

新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金 2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：新沃基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：二〇二四年八月二十九日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 8 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§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	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	13
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表.....	15
6.2 利润表.....	16
6.3 净资产变动表.....	17

6.4 报表附注.....	19
§7 投资组合报告.....	40
7.1 期末基金资产组合情况.....	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	40
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.....	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	42
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	45
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.....	45
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.....	45
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.....	45
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.....	45
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	45
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	45
7.12 投资组合报告附注.....	45
§8 基金份额持有人信息.....	48
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	48
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	48
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	48
§9 开放式基金份额变动.....	49
§10 重大事件揭示.....	50
10.1 基金份额持有人大会决议.....	50
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.....	50
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	50
10.4 基金投资策略的改变.....	50
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	50
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.....	50
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	50
10.8 其他重大事件.....	51
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	53
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.....	53

11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	53
§12 备查文件目录.....	54
12.1 备查文件目录.....	54
12.2 存放地点.....	54
12.3 查阅方式.....	54

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	新沃通盈灵活配置混合
基金主代码	002564
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 9 月 22 日
基金管理人	新沃基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	6,037,256.32 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金以风险管理为前提，通过把握中国稳增长与促转型的发展现状，灵活运用多种投资策略，挖掘各大类资产配置机会，力求高于业绩比较基准的长期资产增值。
投资策略	本基金在深度把握中国经济发展与转型的基础上，通过自上而下的宏观-中观-微观的资产配置策略，以及自下而上的精选行业、个股的基本面分析策略，再通过定性分析和定量分析相结合的选股方法，辅以多种事件驱动、量化研究等工具策略，在风险管理的前提下因势利导运用多样化的投资策略实现基金资产长期增值。
业绩比较基准	65%×沪深 300 指数收益率+35%×中证全债指数收益率
风险收益特征	本基金为混合型基金，属于较高风险、较高收益的投资品种，其预期风险和预期收益低于股票型基金，但高于债券型基金和货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		新沃基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	王靖飞	郭明
	联系电话	400-698-9988	010-66105799
	电子邮箱	service@sinvofund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-698-9988	95588
传真		010-58290555	010-66105798
注册地址		山东省青岛市崂山区苗岭路 15 号青岛金融中心大厦	北京市西城区复兴门内大街 55 号

	702 室	
办公地址	北京市朝阳区安贞西里五区 1 号楼新华金融大厦 5 层 519 室	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码	100029	100140
法定代表人	朱灿	陈四清

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	新沃基金管理有限公司	北京市朝阳区安贞西里五区 1 号楼新华金融大厦 5 层 519 室

§ 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	-793,227.77
本期利润	-198,149.45
加权平均基金份额本期利润	-0.0323
本期加权平均净值利润率	-2.77%
本期基金份额净值增长率	-2.72%
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	325,248.58
期末可供分配基金份额利润	0.0539
期末基金资产净值	6,919,571.70
期末基金份额净值	1.146
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	54.63%

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

2、本报告所列示的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、期末可供分配利润，为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

