

华宝新飞跃灵活配置混合型证券投资基金 2025 年中期报告

2025 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：2025 年 8 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 08 月 27 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 2025 年 01 月 01 日起至 2025 年 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	6
§ 4 管理人报告	7
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	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	42
7.1 期末基金资产组合情况	42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	42
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	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	54
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	55
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	56

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	56
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	56
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	56
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	56
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	56
7.12 投资组合报告附注	57
§ 8 基金份额持有人信息	59
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	59
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	59
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	59
§ 9 开放式基金份额变动	59
§ 10 重大事件揭示	59
10.1 基金份额持有人大会决议	59
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	59
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	60
10.4 基金投资策略的改变	60
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	60
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	60
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	60
10.8 其他重大事件	63
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	64
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	64
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	64
§ 12 备查文件目录	64
12.1 备查文件目录	64
12.2 存放地点	64
12.3 查阅方式	64

§ 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	107,311,946.42 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	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。 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。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×50%+上证国债指数收益率×50%
风险收益特征	本基金是一只主动投资的混合型基金，其长期平均预期风险和预期收益率低于股票型基金，高于债券型基金、货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华宝基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	周雷	王小飞
	联系电话	021-38505888	021-60637103
	电子邮箱	xxpl@fsfund.com	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		400-700-5588、400-820-5050	021-60637228
传真		021-38505777	021-60635778
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		200120	100033
法定代表人		黄孔威	张金良

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.fsfund.com
基金中期报告备置地点	基金管理人办公场所和基金托管人办公场所。

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2025 年 1 月 1 日 - 2025 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	5,861,486.63
本期利润	2,341,875.74
加权平均基金份额本期利润	0.0225
本期加权平均净值利润率	1.08%
本期基金份额净值增长率	1.05%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	100,766,858.44
期末可供分配基金份额利润	0.9390
期末基金资产净值	227,872,013.73
期末基金份额净值	2.1235
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	112.35%

- 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

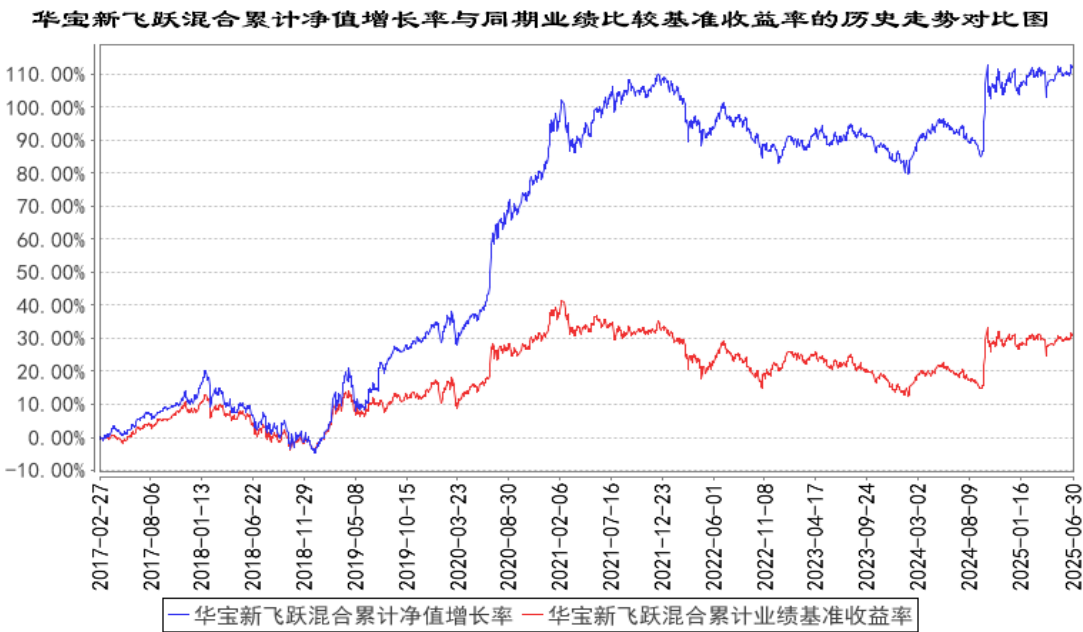
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差	①－③	②－④
----	----------	------------	------------	--------------	-----	-----

		②		准差④		
过去一个月	1.26%	0.26%	1.50%	0.28%	-0.24%	-0.02%
过去三个月	1.05%	0.51%	1.34%	0.53%	-0.29%	-0.02%
过去六个月	1.05%	0.49%	0.85%	0.49%	0.20%	0.00%
过去一年	10.33%	0.68%	10.11%	0.68%	0.22%	0.00%
过去三年	5.58%	0.51%	1.79%	0.54%	3.79%	-0.03%
自基金合同生效起至今	112.35%	0.67%	31.14%	0.59%	81.21%	0.08%

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

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

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



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

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

华宝基金管理有限公司（公司原名“华宝兴业基金管理有限公司”）于 2003 年 2 月 12 日经中国证监会批准设立，2003 年 3 月 7 日在国家工商总局注册登记并正式开业，是国内首批中外合资

基金管理公司。成立之初，公司注册资本为 1 亿元人民币，2007 年经中国证监会批准，公司注册资本增加至 1.5 亿元人民币。2017 年公司名称变更为“华宝基金管理有限公司”。目前公司股东为华宝信托有限责任公司、美国华平资产管理有限合伙（Warburg Pincus Asset Management, L.P.）和江苏省铁路集团有限公司，持有股权占比分别为 51%、29%、20%。公司在北京和深圳设有分公司。截至本报告期末（2025 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 153 只，涵盖股票型基金、混合型基金、债券型基金、货币市场基金、FOF 等。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李栋梁	本基金基金经理、固定收益投资总监、混合资产部总经理、固定收益部总经理	2017-02-27	-	22 年	硕士。曾在国联证券有限责任公司、华宝信托有限责任公司和太平资产管理有限公司从事固定收益的证券研究和投资管理工作。2010 年 10 月加入华宝基金管理有限公司，先后担任债券分析师、基金经理助理、固定收益部副总经理、混合资产部副总经理等职务，现任固定收益投资总监、混合资产部总经理、固定收益部总经理。2011 年 6 月起任华宝宝康债券投资基金基金经理，2014 年 10 月至 2023 年 3 月任华宝增强收益债券型证券投资基金基金经理，2015 年 10 月至 2017 年 12 月任华宝新机遇灵活配置混合型证券投资基金(LOF)、华宝新价值灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2016 年 4 月至 2019 年 6 月任华宝宝鑫纯债一年定期开放债券型证券投资基金基金经理，2016 年 6 月起任华宝可转债债券型证券投资基金基金经理，2016 年 9 月至 2017 年 12 月任华宝新活力灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2016 年 12 月至 2021 年 3 月任华宝新起点灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2017 年 1 月至 2018 年 6 月任华宝新动力一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2017 年 2 月起任华宝新飞跃灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2017 年 3 月至 2018 年 8 月任华宝新优选一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2017 年 3 月至 2018 年 7 月任华宝新回报一年定期开放混合型证券投资基金基金经理，2017

					年 6 月至 2019 年 3 月任华宝新优享灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2021 年 4 月起任华宝双债增强债券型证券投资基金基金经理，2022 年 5 月起任华宝安宜六个月持有期债券型证券投资基金基金经理，2022 年 11 月至 2024 年 9 月任华宝安悦一年持有期混合型证券投资基金基金经理，2023 年 1 月起任华宝安融六个月持有期债券型证券投资基金基金经理，2023 年 8 月起任华宝安元债券型证券投资基金基金经理。
唐雪倩	本基金基金经理	2023-09-23	-	10 年	硕士。2015 年 7 月加入华宝基金管理有限公司，先后担任分析师、基金经理助理等职务。2021 年 10 月起任华宝安享混合型证券投资基金基金经理，2021 年 10 月至 2022 年 6 月任华宝安益混合型证券投资基金基金经理，2022 年 6 月起任华宝红利精选混合型证券投资基金基金经理，2022 年 8 月至 2023 年 11 月任华宝高端装备股票型发起式证券投资基金基金经理，2023 年 4 月起任华宝新机遇灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) 基金经理，2023 年 4 月至 2024 年 1 月任华宝未来主导产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2023 年 9 月起任华宝新飞跃灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2024 年 6 月起任华宝新价值灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2025 年 3 月起任华宝远识混合型证券投资基金基金经理。

注：1、任职日期以及离任日期均以基金公告为准。

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

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期内，本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作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，本基金管理人旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，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% 的交易共有 1 次，系指量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。

