,673,642.15	121,666,406.61
本期申购	5,187,543.42	2,085,323.46
本期赎回（以“-”号填列）	-11,963,713.84	-4,809,079.82
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	295,897,471.73	118,942,650.25

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

目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,023,203,085.17	-187,067,258.20	836,135,826.97
本期期初	1,023,203,085.17	-187,067,258.20	836,135,826.97
本期利润	-64,999,912.15	-22,937,441.52	-87,937,353.67
本期基金份额交易产生的变动数	-21,644,289.35	3,618,391.86	-18,025,897.49
其中：基金申购款	16,576,256.09	-2,680,479.96	13,895,776.13
	-38,220,545.44	6,298,871.82	-31,921,673.62

金赎回款			
本期已分配利润	-	-	-
本期末	936,558,883.67	-206,386,307.86	730,172,575.81

#### 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		182,144.61
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		7,695.40
其他		1,323.53
合计		191,163.54

#### 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		592,346,260.24
减：卖出股票成本总额		657,897,956.60
减：交易费用		1,508,998.46
买卖股票差价收入		-67,060,694.82

##### 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		2,184,262.35
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入		-303,950.00
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		1,880,312.35

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	120,395,000.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	118,303,950.00
减：应计利息总额	2,395,000.00
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	-303,950.00

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

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

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	6,467,668.78
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	6,467,668.78

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	-22,937,441.52

股票投资	-25,146,100.42
债券投资	2,208,658.90
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-22,937,441.52

#### 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	60,361.75
基金转换费收入	674.26
合计	61,036.01

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

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

#### 6.4.7.18 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	29,835.26
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行费用	130.00
账户维护费	18,000.00
上清所 CFCA 证书服务费	600.00
合计	108,237.60

#### 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, 基金销售机构
华宝信托有限责任公司(“华宝信托”)	基金管理人的股东
华平资产管理有限合伙(Warburg Pincus Asset Management. L.P.)	基金管理人的股东
江苏省铁路集团有限公司(“江苏铁集”)	基金管理人的股东
中国宝武钢铁集团有限公司(“宝武集团”)	华宝信托的最终控制人
华宝证券股份有限公司(“华宝证券”)	受宝武集团控制的公司, 基金销售机构
华宝投资有限公司(“华宝投资”)	受宝武集团控制的公司
宝武集团财务有限责任公司(“宝武财务”)	受宝武集团控制的公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

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	5,512,415.38	8,833,257.81
其中：应支付销售机构的客户维护费	2,210,520.37	3,524,919.89

应支付基金管理人的净管理费	3,301,895.01	5,308,337.92
---------------	--------------	--------------

注：支付基金管理人华宝基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.20\% / \text{当年天数。}$$

#### 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	918,735.92	1,472,209.64

注：支付基金托管人中国建设银行股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值 0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.20\% / \text{当年天数。}$$

#### 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

##### 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自有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间基金管理人未运用自有资金投资本基金。

##### 6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末除基金管理人外其他关联方未投资本基金。

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2024年1月1日至2024年6月30日		2023年1月1日至2023年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	112,048,644.77	182,144.61	144,832,909.10	176,036.92

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	184	3,199.76	3,790.40	-
001379	腾达科技	2024年1月11日	6个月	新股锁定	16.98	13.48	213	3,616.74	2,871.24	-
001389	广合科技	2024年3月26日	6个月	新股锁定	17.43	34.56	222	3,869.46	7,672.32	-
301536	星辰科技	2024年3月20日	6个月	新股锁定	16.16	32.27	481	7,772.96	15,521.87	-
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	711	8,446.68	13,494.78	-
301566	达	2023	6个月	新股	8.90	16.97	576	5,126.40	9,774.72	-

	利凯普	2024年12月22日		锁定						
301580	爱迪特	2024年6月19日	6个月	新股锁定	44.95	65.93	202	9,079.90	13,317.86	-
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	-
301589	诺瓦星云	2024年2月1日	6个月	新股锁定	126.89	188.01	691	87,680.99	129,914.91	-
301589	诺瓦星云	2024年5月30日	2个月	新股锁定-送股	-	188.01	553	-	103,969.53	-
603082	北自科技	2024年1月23日	6个月	新股锁定	21.28	29.49	107	2,276.96	3,155.43	-
603285	键邦股份	2024年6月28日	6个月	新股锁定	18.65	18.65	129	2,405.85	2,405.85	-
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	1,158	21,596.70	21,596.70	-
603312	西典新能	2024年1月4日	6个月	新股锁定	29.02	25.36	130	3,772.60	3,296.80	-
603350	安乃达	2024年6月26日	6个月	新股锁定	20.56	20.56	106	2,179.36	2,179.36	-
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	945	19,429.20	19,429.20	-
603381	永	2024	6个月	新股	23.35	25.13	178	4,156.30	4,473.14	-