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

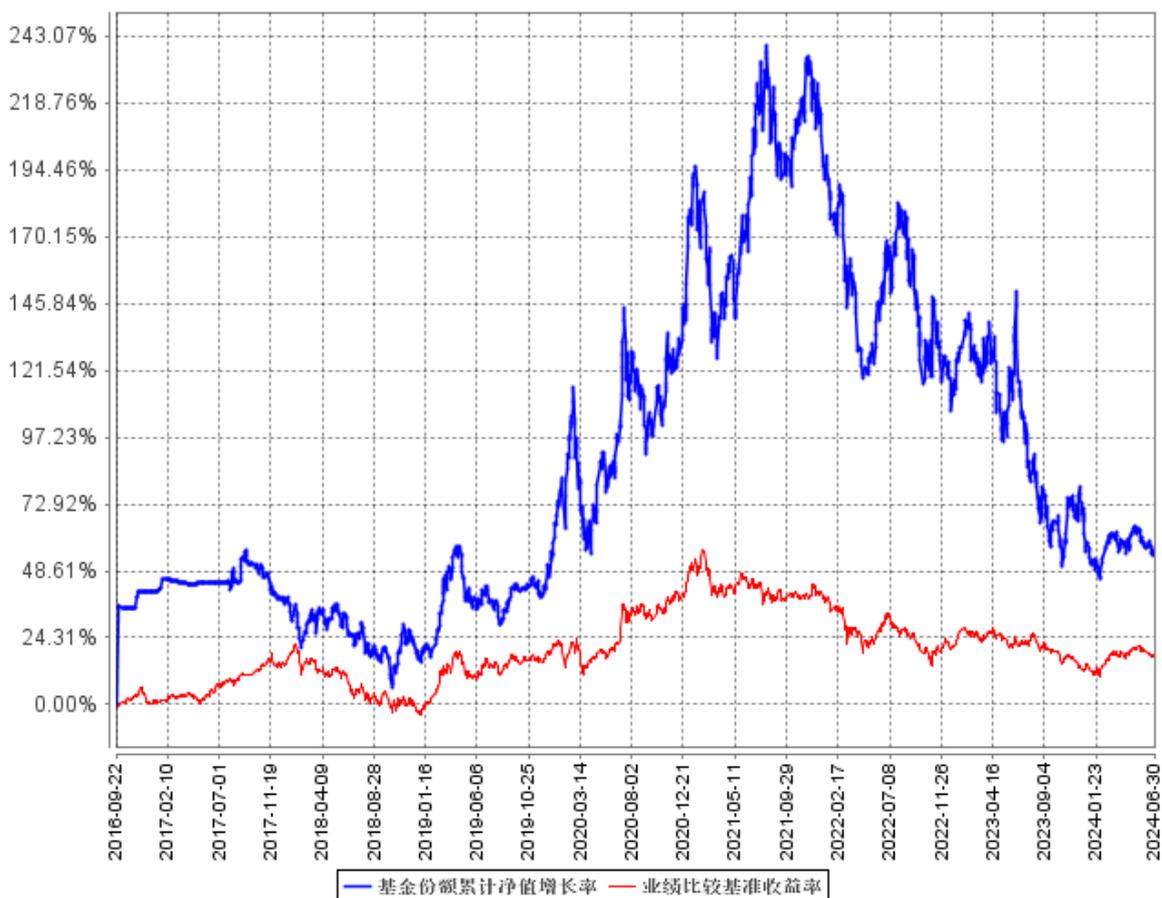
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-2.72%	0.60%	-1.57%	0.28%	-1.15%	0.32%
过去三个月	-2.05%	0.89%	-0.50%	0.44%	-1.55%	0.45%
过去六个月	-2.72%	0.92%	2.27%	0.52%	-4.99%	0.40%
过去一年	-27.70%	1.47%	-3.75%	0.52%	-23.95%	0.95%
过去三年	-49.91%	1.71%	-19.21%	0.67%	-30.70%	1.04%
自基金合同生效起至今	54.63%	1.78%	17.41%	0.76%	37.22%	1.02%

注：本着公允性原则、可复制性原则和再平衡等原则，本基金选取“65%×沪深 300 指数收益率

+35%×中证全债指数收益率”作为本基金的比较基准。

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

基金份额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



§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

新沃基金管理有限公司成立于 2015 年 8 月，是一家经中国证监会核准设立的全国性基金管理公司，经营范围包括公募基金管理业务、证券投资基金销售服务和中国证监会许可的其他业务。截至 2024 年 6 月 30 日，公司共管理 6 只公募基金，分别是新沃通宝货币市场基金、新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金、新沃通利纯债债券型证券投资基金、新沃创新领航混合型证券投资基金、新沃内需增长混合型证券投资基金、新沃安鑫 87 个月定期开放债券型证券投资基金。

未来，公司将继续秉承“专业创造价值，合作实现价值”的发展理念，坚持“以人为本”的发展战略，坚守“诚信、专业、合作、超越”的价值准则，致力于经过长期努力跻身国内一流基金管理公司行列，力求为广大投资者提供稳定的投资回报。

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		
刘腾飞	本基金的基金经理	2023 年 12 月 20 日	-	5 年	重庆大学金融学硕士，中国籍。2016 年 7 月起在新沃控股集团有限公司投资管理部担任投资经理。2018 年 9 月加入新沃基金管理有限公司，历任投资研究部研究员、投资经理，现担任基金经理。