本报告期内，本基金没有发现异常交易行为。

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 12 月份中央政治局会议指出：2025 年要坚持稳中求进、以进促稳、先立后破，强化宏观政策逆周期和跨周期调节，继续实施积极的财政政策和稳健的货币政策。积极的财政政策要适度加力、提质增效，稳健的货币政策要灵活适度、精准有效。要增强宏观政策取向一致性，加强经济宣传和舆论引导。要以科技创新引领现代化产业体系建设，提升产业链供应链韧性和安全水平。要着力扩大国内需求，形成消费和投资相互促进的良性循环。今年 4 月份中共中央政治局召开会议，会议认为，今年以来各项宏观政策协同发力，经济呈现向好态势，社会信心持续提振，高质量发展扎实推进，社会大局保持稳定。同时，我国经济持续回升向好的基础还需要进一步稳固，外部冲击影响加大。要强化底线思维，充分备足预案，扎实做好经济工作。会议强调，要加紧实施更加积极有为的宏观政策，用好用足更加积极的财政政策和适度宽松的货币政策。加快地方政府专项债券、超长期特别国债等发行使用。兜牢基层“三保”底线。适时降准降息，保持流动性充裕，加力支持实体经济。创设新的结构性货币政策工具，设立新型政策性金融工具，支持科技创新、扩大消费、稳定外贸等。强化政策取向一致性。

上半年权益类资产表现较好，一季度 TMT 受到行业催化表现较好。4 月份权益市场受到关税战的影响，出现短期调整后持续上涨，光模块、创新药、大金融等表现较好。转债市场走势

和股票市场基本一致，转债的中位数不断提升，转债估值处在高位。纯债市场一季度调整，各个期限段收益率均上行，二季度收益率震荡下行。

上半年基金维持了股票的投资风格和比例，灵活调整了组合久期，并对转债进行了少量交易。

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 1.05%，业绩比较基准收益率为 0.85%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年，我国 GDP 为 660536 亿元，按不变价格计算，同比增长 5.3%，经济运行总体平稳。下半年关注稳增长政策和反内卷政策的力度。若反内卷政策力度较大且效果好，叠加去年下半年物价水平基数下降，PPI 环比回升，同比降幅收窄，综合考虑 CPI 和 PPI 的走势，GDP 平减指数可能探底回升。名义 GDP 增速最终取决于 GDP 增速和平减指数。对于纯债来说，收益率绝对水平不高，投资难度加大。对于权益类资产来说，市场预期较好，结构性机会较多。

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适用性的情况后及时修订估值方法。基金在投资新品种时，由估值委员会评价现有估值政策和程序的适用性。参与估值的人员均具备估值业务所需的专业胜任能力，参与估值各方之间不存在重大利益冲突。

本基金的估值由基金会计负责，基金会计以本基金为会计核算主体，基金会计核算独立于公司会计核算，独立建账、独立核算。基金会计采用专用的财务核算软件系统进行基金核算及账务处理；每日按时接收成交数据及权益数据，进行基金估值。基金会计核算采用基金管理人与托管银行双人同步独立核算、相互核对的方式进行；基金会计每日就基金的会计核算、基金估值等与托管银行进行核对，每日估值结果必须与托管行核对一致后才能对外公告。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中债金融估值中心有限公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、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：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	650,387.69	2,505,487.82
结算备付金		1,817,793.50	2,117,567.79
存出保证金		849,414.89	1,143,715.37
交易性金融资产	6.4.7.2	219,034,056.86	208,676,284.93
其中：股票投资		124,606,622.89	133,214,367.36
基金投资		-	-
债券投资		94,427,433.97	75,461,917.57
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	5,986,000.00	10,344,340.25
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		11,172.68	3,551.32
应收股利		-	-
应收申购款		29,356.56	19,963.52
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		228,378,182.18	224,810,911.00
负债和净资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		46,349.15	698,721.26
应付赎回款		121,811.76	87,961.19
应付管理人报酬		110,459.54	112,756.66
应付托管费		27,614.92	28,189.15
应付销售服务费		46,024.83	46,981.96
应付投资顾问费		-	-
应交税费		2.65	10.22
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	153,905.60	257,151.49
负债合计		506,168.45	1,231,771.93
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	107,311,946.42	106,397,581.97
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	120,560,067.31	117,181,557.10
净资产合计		227,872,013.73	223,579,139.07
负债和净资产总计		228,378,182.18	224,810,911.00

注： 报告截止日 2025 年 06 月 30 日，基金份额净值 2.1235 元，基金份额总额 107,311,946.42 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：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
一、营业总收入		3,552,275.21	7,826,253.50
1. 利息收入		75,707.95	76,028.59
其中：存款利息收入	6.4.7.9	17,521.82	25,282.97
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		58,186.13	50,745.62
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		6,991,808.69	-154,040.89
其中：股票投资收益	6.4.7.10	3,813,046.96	-2,074,425.53
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	1,179,733.19	601,825.34
资产支持证券投资		-	-
收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-78,417.47	-683,191.52
股利收益	6.4.7.15	2,077,446.01	2,001,750.82
以摊余成本计量的 金融资产终止确认产生的 收益		-	-
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	-3,519,610.89	7,898,330.24
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	4,369.46	5,935.56
减：二、营业总支出		1,210,399.47	1,178,809.07
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	646,299.69	638,482.53
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	161,575.02	159,620.57
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	269,291.58	266,034.33
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		28,450.20	6,758.30

其中：卖出回购金融资产支出		28,450.20	6,758.30
6. 信用减值损失	6.4.7.18	-	-
7. 税金及附加		1,145.42	3,047.98
8. 其他费用	6.4.7.19	103,637.56	104,865.36
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		2,341,875.74	6,647,444.43
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		2,341,875.74	6,647,444.43
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		2,341,875.74	6,647,444.43

6.3 净资产变动表

会计主体：华宝新飞跃灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 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	106,397,581.97	-	117,181,557.10	223,579,139.07
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	106,397,581.97	-	117,181,557.10	223,579,139.07
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	914,364.45	-	3,378,510.21	4,292,874.66
（一）、综合收益总额	-	-	2,341,875.74	2,341,875.74
（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）	914,364.45	-	1,036,634.47	1,950,998.92
其中：1. 基金申购款	10,301,199.44	-	11,306,209.94	21,607,409.38
2. 基金赎回	-9,386,834.99	-	-10,269,575.47	-19,656,410.46

回款				
（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）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	107,311,946.42	-	120,560,067.31	227,872,013.73
项目	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	123,932,240.85	-	107,229,873.62	231,162,114.47
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	123,932,240.85	-	107,229,873.62	231,162,114.47
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	4,071,264.11	-	11,129,662.22	15,200,926.33
（一）、综合收益总额	-	-	6,647,444.43	6,647,444.43
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	4,071,264.11	-	4,482,217.79	8,553,481.90
其中：1. 基金申购款	33,749,388.46	-	31,077,013.29	64,826,401.75
2. 基金赎回款	-29,678,124.35	-	-26,594,795.50	-56,272,919.85
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-

（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	128,003,504.96	-	118,359,535.84	246,363,040.80

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

向辉
基金管理人负责人

李孟恒
主管会计工作负责人

张幸骏
会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华宝新飞跃灵活配置混合型证券投资基金（原名华宝兴业新飞跃灵活配置混合型证券投资基金，以下简称“本基金”）系由基金管理人华宝基金管理有限公司（原华宝兴业基金管理有限公司，已于 2017 年 10 月 17 日办理完成工商变更登记）依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《华宝兴业新飞跃灵活配置混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）及其他有关法律法规的规定，经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）以证监许可[2016]2909 号文批准公开募集。本基金为契约型开放式基金，存续期限为不定期，首次设立募集基金份额为 300,097,996.34 份，经德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）验证，并出具了编号为德师报（验）字（17）第 00038 号的验资报告。基金合同于 2017 年 2 月 27 日正式生效。本基金的基金管理人为华宝基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

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

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

金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

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

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

本财务报表已于 2025 年 8 月 27 日经本基金的基金管理人批准。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2025 年 6 月 30 日的财务状况以及 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

（1）印花税

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

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

（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征增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

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

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。对证券投资基金在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

（3）城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

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

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

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税；

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日
活期存款	650,387.69
等于：本金	649,954.91
加：应计利息	432.78
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	650,387.69

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2025 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		108,818,512.10	-	124,606,622.89	15,788,110.79
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	12,494,148.00	113,414.38	12,612,164.38	4,602.00
	银行间市场	80,586,607.03	772,269.59	81,815,269.59	456,392.97
	合计	93,080,755.03	885,683.97	94,427,433.97	460,994.97
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		201,899,267.13	885,683.97	219,034,056.86	16,249,105.76

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日		
	合同/名义	公允价值	备注

	金额	资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	-6,702,120.00	-	-	
其中：股指期货投资	-6,702,120.00	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	-6,702,120.00	-	-	

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IF2509	IF2509	-6.00	-6,996,600.00	-294,480.00
合计				-294,480.00
减：可抵销期货暂收款				-294,480.00
净额				0.00

注：（1）买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

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

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

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 2025 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	5,986,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	5,986,000.00	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	69,603.04
其中：交易所市场	68,863.04
银行间市场	740.00
应付利息	-
预提费用	84,302.56
合计	153,905.60

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	106,397,581.97	106,397,581.97
本期申购	10,301,199.44	10,301,199.44
本期赎回（以“-”号填列）	-9,386,834.99	-9,386,834.99
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	107,311,946.42	107,311,946.42