	臻股份	年 6 月 19 日		锁定						
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	上海合晶	2024 年 2 月 1 日	6 个月	新股锁定	22.66	15.89	866	19,623.56	13,760.74	-
688691	灿芯股份	2024 年 4 月 2 日	6 个月	新股锁定	19.86	42.51	247	4,905.42	10,499.97	-
688692	达梦数据	2024 年 6 月 4 日	6 个月	新股锁定	86.96	174.93	175	15,218.00	30,612.75	-
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	-

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

本基金是一只偏股型的证券投资基金，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和债券等。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、各项业务全面实施的监督反馈；最后是以内部控制委员会为主体的第四层防线，实施对公司各类业务和风险的总体监督、控制，并对风险管理部和合规审计部的工作予以直接指导。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法是通过结合定性分析和定量分析方法，估

测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具的特征，通过特定的风险量化指标、模型、日常的量化报告，确定相应置信程度和风险损失的限度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款均存放于大型股份制商业银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于本报告期末，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券和资产支持证券占基金净资产的比例较低（含债券投资比例为零），因此无重大信用风险（上年度末：同）。

#### 6.4.13.3 流动性风险

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

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

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

##### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》

及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司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。

#### 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、存出保证金和债券投资等。

#### 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	112,048,644.77	-	-	-	112,048,644.77
结算备付金	737,293.26	-	-	-	737,293.26
存出保证金	182,087.54	-	-	-	182,087.54
交易性金融资产	67,718,955.89	85,194,807.13	47,974,011.78	535,917,132.90	736,804,907.70
应收申购款	-	-	-	93,919.42	93,919.42
应收清算款	-	-	-	3,902,973.34	3,902,973.34
资产总计	180,686,981.46	85,194,807.13	47,974,011.78	539,914,025.66	853,769,826.03
负债					
应付赎回款	-	-	-	914,088.10	914,088.10
应付管理人报酬	-	-	-	879,113.74	879,113.74
应付托管费	-	-	-	146,518.96	146,518.96
应付清算款	-	-	-	1,805,091.43	1,805,091.43
应交税费	-	-	-	14.11	14.11
其他负债	-	-	-	909,773.63	909,773.63
负债总计	-	-	-	4,654,599.97	4,654,599.97
利率敏感度缺口	180,686,981.46	85,194,807.13	47,974,011.78	535,259,425.69	849,115,226.06
上年度末 2023年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	154,117,185.95	-	-	-	154,117,185.95
结算备付金	343,367.70	-	-	-	343,367.70
存出保证金	162,903.17	-	-	-	162,903.17
交易性金融资产	119,989,183.57	85,487,073.68	-	603,659,586.99	809,135,844.24
应收申购款	-	-	-	179,586.41	179,586.41
资产总计	274,612,640.39	85,487,073.68	-	603,839,173.40	963,938,887.47
负债					
应付赎回款	-	-	-	694,590.18	694,590.18
应付管理人报酬	-	-	-	973,825.14	973,825.14

应付托管费	-	-	-	162,304.21	162,304.21
应付清算款	-	-	-	3,233,734.70	3,233,734.70
应交税费	-	-	-	14.58	14.58
其他负债	-	-	-	1,072,185.08	1,072,185.08
负债总计	-	-	-	6,136,653.89	6,136,653.89
利率敏感度缺口	274,612,640.39	85,487,073.68	-	-597,702,519.51	957,802,233.58

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）
	1. 市场利率下降 25 个基点	1,412,053.79	481,504.00
	2. 市场利率上升 25 个基点	-1,408,811.08	-478,187.22

#### 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”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，做出资产配置及组合构建的决定；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。本基金投资组合中股票投资比例范围为基

金融资产净值的 50%-75%；债券为 20%-45%；现金比例在 5%以上。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR (Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 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	535,917,132.90	63.11	603,659,586.99	63.03
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	535,917,132.90	63.11	603,659,586.99	63.03

#### 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%	36,147,794.40	35,547,811.50
2. 业绩比较基准下降 5%	-36,147,794.40	-35,547,811.50	

#### 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	536,899,565.24	603,286,986.36
第二层次	199,515,193.03	204,093,887.68
第三层次	390,149.43	1,754,970.20
合计	736,804,907.70	809,135,844.24