注：1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”按基金合同生效日填写，“离职日期”为根据公司决定确定的解聘日期，对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2、证券从业年限计算标准遵从中国证监会《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》中关于证券基金从业人员范围的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期末基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、基金合同和其他有关法律法规，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作整体合法合规，没有损害基金份额持有人利益。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规制定了《新沃基金管理有限公司公平交易管理办法》，在授权管理、研究分析、投资决策、交易执行、行为监控等方面对公平交易制度予以落实，确保各组合享有同等信息知情权、均等交易机会，并保持各组合的独立投资决策权。

本报告期内，公司公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

公司制定了《异常交易监控管理办法》对各类异常交易的情形进行了界定，并制定相应的监控方法与识别、报告、处理程序。

本报告期内，公司对各投资组合的交易行为进行监控和分析，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

本报告期内，未发生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% 的情形。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

从经济运行情况来看，根据国家统计局 7 月 15 日发布的初步核算数据，2024 年上半年我国国内生产总值同比增长 5.0%；分季度看，一季度同比增长 5.3%，二季度同比增长 4.7%，二季度环比增长 0.7%。上半年全国规模以上工业增加值同比增长 6.0%，社会消费品零售总额同比增长 3.7%，全国固定资产投资(不含农户)同比增长 3.9%，扣除房地产开发投资，全国固定资产投资增长 8.5%，货物进出口总额同比增长 6.1%，其中出口增长 6.9%；进口增长 5.2%。6 月制造业采购经理指数为 49.5%，与上月持平，其中高技术制造业采购经理指数为 52.3%，较上月上升 1.6 个百分点，高技术制造业采购经理指数连续 8 个月保持扩张，装备制造业采购经理指数连续 4 个月保持扩张。总体上，报告期内我国经济基本面延续弱修复态势，供给端修复仍然快于需求端。

上半年在国内经济整体复苏偏弱、海外不确定性抬升的背景下，A 股市场总体表现呈现“倒 N 型”走势，可分为三个阶段。阶段一：年初至 2 月初，微观交易转弱影响下，市场逐渐走弱，一度陷入恐慌性下跌。阶段二：2 月初至 5 月底，资金面好转，叠加资本市场及地产政策持续优化，市场震荡上行。阶段三：5 月底至年中，政策效果进入观察期，资金观望氛围浓厚，市场走势震荡。从行业层面来看，上半年显著跑赢大盘的方向主要为以银行、煤炭、有色及电力为代表的红利板块，以及工程机械、白电、摩托、电力设备等为代表的出海分支，此外，以 AI 为代表的高新技术产业周期受到市场重点关注。

报告期内，本基金在深入分析宏观经济和产业演进趋势的基础上，通过主观研究叠加量化分析的研究方法，制定了控制风险和抓取超额收益相均衡的投资策略，捕捉在当前市场环境下被显著低估的因子，挖掘基本面稳健、具备长期发展潜力的优秀上市公司。当前红利风格仍具备优势，但从中期视角来看，如果经济复苏的方向延续，则市场风格可能在未来某个时期发生切换。因此，在今年下半年，本基金将逐步增加成长标的持仓，适度增加对创业板的风险暴露，同时继续严格控制组合整体风险，在收益与风控之间追求更优的均衡。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.146 元；本报告期基金份额净值增长率为-2.72%，业绩比较基准收益率为 2.27%。

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，预计名义经济增速将持续修复，但修复幅度仍有限。总需求层面，广义财政支出节奏预计加快，外需将持续保持韧性，这是主要的有利因素。国内加快推动大规模设备更新和消费品以旧换新将对总需求带来阶段性支撑；但居民可支配收入增速放缓、物价预期偏弱、消费边际放缓等，显示内生动能可能仍在减速，同时，实际利率依然处于偏高位置，居民及企业融资意愿改善尚需时日。供给层面看，当前产销率、产能利用率处于低位，工业投资呈中高速增长，供给复苏强于需求，库存周期仍然在被动补库阶段磨底。政策层面看，二十届三中全会强调坚定不移实现全年经济社会发展目标，政策有进一步加码空间。下半年随着经济周期及国际形势的演进，叠加政策支持效果的显现，A 股市场有望出现结构性行情，我们重点关注基本面趋势向好的科技创新标的，以及处于周期底部有望实现反转向上的周期性标的。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