注：申购含红利再投以及转换入份(金)额，赎回含转换出份(金)额。

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	93,885,670.40	23,295,886.70	117,181,557.10
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	93,885,670.40	23,295,886.70	117,181,557.10

本期利润	5,861,486.63	-3,519,610.89	2,341,875.74
本期基金份额交易产生的变动数	1,019,701.41	16,933.06	1,036,634.47
其中：基金申购款	9,535,932.88	1,770,277.06	11,306,209.94
基金赎回款	-8,516,231.47	-1,753,344.00	-10,269,575.47
本期已分配利润	-	-	-
本期末	100,766,858.44	19,793,208.87	120,560,067.31

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	6,922.86
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	10,578.14
其他	20.82
合计	17,521.82

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	37,443,882.26
减：卖出股票成本总额	33,580,625.82
减：交易费用	50,209.48
买卖股票差价收入	3,813,046.96

6.4.7.10.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

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 2025年1月1日至2025年6月30日
债券投资收益——利息收入	760,594.49
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	419,138.70
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	1,179,733.19

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 2025年1月1日至2025年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	30,626,958.18
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	29,821,016.98
减：应计利息总额	386,017.97
减：交易费用	784.53
买卖债券差价收入	419,138.70

6.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

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

无。

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
股指期货投资收益	-78,417.47

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
股票投资产生的股利收益	2,077,446.01
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-

合计	2,077,446.01
----	--------------

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-3,230,464.22
股票投资	-2,995,351.50
债券投资	-235,112.72
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-289,146.67
权证投资	-
期货投资	-289,146.67
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	-3,519,610.89

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	4,363.31
基金转换费收入	6.15
合计	4,369.46

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
审计费用	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	735.00
账户维护费	18,000.00

上清所 CFCA 证书服务费	600.00
合计	103,637.56

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无需要披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华宝基金管理有限公司(“华宝基金”)	基金管理人, 注册登记机构, 基金销售机构
中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	基金托管人
华宝信托有限责任公司(“华宝信托”)	基金管理人的股东
华平资产管理有限合伙(Warburg Pincus Asset Management.L.P.)	基金管理人的股东
江苏省铁路集团有限公司(“江苏铁集”)	基金管理人的股东
中国宝武钢铁集团有限公司(“宝武集团”)	华宝信托的最终控制人
华宝证券股份有限公司(“华宝证券”)	受宝武集团控制的公司, 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

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 权证交易

无。

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	646,299.69	638,482.53
其中：应支付销售机构的客户维护费	19,049.00	19,369.59
应支付基金管理人的净管理费	627,250.69	619,112.94

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 0.6%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：

日管理人报酬=前一日基金资产净值 ×0.6% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	161,575.02	159,620.57

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.15%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：

日托管费=前一日基金资产净值 × 0.15% / 当年天数。

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 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	247,313.84
合计	247,313.84
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
	华宝新飞跃混合
华宝基金	241,823.05
合计	241,823.05

注：销售服务费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

其计算公式为：日销售服务费＝前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期内及上年度可比期间无转融通证券出借业务。

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

本基金本报告期内及上年度可比期间无转融通证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2025 年 6 月 30 日		上年度末 2024年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例（%）	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例（%）
华宝投资有限 公司	94,603,500.00	88.16	94,603,500.00	88.92

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024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	650,387.69	6,922.86	1,700,445.18	7,223.66

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（2025 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
001335	信凯科技	2025 年 4 月 2 日	6 个月	新股锁定	12.80	28.05	80	1,024.00	2,244.00	-
001356	富岭股份	2025 年 1 月 16 日	6 个月	新股锁定	5.30	14.44	613	3,248.90	8,851.72	-
001382	新亚电缆	2025 年 3 月 13 日	6 个月	新股锁定	7.40	20.21	366	2,708.40	7,396.86	-
001388	信通电子	2025 年 6 月 24 日	1 个月内（含）	新股流通受限	16.42	16.42	843	13,842.06	13,842.06	-
001388	信通电子	2025 年 6 月 24 日	6 个月	新股锁定	16.42	16.42	94	1,543.48	1,543.48	-
001390	古麒绒材	2025 年 5 月 21 日	6 个月	新股锁定	12.08	18.12	178	2,150.24	3,225.36	-
001395	亚联机械	2025 年 1 月 20 日	6 个月	新股锁定	19.08	47.25	80	1,526.40	3,780.00	-
301173	毓恬冠佳	2025 年 2 月 24 日	6 个月	新股锁定	28.33	44.98	173	4,901.09	7,781.54	-
301275	汉	2025	6 个月	新股	27.50	56.19	206	5,665.00	11,575.14	-

	朔科技	年3月4日		锁定						
301458	钧崴电子	2025年1月2日	6个月	新股锁定	10.40	34.11	680	7,072.00	23,194.80	-
301479	弘景光电	2025年3月6日	6个月	新股锁定	41.90	77.87	130	5,447.00	10,123.10	-
301479	弘景光电	2025年5月28日	1-6个月(含)	新股锁定-送股	-	77.87	52	-	4,049.24	-
301501	恒鑫生活	2025年3月11日	6个月	新股锁定	39.92	45.22	139	5,548.88	6,285.58	-
301501	恒鑫生活	2025年6月6日	1-6个月(含)	新股锁定-送股	-	45.22	63	-	2,848.86	-
301535	浙江华远	2025年3月18日	6个月	新股锁定	4.92	18.99	734	3,611.28	13,938.66	-
301560	众捷汽车	2025年4月17日	6个月	新股锁定	16.50	27.45	190	3,135.00	5,215.50	-
301590	优优绿能	2025年5月28日	6个月	新股锁定	89.60	139.48	51	4,569.60	7,113.48	-
301595	太力科技	2025年5月12日	6个月	新股锁定	17.05	29.10	196	3,341.80	5,703.60	-
301601	惠通科技	2025年1月8日	6个月	新股锁定	11.80	33.85	342	4,035.60	11,576.70	-
301602	超	2025	6个月	新股	6.70	24.80	658	4,408.60	16,318.40	-

	研股份	年1月15日		锁定						
301636	泽润新能	2025年4月30日	6个月	新股锁定	33.06	47.46	128	4,231.68	6,074.88	-
301658	首航新能	2025年3月26日	6个月	新股锁定	11.80	22.98	437	5,156.60	10,042.26	-
301662	宏工科技	2025年4月10日	6个月	新股锁定	26.60	82.50	143	3,803.80	11,797.50	-
301665	泰禾股份	2025年4月2日	6个月	新股锁定	10.27	22.39	393	4,036.11	8,799.27	-
301678	新恒汇	2025年6月13日	6个月	新股锁定	12.80	44.54	328	4,198.40	14,609.12	-
603014	威高血净	2025年5月12日	6个月	新股锁定	26.50	32.68	112	2,968.00	3,660.16	-
603049	中策橡胶	2025年5月27日	6个月	新股锁定	46.50	42.85	99	4,603.50	4,242.15	-
603072	天和磁材	2024年12月24日	6个月	新股锁定	12.30	54.45	189	2,324.70	10,291.05	-
603120	肯特催化	2025年4月9日	6个月	新股锁定	15.00	33.43	65	975.00	2,172.95	-
603124	江南新材	2025年3月12日	6个月	新股锁定	10.54	46.31	88	927.52	4,075.28	-
603202	天有	2025年4月	6个月	新股锁定	93.50	90.66	37	3,459.50	3,354.42	-

	为	16 日								
603210	泰鸿万立	2025 年 4 月 1 日	6 个月	新股锁定	8.60	15.61	286	2,459.60	4,464.46	-
603271	永杰新材	2025 年 3 月 4 日	6 个月	新股锁定	20.60	35.08	102	2,101.20	3,578.16	-
603382	海阳科技	2025 年 6 月 5 日	6 个月	新股锁定	11.50	22.39	105	1,207.50	2,350.95	-
603400	华之杰	2025 年 6 月 12 日	6 个月	新股锁定	19.88	43.81	57	1,133.16	2,497.17	-
603409	汇通控股	2025 年 2 月 25 日	6 个月	新股锁定	24.18	33.32	83	2,006.94	2,765.56	-
688411	海博思创	2025 年 1 月 20 日	6 个月	新股锁定	19.38	83.49	443	8,585.34	36,986.07	-
688545	兴福电子	2025 年 1 月 15 日	6 个月	新股锁定	11.68	26.95	713	8,327.84	19,215.35	-
688583	思看科技	2025 年 1 月 8 日	6 个月	新股锁定	33.46	79.68	175	5,855.50	13,944.00	-
688583	思看科技	2025 年 6 月 19 日	1 个月内(含)	新股锁定-送股	-	79.68	52	-	4,143.36	-
688757	胜科纳米	2025 年 3 月 18 日	6 个月	新股锁定	9.08	25.94	536	4,866.88	13,903.84	-
688758	赛分科技	2025 年 1 月 2 日	6 个月	新股锁定	4.32	16.97	777	3,356.64	13,185.69	-