##### 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	535,917,132.90	62.77
	其中：股票	535,917,132.90	62.77
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	200,887,774.80	23.53
	其中：债券	200,887,774.80	23.53

	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	112,785,938.03	13.21
8	其他各项资产	4,178,980.30	0.49
9	合计	853,769,826.03	100.00

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

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	530,528,161.56	62.48
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	4,374,000.00	0.52
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	46,981.02	0.01
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	967,990.32	0.11
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	535,917,132.90	63.11

## 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	000858	五 粮 液	496,005	63,508,480.20	7.48
2	600809	山西汾酒	270,000	56,937,600.00	6.71
3	300979	华利集团	850,000	51,722,500.00	6.09
4	600519	贵州茅台	35,000	51,358,650.00	6.05
5	002847	盐津铺子	899,980	38,492,144.60	4.53
6	000596	古井贡酒	169,862	35,852,772.34	4.22
7	688169	石头科技	79,524	31,221,122.40	3.68
8	000333	美的集团	420,425	27,117,412.50	3.19
9	000568	泸州老窖	160,000	22,958,400.00	2.70
10	600600	青岛啤酒	300,000	21,831,000.00	2.57
11	000625	长安汽车	1,500,000	20,145,000.00	2.37
12	688639	华恒生物	250,000	19,097,500.00	2.25
13	600559	老白干酒	1,000,000	18,180,000.00	2.14
14	600690	海尔智家	600,000	17,028,000.00	2.01
15	300577	开润股份	500,000	10,415,000.00	1.23
16	603198	迎驾贡酒	180,000	10,350,000.00	1.22
17	603816	顾家家居	300,000	9,687,000.00	1.14
18	000729	燕京啤酒	1,000,000	8,830,000.00	1.04
19	300856	科思股份	200,000	6,402,000.00	0.75
20	300783	三只松鼠	200,000	4,374,000.00	0.52
21	300973	立高食品	120,000	3,370,800.00	0.40
22	000921	海信家电	100,000	3,224,000.00	0.38
23	003000	劲仔食品	200,000	2,410,000.00	0.28
24	000888	峨眉山 A	88,888	967,990.32	0.11
25	301589	诺瓦星云	1,244	233,884.44	0.03
26	688692	达梦数据	175	30,612.75	0.00
27	603285	键邦股份	1,287	24,002.55	0.00
28	603350	安乃达	1,051	21,608.56	0.00
29	301536	星辰科技	481	15,521.87	0.00
30	688584	上海合晶	866	13,760.74	0.00
31	301565	中仑新材	711	13,494.78	0.00
32	301580	爱迪特	202	13,317.86	0.00
33	688691	灿芯股份	247	10,499.97	0.00
34	301566	达利凯普	576	9,774.72	0.00
35	001389	广合科技	222	7,672.32	0.00
36	301539	宏鑫科技	361	7,155.02	0.00
37	688695	中创股份	186	5,868.30	0.00

38	688530	欧莱新材	344	5,538.40	0.00
39	301588	美新科技	257	5,461.25	0.00
40	603381	永臻股份	178	4,473.14	0.00
41	001359	平安电工	184	3,790.40	0.00
42	603312	西典新能	130	3,296.80	0.00
43	603082	北自科技	107	3,155.43	0.00
44	001379	腾达科技	213	2,871.24	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	000858	五粮液	67,948,118.22	7.09
2	600809	山西汾酒	41,086,513.40	4.29
3	000596	古井贡酒	40,889,208.30	4.27
4	000333	美的集团	28,456,956.77	2.97
5	002594	比亚迪	28,228,561.04	2.95
6	688169	石头科技	27,997,352.09	2.92
7	600600	青岛啤酒	26,194,841.67	2.73
8	600559	老白干酒	23,233,032.00	2.43
9	600029	南方航空	22,809,601.40	2.38
10	601288	农业银行	22,532,886.00	2.35
11	603939	益丰药房	22,498,961.80	2.35
12	002847	盐津铺子	20,737,964.40	2.17
13	601111	中国国航	18,379,911.00	1.92
14	000568	泸州老窖	17,604,175.40	1.84
15	000729	燕京啤酒	16,757,285.00	1.75
16	603885	吉祥航空	13,834,938.00	1.44
17	000921	海信家电	12,819,516.00	1.34
18	600690	海尔智家	12,024,203.00	1.26
19	603198	迎驾贡酒	11,538,430.20	1.20
20	603816	顾家家居	11,359,013.00	1.19