(1) 有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历的描述

根据证监会的相关规定，为建立健全有效的估值政策和程序，公司成立估值委员会，明确参与估值流程各方的人员分工和职责，由投资研究部、监察稽核部、基金事务部相关人员担任委员

会委员。估值委员会委员具备应有的经验、专业胜任能力和独立性，分工明确，在上市公司研究和估值、基金投资、投资品种所属行业的专业研究、估值政策、估值流程和程序、基金的风险控制与绩效评估、会计政策与基金核算以及相关事项的合法合规性审核和监督等各个方面具备专业能力和丰富经验。估值委员会严格按照工作流程诚实守信、勤勉尽责地讨论和决策估值事项。日常估值项目由基金事务部严格按照新会计准则、证监会相关规定和基金合同关于估值的约定执行。当经济环境和证券市场发生重大变化时，针对特殊估值工作，按照以下工作流程进行：由公司估值委员会依据行业协会提供的估值模型和行业做法选定与当时市场经济环境相适应的估值方法并征求托管行、会计师事务所的相关意见，由基金事务部做出提示，对其潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响是否在 0.25% 以上进行测算，并对确认产生影响的品种根据前述估值模型、估值流程计算提供相关投资品种的公允价值以进行估值处理，待清算人员复核后，将估值结果反馈基金经理，并提交公司估值委员会。其他特殊情形，可由基金经理主动做出提示，并由研究员提供研究报告，交估值委员会审议，同时按流程对外公布。

(2) 基金经理参与或决定估值的程度

基金经理参与对估值问题的讨论，对估值结果提出反馈意见，但不介入基金日常估值业务。

(3) 本公司参与估值流程各方之间没有存在任何重大利益冲突。

(4) 定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内，本基金未出现连续 20 个工作日基金份额持有人数量不满 200 人的情况；本基金于 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日期间出现连续 60 个工作日基金资产净值低于 5000 万元的情形。根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的有关规定，本基金管理人已向中国证券监督管理委员会报告并提出解决方案，本基金管理人将持续关注本基金资产净值情况，并将严格按照有关法规的要求对本基金进行监控和操作。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金的管理人——新沃基金管理有限公司在新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对新沃基金管理有限公司编制和披露的新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金 2024 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	1,204,209.54	3,441,733.79
结算备付金		1,400.18	3,066.48
存出保证金		3,865.20	756.75
交易性金融资产	6.4.7.2	5,769,963.26	4,357,489.14
其中：股票投资		5,769,963.26	4,357,489.14
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		1,146.28	1,827.55
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		6,980,584.46	7,804,873.71
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		40,428.60	250,752.03

应付赎回款		787.25	3,719.57
应付管理人报酬		3,487.67	4,127.98
应付托管费		871.89	1,032.00
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	15,437.35	29,929.29
负债合计		61,012.76	289,560.87
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	6,037,256.32	6,381,183.99
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	882,315.38	1,134,128.85
净资产合计		6,919,571.70	7,515,312.84
负债和净资产总计		6,980,584.46	7,804,873.71

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.146 元，基金份额总额 6,037,256.32 份。

6.2 利润表

会计主体：新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-157,542.29	116,484.69
1.利息收入		3,374.27	1,822.24
其中：存款利息收入	6.4.7.13	3,275.20	1,822.24
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		99.07	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-757,228.18	-577,396.98
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-813,174.28	-636,467.38
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	55,946.10	59,070.40

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）	6.4.7.20	595,078.32	687,094.51
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	1,233.30	4,964.92
减：二、营业总支出		40,607.16	54,441.33
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	21,347.33	32,445.48
其中：暂估管理人报酬（若有）		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	5,336.83	8,111.34
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
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	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.23	13,923.00	13,884.51
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-198,149.45	62,043.36
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-198,149.45	62,043.36
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-198,149.45	62,043.36

6.3 净资产变动表

会计主体：新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	6,381,183.99	-	1,134,128.85	7,515,312.84
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-

其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	6,381,183.99	-	1,134,128.85	7,515,312.84
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-343,927.67	-	-251,813.47	-595,741.14
(一)、综合收益总额	-	-	-198,149.45	-198,149.45
(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)	-343,927.67	-	-53,664.02	-397,591.69
其中：1.基金申购款	254,701.20	-	43,874.11	298,575.31
2.基金赎回款	-598,628.87	-	-97,538.13	-696,167.00
(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	6,037,256.32	-	882,315.38	6,919,571.70
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	6,607,941.24	-	3,814,239.16	10,422,180.40
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	6,607,941.24	-	3,814,239.16	10,422,180.40