- 注：1. 根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。
2. 根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于 6 个月的限售期。
3. 基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688313	仕佳光子	2025 年 6 月 30 日	重大事项停牌	38.05	2025 年 7 月 11 日	39.98	400	11,388.00	15,220.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只主动投资的混合型证券投资基金，其长期平均预期风险和预期收益率低于股票型基金，高于债券型基金、货币市场基金。本基金投资的金融工具主要包括股票、债券等。本基

金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，公司内部监督和反馈系统包括内部控制委员会、督察长、合规审计部、风险管理部、各部门负责人和风险控制联络人、各业务岗位。内部控制委员会负责对公司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同责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款均存放于大型股份制商业银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金债券投资的信用评级情况按《中国人

民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	12,612,164.38	11,847,817.48
合计	12,612,164.38	11,847,817.48

注：债券信用评级取自第三方评级机构的债项评级。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
AAA	81,815,269.59	61,753,991.23
AAA 以下	-	1,860,108.86
未评级	-	-
合计	81,815,269.59	63,614,100.09

注：债券信用评级取自第三方评级机构的债项评级。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

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

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理

人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于本报告期末，除附注中列示的卖出回购金融资产款将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合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(净资产)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时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家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；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未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为货币资金、结算备付金、存出保证金、债券投资及买入返售金融资产等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025 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	650,387.69	-	-	-	650,387.69
结算备付金	1,817,793.50	-	-	-	1,817,793.50
存出保证金	9,822.89	-	-	839,592.00	849,414.89
交易性金融资产	12,612,164.38	81,815,269.59	-	124,606,622.89	219,034,056.86
买入返售金融资产	5,986,000.00	-	-	-	5,986,000.00
应收申购款	-	-	-	29,356.56	29,356.56
应收清算款	-	-	-	11,172.68	11,172.68
资产总计	21,076,168.46	81,815,269.59	-	125,486,744.13	228,378,182.18
负债					
应付赎回款	-	-	-	121,811.76	121,811.76
应付管理人报酬	-	-	-	110,459.54	110,459.54
应付托管费	-	-	-	27,614.92	27,614.92
应付清算款	-	-	-	46,349.15	46,349.15
应付销售服务费	-	-	-	46,024.83	46,024.83
应交税费	-	-	-	2.65	2.65

其他负债	-	-	-	153,905.60	153,905.60
负债总计	-	-	-	506,168.45	506,168.45
利率敏感度缺口	21,076,168.46	81,815,269.59	-	124,980,575.68	227,872,013.73
上年度末 2024 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	2,505,487.82	-	-	-	2,505,487.82
结算备付金	2,117,567.79	-	-	-	2,117,567.79
存出保证金	9,340.97	-	-	1,134,374.40	1,143,715.37
交易性金融资产	11,847,817.48	63,614,100.09	-	133,214,367.36	208,676,284.93
买入返售金融资产	10,344,340.25	-	-	-	10,344,340.25
应收申购款	-	-	-	19,963.52	19,963.52
应收清算款	-	-	-	3,551.32	3,551.32
资产总计	26,824,554.31	63,614,100.09	-	134,372,256.60	224,810,911.00
负债					
应付赎回款	-	-	-	87,961.19	87,961.19
应付管理人报酬	-	-	-	112,756.66	112,756.66
应付托管费	-	-	-	28,189.15	28,189.15
应付清算款	-	-	-	698,721.26	698,721.26
应付销售服务费	-	-	-	46,981.96	46,981.96
应交税费	-	-	-	10.22	10.22
其他负债	-	-	-	257,151.49	257,151.49
负债总计	-	-	-	1,231,771.93	1,231,771.93
利率敏感度缺口	26,824,554.31	63,614,100.09	-	133,140,484.67	223,579,139.07

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（2025 年 6 月 30 日）	上年度末（2024 年 12 月 31 日）
	市场利率下降 25 个基点	713,226.41	497,739.66
	市场利率上升 25 个基点	-704,756.85	-492,453.91

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 2025 年 6 月 30 日		上年度末 2024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	124,606,622.89	54.68	133,214,367.36	59.58
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	124,606,622.89	54.68	133,214,367.36	59.58

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（2025 年 6 月 30 日）	上年度末（2024 年 12 月 31 日）
	1. 业绩比较基准上升 5%	11,106,899.95	11,009,897.85
	2. 业绩比较基准下降 5%	-11,106,899.95	-11,009,897.85

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 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	124,228,641.16	134,650,021.77
第二层次	94,458,039.51	73,624,957.31
第三层次	347,376.19	401,305.85
合计	219,034,056.86	208,676,284.93

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	124,606,622.89	54.56
	其中：股票	124,606,622.89	54.56
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	94,427,433.97	41.35
	其中：债券	94,427,433.97	41.35
	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	5,986,000.00	2.62
	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	2,468,181.19	1.08
8	其他各项资产	889,944.13	0.39
9	合计	228,378,182.18	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	573,712.80	0.25
B	采矿业	8,046,907.44	3.53
C	制造业	65,485,007.77	28.74
D	电力、热力、燃气及水生产和供	4,699,601.00	2.06

	应业		
E	建筑业	2,378,172.00	1.04
F	批发和零售业	1,626,199.50	0.71
G	交通运输、仓储和邮政业	4,717,058.00	2.07
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,074,451.00	1.79
J	金融业	30,241,860.84	13.27
K	房地产业	1,006,910.00	0.44
L	租赁和商务服务业	444,676.00	0.20
M	科学研究和技术服务业	404,497.54	0.18
N	水利、环境和公共设施管理业	54,194.00	0.02
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	42,407.00	0.02
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	810,968.00	0.36
S	综合	-	-
	合计	124,606,622.89	54.68

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	300750	宁德时代	20,720	5,225,998.40	2.29
2	600519	贵州茅台	3,600	5,074,272.00	2.23
3	601328	交通银行	487,200	3,897,600.00	1.71
4	601988	中国银行	661,000	3,714,820.00	1.63
5	000858	五粮液	27,200	3,234,080.00	1.42
6	000776	广发证券	181,900	3,057,739.00	1.34
7	002371	北方华创	6,700	2,962,807.00	1.30
8	300059	东方财富	123,968	2,867,379.84	1.26
9	000333	美的集团	38,301	2,765,332.20	1.21
10	600900	长江电力	85,200	2,567,928.00	1.13
11	601288	农业银行	430,900	2,533,692.00	1.11
12	601899	紫金矿业	117,300	2,287,350.00	1.00
13	600919	江苏银行	186,100	2,222,034.00	0.98
14	001965	招商公路	162,966	1,955,592.00	0.86
15	002475	立讯精密	55,899	1,939,136.31	0.85
16	601398	工商银行	253,600	1,924,824.00	0.84
17	688981	中芯国际	20,660	1,821,592.20	0.80
18	600938	中国海油	67,504	1,762,529.44	0.77

19	002594	比亚迪	5,200	1,725,932.00	0.76
20	601318	中国平安	31,100	1,725,428.00	0.76
21	601668	中国建筑	291,100	1,679,647.00	0.74
22	002179	中航光电	40,272	1,625,377.92	0.71
23	000651	格力电器	35,700	1,603,644.00	0.70
24	601319	中国人保	183,300	1,596,543.00	0.70
25	000975	山金国际	79,100	1,498,154.00	0.66
26	000725	京东方 A	305,900	1,220,541.00	0.54
27	601628	中国人寿	28,600	1,178,034.00	0.52
28	600941	中国移动	10,300	1,159,265.00	0.51
29	000429	粤高速 A	86,200	1,149,046.00	0.50
30	002422	科伦药业	30,300	1,088,376.00	0.48
31	600737	中粮糖业	113,000	1,067,850.00	0.47
32	600276	恒瑞医药	20,100	1,043,190.00	0.46
33	002966	苏州银行	111,400	978,092.00	0.43
34	603019	中科曙光	13,500	950,400.00	0.42
35	000938	紫光股份	39,600	950,004.00	0.42
36	600030	中信证券	33,700	930,794.00	0.41
37	000977	浪潮信息	17,200	875,136.00	0.38
38	688012	中微公司	4,800	875,040.00	0.38
39	300308	中际旭创	5,920	863,491.20	0.38
40	300124	汇川技术	13,200	852,324.00	0.37
41	300502	新易盛	6,660	845,953.20	0.37
42	601088	中国神华	20,800	843,232.00	0.37
43	002126	银轮股份	34,200	830,376.00	0.36
44	002895	川恒股份	35,500	800,880.00	0.35
45	688008	澜起科技	9,700	795,400.00	0.35
46	000001	平安银行	62,500	754,375.00	0.33
47	000538	云南白药	13,440	749,817.60	0.33
48	000999	华润三九	23,900	747,592.00	0.33
49	000963	华东医药	17,800	718,408.00	0.32
50	601229	上海银行	65,200	691,772.00	0.30
51	002916	深南电路	6,270	675,968.70	0.30
52	601169	北京银行	97,700	667,291.00	0.29
53	600642	申能股份	76,900	661,340.00	0.29
54	000063	中兴通讯	18,600	604,314.00	0.27
55	000157	中联重科	82,600	597,198.00	0.26
56	000425	徐工机械	76,100	591,297.00	0.26
57	601728	中国电信	74,700	578,925.00	0.25
58	000338	潍柴动力	37,100	570,598.00	0.25
59	600809	山西汾酒	3,200	564,448.00	0.25
60	300274	阳光电源	8,260	559,780.20	0.25
61	002415	海康威视	20,100	557,373.00	0.24