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	000858	五粮液	38,382,577.05	4.01
2	002594	比亚迪	28,259,429.00	2.95
3	000568	泸州老窖	27,642,370.00	2.89
4	603345	安井食品	26,745,577.35	2.79
5	601288	农业银行	25,488,981.00	2.66

6	603939	益丰药房	24,519,821.00	2.56
7	600029	南方航空	23,522,403.00	2.46
8	002567	唐人神	23,328,178.00	2.44
9	600975	新五丰	22,977,402.34	2.40
10	688639	华恒生物	22,389,631.56	2.34
11	000596	古井贡酒	19,622,595.00	2.05
12	300498	温氏股份	19,050,761.00	1.99
13	601111	中国国航	18,800,551.00	1.96
14	603288	海天味业	15,740,170.71	1.64
15	603885	吉祥航空	15,484,663.00	1.62
16	002475	立讯精密	13,520,484.52	1.41
17	600276	恒瑞医药	11,677,487.00	1.22
18	601021	春秋航空	11,607,551.00	1.21
19	605296	神农集团	11,131,919.80	1.16
20	600887	伊利股份	11,118,906.00	1.16

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	615,301,602.93
卖出股票收入（成交）总额	592,346,260.24

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	199,469,581.92	23.49
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	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	-	-
7	可转债（可交换债）	1,418,192.88	0.17
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	200,887,774.80	23.66

#### 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	019696	23 国债 03	820,000	83,776,614.25	9.87
2	019733	24 国债 02	670,000	67,718,955.89	7.98

3	019721	23 国债 18	465,000	47,974,011.78	5.65
4	113655	欧 22 转债	13,130	1,418,192.88	0.17

**7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细**

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

**7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细**

本基金本报告期末未持有贵金属。

**7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细**

本基金本报告期末未持有权证。

**7.10 本基金投资股指期货的投资政策**

本基金未投资股指期货。

**7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

**7.11.1 本期国债期货投资政策**

本基金未投资国债期货。

**7.11.2 本期国债期货投资评价**

本基金未投资国债期货。

**7.12 投资组合报告附注**

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

基金管理人没有发现本基金投资的前十名证券的发行主体在报告期内被监管部门立案调查，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚，无证券投资决策程序需特别说明。

**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	182,087.54
2	应收清算款	3,902,973.34
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	93,919.42
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,178,980.30

## 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	113655	欧 22 转债	1,418,192.88	0.17

## 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 (%)
70,225	4,213.56	961,236.00	0.32	294,936,235.73	99.68

## 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	18,421.27	0.0062

## 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 (2003 年 7 月 15 日) 基金份额总额	1,541,018,133.75
本报告期期初基金份额总额	302,673,642.15
本报告期基金总申购份额	5,187,543.42
减：本报告期基金总赎回份额	11,963,713.84
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	295,897,471.73

## § 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：本基金合同生效之日起至本报告期末。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚的情况。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，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 (%)	
东吴证券	2	271,968,513.82	22.54	257,256.91	22.66	-
国盛证券	2	245,666,848.05	20.36	231,676.59	20.40	-

德邦证券	2	220,146,856.94	18.25	206,032.26	18.14	-
民生证券	1	110,278,965.74	9.14	103,210.47	9.09	-
申万宏源	1	102,668,816.79	8.51	96,087.87	8.46	-
平安证券	1	98,174,568.59	8.14	92,861.06	8.18	-
华安证券	2	58,306,425.51	4.83	55,159.57	4.86	-
国投证券	1	34,288,428.24	2.84	32,090.44	2.83	-
海通证券	3	28,324,443.78	2.35	26,508.98	2.33	-
麦高证券	1	22,841,621.60	1.89	21,606.11	1.90	-
东北证券	2	8,834,351.39	0.73	8,338.38	0.73	-
国泰君安	2	4,918,714.68	0.41	4,652.45	0.41	-
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  
要，并能为本基金提供全面的信息服  
务；研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告；适当的地域分散化。

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

2、本报告期租用的证券公司交易单元退租的有：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(%)
东吴证券	52,790,668.64	46.18	-	-	-	-
国盛证券	56,488,655.34	49.41	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	5,041,246.30	4.41	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
麦高证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-

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
4	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
5	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
6	华宝宝康消费品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

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

## § 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；

华宝宝康系列开放式证券投资基金基金契约；

华宝宝康系列开放式证券投资基金招募说明书；

华宝宝康系列开放式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

2024 年 8 月 30 日