三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	564.58	-	50,701.78	51,266.36
(一)、综合收益总额	-	-	62,043.36	62,043.36
(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)	564.58	-	-11,341.58	-10,777.00
其中: 1.基金申购款	640,245.47	-	413,632.16	1,053,877.63
2.基金赎回款	-639,680.89	-	-424,973.74	-1,064,654.63
(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	6,608,505.82	-	3,864,940.94	10,473,446.76

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:

李钧

李钧

孙娟

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

新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2016]394号《关于准予新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》核准,由新沃基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期

限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 201,825,420.01 元，经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2016)第 1247 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2016 年 9 月 22 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 201,825,782.39 份基金份额，其中认购资金利息折合 362.38 份基金份额。本基金的基金管理人为新沃基金管理有限公司(以下简称“新沃基金”)，基金托管人为中国工商银行股份有限公司(以下简称“中国工商银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，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(包括国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、可转换债券、资产支持证券等)、权证、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金股票资产占基金资产的比例为 0%-95%，持有的权证合计市值占基金资产的比例为 0%-3%；保持现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值 5%。本基金的业绩比较基准为 65%×沪深 300 指数收益率+35%×中证全债指数收益率。

本基金的财务报表于 2024 年 8 月 28 日已经本基金的基金管理人批准报出。

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颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定(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

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，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 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日的经营成果和基金净值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

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

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

本基金本报告期间无重大会计政策变更。

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

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局国家税务总局财税[1998]55号《关于证券投资基金税收问题的通知》、财税[2008]1号《财政部、国家税务总局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号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》、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》、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》、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》、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号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、国发[1985]19号发布和国务院令[2011]第588号修订的《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例》、国务院令[2005]第448号《国务院关于修改〈征收教育费附加的暂行规定〉的决定》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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

2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2)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，暂不缴纳企业所得税。

(3)对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴个人所得税，个人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，暂免征收个人所得税。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

(4)对基金取得的债券利息收入，由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20%的个人所得税，暂不缴纳企业所得税。

(5)基金卖出股票缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(6)基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价，暂免予缴纳印花税、企业所得税和个人所得税。

(7)本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费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	1,204,209.54
等于：本金	1,204,076.84
加：应计利息	132.70
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-

其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	1,204,209.54

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	5,737,169.54	-	5,769,963.26	32,793.72
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	5,737,169.54	-	5,769,963.26	32,793.72

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

无。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

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

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.8 其他资产

无。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

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

应付交易费用	1,514.35
其中：交易所市场	1,514.35
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	13,923.00
合计	15,437.35

6.4.7.10 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	6,381,183.99	6,381,183.99
本期申购	254,701.20	254,701.20
本期赎回(以“-”号填列)	-598,628.87	-598,628.87
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	6,037,256.32	6,037,256.32

注：申购含红利再投、转换入份额（如有），赎回含转换出份额（如有）。

6.4.7.11 其他综合收益

无。

6.4.7.12 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	1,170,788.28	-36,659.43	1,134,128.85
加：会计政策变更 (若有)	-	-	-
前期差错更正 (若有)	-	-	-
其他(若有)	-	-	-
本期期初	1,170,788.28	-36,659.43	1,134,128.85
本期利润	-793,227.77	595,078.32	-198,149.45
本期基金份额交易	-52,311.93	-1,352.09	-53,664.02

产生的变动数			
其中：基金申购款	17,396.33	26,477.78	43,874.11
基金赎回款	-69,708.26	-27,829.87	-97,538.13
本期已分配利润	-	-	-
本期末	325,248.58	557,066.80	882,315.38

6.4.7.13 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	3,058.71
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	193.25
其他	23.24
合计	3,275.20

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 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	12,444,263.41
减：卖出股票成本总额	13,242,489.02
减：交易费用	14,948.67
买卖股票差价收入	-813,174.28

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

无。

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.19 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	55,946.10
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	55,946.10

6.4.7.20 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	595,078.32
——股票投资	595,078.32
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——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	595,078.32

6.4.7.21 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	1,233.30
合计	1,233.30