62	600660	福耀玻璃	9,700	552,997.00	0.24
63	688111	金山办公	1,900	532,095.00	0.23
64	600285	羚锐制药	23,400	530,478.00	0.23
65	002821	凯莱英	5,980	527,735.00	0.23
66	601857	中国石油	61,000	521,550.00	0.23
67	002244	滨江集团	51,900	506,025.00	0.22
68	600028	中国石化	88,100	496,884.00	0.22
69	002416	爱施德	41,300	496,426.00	0.22
70	000933	神火股份	29,800	495,872.00	0.22
71	002230	科大讯飞	10,300	493,164.00	0.22
72	603986	兆易创新	3,800	480,814.00	0.21
73	603659	璞泰来	24,600	461,988.00	0.20
74	002540	亚太科技	78,300	456,489.00	0.20
75	600104	上汽集团	27,300	438,165.00	0.19
76	300760	迈瑞医疗	1,900	427,025.00	0.19
77	000513	丽珠集团	11,800	425,272.00	0.19
78	688036	传音控股	5,300	422,410.00	0.19
79	003816	中国广核	115,500	420,420.00	0.18
80	600031	三一重工	22,800	409,260.00	0.18
81	600350	山东高速	37,600	400,816.00	0.18
82	600050	中国联通	74,600	398,364.00	0.17
83	001979	招商蛇口	44,400	389,388.00	0.17
84	600741	华域汽车	20,700	365,355.00	0.16
85	000625	长安汽车	28,500	363,660.00	0.16
86	601658	邮储银行	66,100	361,567.00	0.16
87	688256	寒武纪	600	360,900.00	0.16
88	600025	华能水电	37,500	358,125.00	0.16
89	002533	金杯电工	35,800	348,692.00	0.15
90	000895	双汇发展	14,200	346,622.00	0.15
91	600377	宁沪高速	22,300	342,082.00	0.15
92	600406	国电南瑞	15,200	340,632.00	0.15
93	002050	三花智控	12,800	337,664.00	0.15
94	600012	皖通高速	19,700	334,506.00	0.15
95	000768	中航西飞	12,200	333,548.00	0.15
96	600066	宇通客车	13,300	330,638.00	0.15
97	601225	陕西煤业	17,100	329,004.00	0.14
98	600015	华夏银行	41,300	326,683.00	0.14
99	688120	华海清科	1,900	320,530.00	0.14
100	300014	亿纬锂能	6,900	316,089.00	0.14
101	002233	塔牌集团	42,600	315,240.00	0.14
102	601000	唐山港	76,600	310,996.00	0.14
103	600989	宝丰能源	19,000	306,660.00	0.13
104	300498	温氏股份	17,800	304,024.00	0.13

105	601100	恒立液压	4,200	302,400.00	0.13
106	002043	兔宝宝	30,000	294,000.00	0.13
107	603259	药明康德	4,100	285,155.00	0.13
108	300408	三环集团	8,300	277,220.00	0.12
109	600757	长江传媒	29,800	276,544.00	0.12
110	601012	隆基绿能	18,380	276,067.60	0.12
111	000932	华菱钢铁	61,500	270,600.00	0.12
112	002001	新和成	12,700	270,129.00	0.12
113	002384	东山精密	7,000	264,390.00	0.12
114	601098	中南传媒	19,000	249,280.00	0.11
115	002714	牧原股份	5,900	247,859.00	0.11
116	002003	伟星股份	22,600	246,566.00	0.11
117	600886	国投电力	15,900	234,366.00	0.10
118	600750	江中药业	10,600	231,398.00	0.10
119	601928	凤凰传媒	20,500	228,985.00	0.10
120	600298	安琪酵母	6,500	228,605.00	0.10
121	000568	泸州老窖	2,000	226,800.00	0.10
122	601998	中信银行	26,400	224,400.00	0.10
123	002049	紫光国微	3,320	218,655.20	0.10
124	601126	四方股份	13,400	218,018.00	0.10
125	600901	江苏金租	34,600	209,676.00	0.09
126	000937	冀中能源	33,800	194,350.00	0.09
127	002139	拓邦股份	13,900	191,959.00	0.08
128	002236	大华股份	11,600	184,208.00	0.08
129	002463	沪电股份	4,300	183,094.00	0.08
130	600674	川投能源	11,200	179,648.00	0.08
131	601390	中国中铁	30,900	173,349.00	0.08
132	000166	申万宏源	33,900	170,178.00	0.07
133	601800	中国交建	19,000	168,910.00	0.07
134	600600	青岛啤酒	2,400	166,704.00	0.07
135	002027	分众传媒	22,800	166,440.00	0.07
136	002920	德赛西威	1,600	163,408.00	0.07
137	601186	中国铁建	20,300	162,603.00	0.07
138	601919	中远海控	10,600	159,424.00	0.07
139	600282	南钢股份	36,700	154,140.00	0.07
140	002601	龙佰集团	9,300	150,753.00	0.07
141	002850	科达利	1,300	147,121.00	0.06
142	600027	华电国际	26,700	146,049.00	0.06
143	000902	新洋丰	10,200	141,066.00	0.06
144	688300	联瑞新材	2,860	133,133.00	0.06
145	688041	海光信息	900	127,161.00	0.06
146	000708	中信特钢	9,800	115,248.00	0.05
147	688625	呈和科技	3,660	111,922.80	0.05

148	688396	华润微	2,200	103,752.00	0.05
149	688187	时代电气	2,300	98,095.00	0.04
150	600861	北京人力	3,800	73,340.00	0.03
151	301080	百普赛斯	1,000	71,530.00	0.03
152	688169	石头科技	420	65,751.00	0.03
153	002004	华邦健康	15,500	64,635.00	0.03
154	600662	外服控股	12,600	64,386.00	0.03
155	600739	辽宁成大	5,100	56,100.00	0.02
156	688599	天合光能	3,500	50,855.00	0.02
157	601311	骆驼股份	5,200	46,956.00	0.02
158	002056	横店东磁	3,300	46,695.00	0.02
159	600057	厦门象屿	6,200	43,586.00	0.02
160	600502	安徽建工	9,100	42,770.00	0.02
161	600713	南京医药	8,300	41,998.00	0.02
162	300662	科锐国际	1,400	41,594.00	0.02
163	605123	派克新材	500	38,950.00	0.02
164	600132	重庆啤酒	700	38,570.00	0.02
165	600073	光明肉业	5,200	38,376.00	0.02
166	002080	中材科技	1,900	37,050.00	0.02
167	688411	海博思创	443	36,986.07	0.02
168	603612	索通发展	2,000	36,760.00	0.02
169	002624	完美世界	2,400	36,408.00	0.02
170	688388	嘉元科技	1,800	36,144.00	0.02
171	002996	顺博合金	4,800	35,328.00	0.02
172	300435	中泰股份	2,300	34,914.00	0.02
173	600063	皖维高新	7,500	34,350.00	0.02
174	688696	极米科技	300	34,308.00	0.02
175	002398	垒知集团	6,900	34,086.00	0.01
176	688126	沪硅产业	1,800	33,696.00	0.01
177	600728	佳都科技	6,100	33,245.00	0.01
178	000553	安道麦 A	4,600	33,212.00	0.01
179	002739	万达电影	2,900	33,147.00	0.01
180	001283	豪鹏科技	600	32,670.00	0.01
181	603919	金徽酒	1,800	32,580.00	0.01
182	600675	中华企业	11,300	32,544.00	0.01
183	000100	TCL 科技	7,500	32,475.00	0.01
184	000028	国药一致	1,300	32,409.00	0.01
185	000498	山东路桥	5,500	32,340.00	0.01
186	002345	潮宏基	2,200	32,186.00	0.01
187	600704	物产中大	6,100	32,147.00	0.01
188	600248	陕建股份	8,400	32,004.00	0.01
189	688288	鸿泉物联	1,100	31,911.00	0.01
190	600758	辽宁能源	8,500	31,790.00	0.01

191	002206	海 利 得	6,200	31,682.00	0.01
192	601766	中国中车	4,500	31,680.00	0.01
193	300903	科翔股份	2,700	31,347.00	0.01
194	603444	吉比特	100	30,195.00	0.01
195	688800	瑞可达	600	29,520.00	0.01
196	603063	禾望电气	800	27,088.00	0.01
197	301063	海锅股份	900	26,802.00	0.01
198	603236	移远通信	300	25,740.00	0.01
199	002545	东方铁塔	2,800	24,892.00	0.01
200	000823	超声电子	2,100	24,885.00	0.01
201	688301	奕瑞科技	280	24,530.80	0.01
202	002352	顺丰控股	500	24,380.00	0.01
203	688401	路维光电	700	24,290.00	0.01
204	600531	豫光金铅	3,100	23,994.00	0.01
205	688022	瀚川智能	1,600	23,712.00	0.01
206	688458	美芯晟	500	23,580.00	0.01
207	600961	株冶集团	2,100	23,478.00	0.01
208	002956	西麦食品	1,000	23,470.00	0.01
209	603486	科沃斯	400	23,292.00	0.01
210	600486	扬农化工	400	23,200.00	0.01
211	301458	钧崴电子	680	23,194.80	0.01
212	600482	中国动力	1,000	23,070.00	0.01
213	300596	利安隆	800	23,016.00	0.01
214	600262	北方股份	1,000	22,800.00	0.01
215	001914	招商积余	1,800	22,266.00	0.01
216	300363	博腾股份	1,300	22,204.00	0.01
217	600908	无锡银行	3,500	22,085.00	0.01
218	002936	郑州银行	10,700	22,042.00	0.01
219	002011	盾安环境	1,900	22,040.00	0.01
220	002958	青农商行	6,100	22,021.00	0.01
221	600273	嘉化能源	2,600	21,996.00	0.01
222	603368	柳药集团	1,300	21,983.00	0.01
223	601898	中煤能源	2,000	21,880.00	0.01
224	601997	贵阳银行	3,500	21,840.00	0.01
225	300206	理邦仪器	1,800	21,636.00	0.01
226	600582	天地科技	3,600	21,564.00	0.01
227	601117	中国化学	2,800	21,476.00	0.01
228	000950	重药控股	4,300	21,457.00	0.01
229	603588	高能环境	3,800	21,432.00	0.01
230	000600	建投能源	3,100	21,421.00	0.01
231	600348	华阳股份	3,200	21,312.00	0.01
232	600420	国药现代	2,000	21,300.00	0.01
233	002597	金禾实业	900	21,195.00	0.01

234	601678	滨化股份	5,100	21,114.00	0.01
235	600998	九州通	4,100	21,074.00	0.01
236	002479	富春环保	4,200	21,042.00	0.01
237	002353	杰瑞股份	600	21,000.00	0.01
238	300628	亿联网络	600	20,856.00	0.01
239	000876	新希望	2,200	20,636.00	0.01
240	600755	厦门国贸	3,400	20,570.00	0.01
241	000672	上峰水泥	2,600	20,540.00	0.01
242	603816	顾家家居	800	20,416.00	0.01
243	601665	齐鲁银行	3,200	20,224.00	0.01
244	000528	柳工	2,100	20,181.00	0.01
245	603565	中谷物流	2,100	20,055.00	0.01
246	600866	星湖科技	2,900	20,039.00	0.01
247	603233	大参林	1,200	19,560.00	0.01
248	688545	兴福电子	713	19,215.35	0.01
249	688686	奥普特	200	19,124.00	0.01
250	000526	学大教育	400	19,100.00	0.01
251	688583	思看科技	227	18,087.36	0.01
252	300972	万辰集团	100	18,024.00	0.01
253	301319	唯特偶	500	18,000.00	0.01
254	688368	晶丰明源	200	17,566.00	0.01
255	301602	超研股份	658	16,318.40	0.01
256	688661	和林微纳	390	15,510.30	0.01
257	001388	信通电子	937	15,385.54	0.01
258	605058	澳弘电子	500	15,280.00	0.01
259	688313	仕佳光子	400	15,220.00	0.01
260	688636	智明达	447	15,104.13	0.01
261	301678	新恒汇	328	14,609.12	0.01
262	300767	震安科技	1,100	14,333.00	0.01
263	688518	联赢激光	700	14,273.00	0.01
264	301479	弘景光电	182	14,172.34	0.01
265	000915	华特达因	400	14,140.00	0.01
266	300037	新宙邦	400	14,080.00	0.01
267	301535	浙江华远	734	13,938.66	0.01
268	688757	胜科纳米	536	13,903.84	0.01
269	300483	首华燃气	1,200	13,776.00	0.01
270	688208	道通科技	447	13,678.20	0.01
271	002683	广东宏大	400	13,576.00	0.01
272	300035	中科电气	800	13,504.00	0.01
273	002396	星网锐捷	600	13,470.00	0.01
274	600714	金瑞矿业	1,100	13,453.00	0.01
275	688519	南亚新材	300	13,440.00	0.01
276	301040	中环海陆	500	13,255.00	0.01

277	688693	锆威特	400	13,204.00	0.01
278	688758	赛分科技	777	13,185.69	0.01
279	688435	英方软件	400	13,176.00	0.01
280	002246	北化股份	900	13,158.00	0.01
281	688059	华锐精密	280	13,092.80	0.01
282	000737	北方铜业	1,200	13,032.00	0.01
283	688726	拉普拉斯	300	12,930.00	0.01
284	688311	盟升电子	300	12,915.00	0.01
285	603867	新化股份	500	12,790.00	0.01
286	301328	维峰电子	300	12,645.00	0.01
287	688181	八亿时空	400	12,448.00	0.01
288	600458	时代新材	900	12,348.00	0.01
289	002636	金安国纪	1,300	12,324.00	0.01
290	601198	东兴证券	1,100	12,265.00	0.01
291	002539	云图控股	1,300	12,194.00	0.01
291	601888	中国中免	200	12,194.00	0.01
292	688252	天德钰	500	12,190.00	0.01
293	300162	雷曼光电	1,600	12,160.00	0.01
294	300560	中富通	900	12,159.00	0.01
295	300332	天壕能源	2,400	12,144.00	0.01
296	300138	晨光生物	1,000	12,120.00	0.01
297	300731	科创新源	400	12,068.00	0.01
298	002905	金逸影视	1,300	12,064.00	0.01
299	002150	通润装备	1,000	11,990.00	0.01
300	600858	银座股份	2,000	11,980.00	0.01
301	603527	众源新材	1,100	11,957.00	0.01
302	000792	盐湖股份	700	11,956.00	0.01
303	600729	重庆百货	400	11,932.00	0.01
304	300556	丝路视觉	600	11,922.00	0.01
305	002386	天原股份	2,400	11,904.00	0.01
306	002701	奥瑞金	2,000	11,900.00	0.01
307	300739	明阳电路	800	11,872.00	0.01
308	300616	尚品宅配	900	11,853.00	0.01
309	603613	国联股份	500	11,845.00	0.01
310	301662	宏工科技	143	11,797.50	0.01
311	002486	嘉麟杰	4,500	11,790.00	0.01
312	300279	和晶科技	1,700	11,781.00	0.01
313	605168	三人行	400	11,772.00	0.01
314	000970	中科三环	1,000	11,770.00	0.01
315	600976	健民集团	300	11,763.00	0.01
316	002550	千红制药	1,400	11,760.00	0.01
317	603197	保隆科技	300	11,721.00	0.01
318	600661	昂立教育	1,100	11,715.00	0.01

319	000803	山高环能	1,900	11,704.00	0.01
319	603600	永艺股份	1,100	11,704.00	0.01
320	002782	可立克	900	11,682.00	0.01
321	002430	杭氧股份	600	11,652.00	0.01
322	002659	凯文教育	2,300	11,592.00	0.01
323	300232	洲明科技	1,600	11,584.00	0.01
324	002706	良信股份	1,300	11,583.00	0.01
325	300389	艾比森	1,000	11,580.00	0.01
326	301601	惠通科技	342	11,576.70	0.01
327	301275	汉朔科技	206	11,575.14	0.01
328	600618	氯碱化工	1,200	11,556.00	0.01
329	600159	大龙地产	4,200	11,550.00	0.01
330	300214	日科化学	1,700	11,543.00	0.01
331	000983	山西焦煤	1,800	11,520.00	0.01
332	002442	龙星科技	1,800	11,484.00	0.01
333	300763	锦浪科技	200	11,478.00	0.01
334	605599	菜百股份	700	11,445.00	0.01
335	688690	纳微科技	500	11,415.00	0.01
336	600928	西安银行	2,900	11,368.00	0.00
337	000404	长虹华意	1,600	11,360.00	0.00
338	600266	城建发展	2,500	11,350.00	0.00
339	301161	唯万密封	500	11,345.00	0.00
340	002314	南山控股	4,300	11,309.00	0.00
341	002209	达意隆	900	11,295.00	0.00
342	002663	普邦股份	6,100	11,285.00	0.00
343	000402	金融街	4,000	11,280.00	0.00
344	600337	美克家居	5,100	11,271.00	0.00
345	000905	厦门港务	1,400	11,270.00	0.00
346	002946	新乳业	600	11,262.00	0.00
347	603357	设计总院	1,300	11,258.00	0.00
348	001227	兰州银行	4,500	11,250.00	0.00
348	002839	张家港行	2,500	11,250.00	0.00
349	300160	秀强股份	2,000	11,240.00	0.00
350	002420	毅昌科技	1,800	11,232.00	0.00
351	600517	国网英大	2,200	11,220.00	0.00
352	002666	德联集团	2,200	11,198.00	0.00
352	600510	黑牡丹	2,200	11,198.00	0.00
353	605166	聚合顺	1,000	11,190.00	0.00
354	002249	大洋电机	1,700	11,186.00	0.00
355	002999	天禾股份	1,600	11,168.00	0.00
356	688508	芯朋微	200	11,164.00	0.00
357	605009	豪悦护理	280	11,138.40	0.00
358	002062	宏润建设	2,300	11,132.00	0.00