6.4.7.22 信用减值损失

无。

6.4.7.23 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	13,923.00
信息披露费	-
证券出借违约金	-
其他手续费	-
银行间账户维护费	-
合计	13,923.00

6.4.7.24 分部报告

无。

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

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

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

2024 年 5 月 13 日，本基金管理人发布《新沃基金管理有限公司关于新增注册资本及股东的公告》，根据公司股东会决议，公司进行增资扩股。公司注册资本由人民币 14,000.00 万元增加至人民币 15,596.5342 万元，新增股东青岛金家岭控股集团有限公司、青岛海诺投资发展有限公司分别认缴公司新增注册资本人民币 778.2671 万元。本次股权变更后，公司的股权结构如下：

新沃控股集团有限公司 63.0140%；新沃联合资产管理有限公司 27.0060%；青岛金家岭控股集团有限公司 4.9900%；青岛海诺投资发展有限公司 4.9900%。本次股权变更工商变更登记手续已办理完毕。

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
新沃基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司	基金托管人

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**

无。

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

无。

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	21,347.33	32,445.48
其中：支付销售机构的客户维护费	5,113.15	8,362.35
应支付基金管理人的净管理费	16,234.18	24,083.13

注：①支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.60%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×0.60%/当年天数；

②客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 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托管费	5,336.83	8,111.34

注：支付基金托管人中国工商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

无。

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

无。

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

无。

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

无。

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

份额单位：份

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
基金合同生效日（2016年9月22日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	1,878,908.13	1,878,908.13
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-

报告期末持有的基金份额	1,878,908.13	1,878,908.13
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	31.1219%	28.4317%

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

无。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
	中国工商银行	1,204,209.54	3,058.71	748,530.36

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行股份有限公司保管，按适用利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

无。

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

无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

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

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

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

本基金为混合型基金，具有较高预期风险、较高预期收益的特征，其预期风险和预期收益低于股票型基金、高于债券型基金和货币市场基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资及债券投资等。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。本基金以风险管理为前提，通过把握中国稳增长与促转型的发展现状，灵活运用多种投资策略，挖掘各大类资产配置机会，力求高于业绩比较基准的长期资产增值。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以监察及风险控制委员会为核心的、由督察长、风险管理委员会、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立监察及风险控制委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险管理委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。监察稽核部对公司总经理负责，并由督察长分管。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去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同类风险损失的频度。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特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，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。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国工商银行股份有限公司，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。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

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 2024 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部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，因此账面余额即为未折现的合约到

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

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 6.4.12。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。

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银行存款、结算备付金及存出保证金等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	1,204,209.54	-	-	-	1,204,209.54
结算备付金	1,400.18	-	-	-	1,400.18
存出保证金	3,865.20	-	-	-	3,865.20
交易性金融资产	-	-	-	5,769,963.26	5,769,963.26
应收申购款	-	-	-	1,146.28	1,146.28
资产总计	1,209,474.92	-	-	5,771,109.54	6,980,584.46
负债					
应付清算款	-	-	-	40,428.60	40,428.60
应付赎回款	-	-	-	787.25	787.25
应付管理人报酬	-	-	-	3,487.67	3,487.67
应付托管费	-	-	-	871.89	871.89
其他负债	-	-	-	15,437.35	15,437.35
负债总计	-	-	-	61,012.76	61,012.76
利率敏感度缺口	1,209,474.92	-	-	5,710,096.78	6,919,571.70
上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	3,441,733.79	-	-	-	3,441,733.79
结算备付金	3,066.48	-	-	-	3,066.48
存出保证金	756.75	-	-	-	756.75
交易性金融资产	-	-	-	4,357,489.14	4,357,489.14
应收申购款	-	-	-	1,827.55	1,827.55
资产总计	3,445,557.02	-	-	4,359,316.69	7,804,873.71

负债					
应付清算款	-	-	-	250,752.03	250,752.03
应付赎回款	-	-	-	3,719.57	3,719.57
应付管理人报酬	-	-	-	4,127.98	4,127.98
应付托管费	-	-	-	1,032.00	1,032.00
其他负债	-	-	-	29,929.29	29,929.29
负债总计	-	-	-	289,560.87	289,560.87
利率敏感度缺口	3,445,557.02	-	-	4,069,755.82	7,515,312.84