359	605080	浙江自然	400	11,120.00	0.00
360	002083	孚日股份	2,300	11,109.00	0.00
361	603799	华友钴业	300	11,106.00	0.00
362	600267	海正药业	1,200	11,100.00	0.00
362	601860	紫金银行	3,700	11,100.00	0.00
363	301126	达嘉维康	1,000	11,090.00	0.00
364	603458	勘设股份	1,400	11,074.00	0.00
365	002247	聚力文化	4,100	11,070.00	0.00
366	002284	亚太股份	1,000	11,050.00	0.00
367	601618	中国中冶	3,700	11,026.00	0.00
368	300639	凯普生物	1,900	11,020.00	0.00
369	002661	克明食品	1,100	11,011.00	0.00
370	603312	西典新能	300	11,001.00	0.00
371	002982	湘佳股份	720	10,972.80	0.00
372	300664	鹏鹞环保	2,000	10,960.00	0.00
373	002948	青岛银行	2,200	10,956.00	0.00
374	601900	南方传媒	700	10,948.00	0.00
375	600597	光明乳业	1,300	10,933.00	0.00
376	000935	四川双马	600	10,932.00	0.00
377	688173	希荻微	800	10,928.00	0.00
378	002091	江苏国泰	1,500	10,905.00	0.00
379	600697	欧亚集团	900	10,890.00	0.00
380	000860	顺鑫农业	700	10,885.00	0.00
381	600496	精工钢构	3,400	10,880.00	0.00
382	601963	重庆银行	1,000	10,860.00	0.00
383	600467	好当家	4,700	10,857.00	0.00
384	603489	八方股份	400	10,856.00	0.00
385	000927	中国铁物	4,200	10,794.00	0.00
386	603989	艾华集团	700	10,780.00	0.00
387	601991	大唐发电	3,400	10,778.00	0.00
388	002668	TCL 智家	1,100	10,747.00	0.00
389	300850	新强联	300	10,746.00	0.00
390	002283	天润工业	1,800	10,728.00	0.00
391	002035	华帝股份	1,700	10,693.00	0.00
392	600873	梅花生物	1,000	10,690.00	0.00
393	300482	万孚生物	500	10,675.00	0.00
394	600491	龙元建设	2,900	10,672.00	0.00
395	300621	维业股份	1,200	10,668.00	0.00
396	601113	华鼎股份	2,700	10,665.00	0.00
397	002489	浙江永强	2,900	10,614.00	0.00
398	600483	福能股份	1,100	10,604.00	0.00
399	601233	桐昆股份	1,000	10,600.00	0.00
400	000767	晋控电力	3,700	10,582.00	0.00

401	600166	福田汽车	3,900	10,569.00	0.00
402	600017	日照港	3,400	10,540.00	0.00
403	300247	融捷健康	2,700	10,530.00	0.00
404	601636	旗滨集团	2,100	10,521.00	0.00
405	600105	永鼎股份	1,300	10,517.00	0.00
406	002852	道道全	1,100	10,516.00	0.00
407	601009	南京银行	900	10,458.00	0.00
408	601038	一拖股份	800	10,456.00	0.00
409	600197	伊力特	700	10,444.00	0.00
410	603363	傲农生物	2,900	10,440.00	0.00
411	000521	长虹美菱	1,500	10,410.00	0.00
412	600216	浙江医药	700	10,353.00	0.00
413	688155	先惠技术	200	10,324.00	0.00
414	603206	嘉环科技	600	10,308.00	0.00
415	600664	哈药股份	2,800	10,304.00	0.00
416	603072	天和磁材	189	10,291.05	0.00
417	002081	金螳螂	3,000	10,290.00	0.00
418	600702	舍得酒业	200	10,280.00	0.00
419	603270	金帝股份	400	10,276.00	0.00
420	300577	开润股份	500	10,245.00	0.00
421	600163	中闽能源	2,000	10,240.00	0.00
422	603766	隆鑫通用	800	10,208.00	0.00
423	600694	大商股份	550	10,202.50	0.00
424	002110	三钢闽光	2,900	10,179.00	0.00
425	002616	长青集团	1,700	10,098.00	0.00
426	300986	志特新材	800	10,080.00	0.00
427	301658	首航新能	437	10,042.26	0.00
428	603237	五芳斋	600	10,026.00	0.00
429	301486	致尚科技	145	10,015.15	0.00
430	300026	红日药业	2,700	9,963.00	0.00
431	002258	利尔化学	900	9,936.00	0.00
432	605507	国邦医药	500	9,885.00	0.00
433	301260	格力博	500	9,860.00	0.00
434	603939	益丰药房	400	9,788.00	0.00
435	002906	华阳集团	300	9,753.00	0.00
436	001301	尚太科技	200	9,752.00	0.00
437	002468	申通快递	900	9,621.00	0.00
438	301501	恒鑫生活	202	9,134.44	0.00
439	001356	富岭股份	613	8,851.72	0.00
440	301665	泰禾股份	393	8,799.27	0.00
441	688550	瑞联新材	200	8,602.00	0.00
442	300672	国科微	100	8,492.00	0.00
443	300932	三友联众	700	8,015.00	0.00

444	301031	中熔电气	100	7,965.00	0.00
445	301173	毓恬冠佳	173	7,781.54	0.00
446	001382	新亚电缆	366	7,396.86	0.00
447	301590	优优绿能	51	7,113.48	0.00
448	301636	泽润新能	128	6,074.88	0.00
449	301595	太力科技	196	5,703.60	0.00
450	301525	儒竞科技	69	5,328.87	0.00
451	301560	众捷汽车	190	5,215.50	0.00
452	603210	泰鸿万立	286	4,464.46	0.00
453	603049	中策橡胶	99	4,242.15	0.00
454	603124	江南新材	88	4,075.28	0.00
455	001395	亚联机械	80	3,780.00	0.00
456	603014	威高血净	112	3,660.16	0.00
457	603271	永杰新材	102	3,578.16	0.00
458	603202	天有为	37	3,354.42	0.00
459	001390	古麒绒材	178	3,225.36	0.00
460	603409	汇通控股	83	2,765.56	0.00
461	603400	华之杰	57	2,497.17	0.00
462	301165	锐捷网络	40	2,458.40	0.00
463	603382	海阳科技	105	2,350.95	0.00
464	001335	信凯科技	80	2,244.00	0.00
465	603120	肯特催化	65	2,172.95	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	002179	中航光电	1,442,505.00	0.65
2	002895	川恒股份	855,627.00	0.38
3	000776	广发证券	780,133.00	0.35
4	002416	爱施德	617,695.00	0.28
5	000429	粤高速 A	559,638.00	0.25
6	002966	苏州银行	494,669.00	0.22
7	603986	兆易创新	468,019.00	0.21
8	000975	山金国际	427,610.00	0.19
9	603659	璞泰来	421,713.00	0.19
10	600900	长江电力	420,474.00	0.19
11	000768	中航西飞	358,149.00	0.16
12	600012	皖通高速	356,342.00	0.16
13	601211	国泰海通	354,768.96	0.16
14	600377	宁沪高速	353,331.00	0.16
15	688111	金山办公	335,469.40	0.15
16	002916	深南电路	334,007.00	0.15
17	002233	塔牌集团	316,841.00	0.14

18	688008	澜起科技	302,564.48	0.14
19	601100	恒立液压	296,077.00	0.13
20	600642	申能股份	295,709.00	0.13

注：买入金额不包括相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601211	国泰海通	1,799,868.12	0.81
2	600519	贵州茅台	903,401.00	0.40
3	001965	招商公路	862,082.00	0.39
4	600150	中国船舶	766,775.00	0.34
5	600760	中航沈飞	735,787.00	0.33
6	600312	平高电气	734,696.00	0.33
7	688981	中芯国际	711,113.47	0.32
8	600309	万华化学	648,804.00	0.29
9	002648	卫星化学	643,112.00	0.29
10	601766	中国中车	585,774.00	0.26
11	300750	宁德时代	576,687.00	0.26
12	000830	鲁西化工	432,332.00	0.19
13	601006	大秦铁路	394,266.00	0.18
14	600276	恒瑞医药	375,007.60	0.17
15	601168	西部矿业	374,868.00	0.17
16	600183	生益科技	373,135.00	0.17
17	601328	交通银行	370,442.00	0.17
18	601985	中国核电	370,254.00	0.17
19	601988	中国银行	369,828.00	0.17
20	000858	五 粮 液	364,391.00	0.16

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	27,968,232.85
卖出股票收入（成交）总额	37,443,882.26

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	12,612,164.38	5.53
2	央行票据	-	-
3	金融债券	81,815,269.59	35.90
	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）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	94,427,433.97	41.44

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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	019758	24 国债 21	125,000	12,612,164.38	5.53
2	092280065	22 工行二级资本债 03A	100,000	10,512,180.27	4.61
3	092280108	22 中行二级资本债 02A	100,000	10,477,155.62	4.60
4	242400018	24 北京农商行永续债 01	100,000	10,271,413.70	4.51
5	212480021	24 浙商银行债 01	100,000	10,217,961.64	4.48

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金未投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

华宝新飞跃混合截止 2025 年 06 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中,中国邮政储蓄银行股份有限公司因未按照规定进行国际收支统计申报;于 2024 年 12 月 02 日收到国家外汇管理局北京市分局警告,罚款的处罚措施。

华宝新飞跃混合截止 2025 年 06 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中,中国农业银行股份有限公司因:1.违反账户管理规定;2.违反清算管理规定;3.违反特约商户实名制管理规定;4.违反反假货币业务管理规定;5.违反人民币流通管理规定;6.违反国库科目设置和使用规定;7.占压财政存款或者资金;8.违反信用信息采集、提供、查询及相关管理规定;9.未按规定履行客户身份识别义务;10.未按规定保存客户身份资料和交易记录;11.未按规定报送大额交易报告或者可疑交易报告;12.与身份不明的客户进行交易;于 2024 年 12 月 30 日收到中国人民银行警告,没收违法所得 487.594705 万元,罚款 4672.941544 万元的处罚措施。

华宝新飞跃混合截止 2025 年 06 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中,北京农村商业银行股份有限公司因:1.提供虚假的或者隐瞒重要事实的统计资料;2.违反账户管理规定;3.违反收单业务外包管理规定;4.违反清算管理规定;5.违反代收业务管理规定;6.违反反假货币业务管理规定;7.占压财政存款或者资金;8.违反信用信息采集、提供、查询及相关管理规定;9.未按照规定履行客户身份识别义务;10.与身份不明的客户进行交易或者为客户开立匿名账户、假名账户。于 2025 年 01 月 10 日收到中国人民银行北京市分行警告,罚款,没收违法所得的处罚措施。

华宝新飞跃混合截止 2025 年 06 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中,北京农村商业银行股份有限公司因 1.提供虚假的或者隐瞒重要事实的统计资料;2.违反账户管理规定;3.违反收单业务外包管理规定;4.违反清算管理规定;5.违反代收业务管理规定;6.违反反假货币业务管理规定;7.占压财政存款或者资金;8.违反信用信息采集、提供、查询及相关管理规定;9.未按照规定履行客户身份识别义务;10.与身份不明的客户进行交易或者为客户开立匿名账户、假名账户。于 2025 年 01 月 10 日收到中国人民银行北京市分行警告,罚款,没收违法所得的处罚措施。

华宝新飞跃混合截止 2025 年 06 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中, 中国民生银行股份有限公司因违反国库管理规定, 违反征信管理规定, 违反清算管理规定, 违反支付结算管理规定, 违反账户管理规定, 未依法履行其他职责; 于 2025 年 01 月 27 日收到中国人民银行警告, 罚款, 没收违法所得的处罚措施。

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

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	849,414.89
2	应收清算款	11,172.68
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	29,356.56
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	889,944.13

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因, 合计数可能不等于分项之和。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
2,119	50,642.73	102,381,620.36	95.41	4,930,326.06	4.59

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	4,489.23	0.0042

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	0~10
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	106,397,581.97
本报告期基金总申购份额	10,301,199.44
减：本报告期基金总赎回份额	9,386,834.99
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	107,311,946.42

§ 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

2025 年 1 月 9 日，基金管理人发布高级管理人员变更公告，聘任吕笑然为公司副总经理。

2025 年 6 月 27 日，基金管理人发布高级管理人员变更公告，吕笑然不再担任公司副总经理。

中国建设银行股份有限公司（以下简称“中国建设银行”）研究决定，聘任陈颖钰为中国

建设银行资产托管业务部总经理。陈颖钰女士曾先后在中国建设银行财务会计、重组改制、资产负债、同业业务、金融科技等领域工作，并在中国建设银行总行同业业务中心、财务会计部、资产托管业务部以及山东省分行、建信金融科技有限责任公司等机构担任领导职务，具有丰富的财会、科技和资金资产管理经验。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产和基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未发生变更。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

目前该会计师事务所向本基金提供的审计服务持续期限为：自 2019 年 11 月 20 日起至本报告期末。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚的情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

无

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
国盛证券	2	15,472,560.06	24.43	6,745.53	24.44	—
中信建投	2	13,513,096.22	21.34	5,890.34	21.34	—
东吴证券	2	7,474,796.06	11.80	3,258.35	11.80	—
国联民生	3	7,103,910.24	11.22	3,097.25	11.22	—
方正证券	3	4,526,301.04	7.15	1,972.97	7.15	—
东北证券	2	4,463,709.88	7.05	1,945.40	7.05	—
中邮证券	1	3,856,879.80	6.09	1,681.29	6.09	—
华安证券	2	3,833,017.38	6.05	1,670.77	6.05	—
西部证券	2	2,530,696.11	4.00	1,103.33	4.00	—

兴业证券	2	393,571.20	0.62	171.56	0.62	—
国信证券	1	84,098.86	0.13	36.67	0.13	—
中金国际	1	59,564.95	0.09	25.96	0.09	—
浙商证券	2	11,036.87	0.02	4.81	0.02	—
爱建证券	1	—	—	—	—	—
长江证券	1	—	—	—	—	—
德邦证券	2	—	—	—	—	—
东方财富	1	—	—	—	—	—
东方证券	1	—	—	—	—	—
东海证券	1	—	—	—	—	—
东兴证券	1	—	—	—	—	—
国融证券	1	—	—	—	—	—
国泰海通	5	—	—	—	—	—
华创证券	1	—	—	—	—	—
华泰证券	1	—	—	—	—	—
华西证券	1	—	—	—	—	—
华源证券	1	—	—	—	—	—
联储证券	2	—	—	—	—	—
麦高证券	1	—	—	—	—	—
平安证券	1	—	—	—	—	—
上海证券	1	—	—	—	—	—
申万宏源	1	—	—	—	—	—
万联证券	1	—	—	—	—	—
信达证券	1	—	—	—	—	—
银河证券	1	—	—	—	—	—
招商证券	1	—	—	—	—	—
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：根据证监会《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》和公司《公募基金及私募资产管理计划专用交易席位管理办法》的要求，公司与符合前述标准的证券公司，签订《证券交易单元租用协议》，参与证券交易。

2、本报告期租用的证券公司交易单元新增的有：爱建证券、东海证券、东兴证券、华西证券、华源证券、联储证券；退租交易单元：方正证券。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
国盛证券	559,509.44	1.43	-	-	-	-
中信建投	23,448,486.46	59.78	121,189,000.00	16.56	-	-
东吴证券	7,373,835.68	18.80	116,024,000.00	15.85	-	-
国联民生	873,200.00	2.23	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	93,451,000.00	12.77	-	-
中邮证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	75,870,000.00	10.36	-	-
西部证券	-	-	122,186,000.00	16.69	-	-
兴业证券	6,289,557.17	16.03	111,837,000.00	15.28	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
中金国际	679,924.88	1.73	74,992,000.00	10.24	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
爱建证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	16,478,000.00	2.25	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
国融证券	-	-	-	-	-	-
国泰海通	-	-	-	-	-	-

华创证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
华源证券	-	-	-	-	-	-
联储证券	-	-	-	-	-	-
麦高证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
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华宝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	2025-01-14
2	华宝新飞跃灵活配置混合型证券投资基金 2024 年第 4 季度报告	基金管理人网站	2025-01-22
3	华宝新飞跃灵活配置混合型证券投资基金 2024 年年度报告	基金管理人网站	2025-03-31
4	华宝基金关于旗下部分基金新增中国邮政储蓄银行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	2025-04-18
5	华宝基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法调整的公告	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	2025-04-22
6	华宝新飞跃灵活配置混合型证券投资基金 2025 年第 1 季度报告	基金管理人网站	2025-04-22
7	华宝基金管理有限公司旗下部分基金季度报告提示性公告	上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2025-04-22
8	华宝新飞跃灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要（更新）	基金管理人网站	2025-06-13
9	华宝新飞跃灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）	基金管理人网站	2025-06-13

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比（%）
机构	1	20250101~20250630	94,603,500.00	0.00	0.00	94,603,500.00	88.16
产品特有风险							
报告期内本基金出现单一投资者持有基金份额比例超过 20%的情况。 在单一投资者持有基金份额比例较高的情况下，如该投资者集中赎回，可能会增加基金的流动性风险。此外，由于基金在遇到大额赎回的时候可能需要变现部分资产，可能对持有资产的价格形成冲击，增加基金的市场风险。基金管理人将专业审慎、勤勉尽责地运作基金资产，加强防范流动性风险、市场风险，保护持有人利益。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

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

2025 年 8 月 29 日