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

利率风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的情况下，利率发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值可参考的公允价值产生的影响。于 2024 年 6 月 30 日，本基金未持有债券投资或持有的债券投资占比并不重大，因而市场利率的变动对本基金资产净值无重大影响。

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。

本基金在深度把握中国经济发展与转型的基础上，通过自上而下的宏观-中观-微观的资产配置策略，以及自下而上的精选行业、个股的基本面分析策略，再通过定性分析和定量分析相结合的选股方法，辅以多种事件驱动、量化研究等工具策略，在风险管理的前提下因势利导运用多样化的投资策略实现基金资产长期增值。

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资产占基金资产的比例为 0%-95%，权证投资比例不超过基金资产净值的 3%，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。

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	5,769,963.26	83.39	4,357,489.14	57.98
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
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	5,769,963.26	83.39	4,357,489.14	57.98

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数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）
	沪深 300 指数上升 5%	318,111.19	246,921.93
	沪深 300 指数下降 5%	-318,111.19	-246,921.93

注：本基金管理人运用定量分析方法对本基金的市场价格风险进行分析。上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。

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	5,769,963.26	4,357,489.14
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	5,769,963.26	4,357,489.14

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券、基金等投资，若出现交易不活跃（包括重大事项停牌、境内股票涨跌停等导致的交易不活跃）和非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资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，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2024 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产（2023 年 12 月 31 日：无）。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以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

除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	5,769,963.26	82.66
	其中：股票	5,769,963.26	82.66
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	1,205,609.72	17.27
8	其他各项资产	5,011.48	0.07
9	合计	6,980,584.46	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	265,186.00	3.83
C	制造业	3,189,001.26	46.09
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	560,804.00	8.10
E	建筑业	34,515.00	0.50
F	批发和零售业	-	-
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	128,770.00	1.86
J	金融业	1,450,921.00	20.97
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	17,743.00	0.26
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-

0	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	123,023.00	1.78
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	5,769,963.26	83.39

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	占基金资产净值比例（%）
1	601500	通用股份	54,000	288,360.00	4.17
2	601985	中国核电	24,500	261,170.00	3.77
3	000425	徐工机械	35,300	252,395.00	3.65
4	002810	山东赫达	20,700	243,846.00	3.52
5	002351	漫步者	16,900	222,235.00	3.21
6	600030	中信证券	10,200	185,946.00	2.69
7	600584	长电科技	5,800	183,918.00	2.66
8	600999	招商证券	12,500	173,875.00	2.51
9	600160	巨化股份	7,200	173,736.00	2.51
10	601699	潞安环能	8,500	154,105.00	2.23
11	601818	光大银行	46,100	146,137.00	2.11
12	600585	海螺水泥	6,100	143,899.00	2.08
13	600900	长江电力	4,900	141,708.00	2.05
14	000858	五粮液	1,100	140,844.00	2.04
15	601633	长城汽车	5,400	136,620.00	1.97
16	600887	伊利股份	5,200	134,368.00	1.94
17	300017	网宿科技	16,300	128,770.00	1.86
18	601878	浙商证券	11,600	124,352.00	1.80
19	601688	华泰证券	10,000	123,900.00	1.79
20	601108	财通证券	18,600	122,946.00	1.78
21	300951	博硕科技	3,920	122,108.00	1.76
22	601881	中国银河	11,000	119,460.00	1.73
23	300502	新易盛	1,100	116,105.00	1.68
24	605006	山东玻纤	25,400	112,014.00	1.62

25	601058	赛轮轮胎	7,600	106,400.00	1.54
26	002078	太阳纸业	7,300	101,835.00	1.47
27	300803	指南针	2,700	98,307.00	1.42
28	600837	海通证券	11,200	95,872.00	1.39
29	600875	东方电气	4,900	90,405.00	1.31
30	600025	华能水电	7,600	81,928.00	1.18
31	600011	华能国际	7,900	75,998.00	1.10
32	601916	浙商银行	25,300	69,828.00	1.01
33	000526	学大教育	1,100	67,760.00	0.98
34	000686	东北证券	11,900	66,402.00	0.96
35	601318	中国平安	1,600	66,176.00	0.96
36	601100	恒立液压	1,400	65,212.00	0.94
37	688305	科德数控	1,000	64,460.00	0.93
38	603379	三美股份	1,600	62,624.00	0.91
39	601088	中国神华	1,400	62,118.00	0.90
40	601966	玲珑轮胎	3,300	60,621.00	0.88
41	000657	中钨高新	6,600	60,324.00	0.87
42	002938	鹏鼎控股	1,500	59,640.00	0.86
43	601066	中信建投	3,000	57,720.00	0.83
44	002659	凯文教育	16,900	55,263.00	0.80
45	603733	仙鹤股份	3,100	54,498.00	0.79
46	000528	柳工	4,500	50,355.00	0.73
47	601225	陕西煤业	1,900	48,963.00	0.71
48	603606	东方电缆	900	43,929.00	0.63
49	601668	中国建筑	6,500	34,515.00	0.50
50	002384	东山精密	1,500	31,050.00	0.45
51	688308	欧科亿	1,553	30,159.26	0.44
52	688525	佰维存储	300	19,245.00	0.28
53	000786	北新建材	600	17,796.00	0.26
54	300662	科锐国际	1,100	17,743.00	0.26

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	601500	通用股份	735,202.00	9.78

2	002810	山东赫达	556,761.61	7.41
3	600584	长电科技	466,333.00	6.21
4	600585	海螺水泥	425,080.00	5.66
5	300951	博硕科技	394,593.00	5.25
6	601985	中国核电	350,388.00	4.66
7	600160	巨化股份	338,287.00	4.50
8	600176	中国巨石	314,520.00	4.19
9	600999	招商证券	284,724.00	3.79
10	601058	赛轮轮胎	280,204.00	3.73
11	000526	学大教育	278,604.00	3.71
12	600036	招商银行	268,601.00	3.57
13	601088	中国神华	259,226.00	3.45
14	601699	潞安环能	253,303.00	3.37
15	600859	王府井	227,212.00	3.02
16	000425	徐工机械	220,202.00	2.93
17	002351	漫步者	218,089.00	2.90
18	002466	天齐锂业	216,759.00	2.88
19	600801	华新水泥	216,252.00	2.88
20	601881	中国银河	216,059.00	2.87
21	601633	长城汽车	213,195.00	2.84
22	600150	中国船舶	201,186.00	2.68
23	600028	中国石化	195,789.00	2.61
24	601628	中国人寿	195,740.00	2.60
25	601318	中国平安	195,536.00	2.60
26	601857	中国石油	195,011.00	2.59
27	605006	山东玻纤	194,220.00	2.58
28	600900	长江电力	191,743.00	2.55
29	601225	陕西煤业	174,029.00	2.32
30	600030	中信证券	173,549.00	2.31
31	600502	安徽建工	166,353.00	2.21
32	000858	五粮液	153,380.00	2.04
33	300662	科锐国际	153,158.00	2.04

注：“买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

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	601058	赛轮轮胎	641,775.00	8.54
2	601500	通用股份	550,732.00	7.33
3	688256	寒武纪	512,644.71	6.82
4	688326	经纬恒润	510,916.96	6.80
5	300502	新易盛	371,484.00	4.94
6	688041	海光信息	350,322.22	4.66
7	300017	网宿科技	328,358.00	4.37
8	600176	中国巨石	317,582.00	4.23
9	600585	海螺水泥	301,032.00	4.01
10	300130	新国都	298,729.00	3.97
11	300951	博硕科技	295,610.00	3.93
12	600584	长电科技	286,621.00	3.81
13	600036	招商银行	277,208.00	3.69
14	600150	中国船舶	274,883.00	3.66
15	600160	巨化股份	258,456.00	3.44
16	300474	景嘉微	254,470.00	3.39
17	000526	学大教育	252,461.00	3.36
18	600801	华新水泥	232,180.00	3.09
19	601088	中国神华	218,512.00	2.91
20	603019	中科曙光	214,149.00	2.85
21	688048	长光华芯	212,435.92	2.83
22	002810	山东赫达	208,432.00	2.77
23	601857	中国石油	206,986.00	2.75
24	601628	中国人寿	203,644.00	2.71
25	600028	中国石化	201,142.00	2.68
26	600859	王府井	192,932.00	2.57
27	002929	润建股份	192,650.00	2.56
28	000783	长江证券	159,619.00	2.12
29	600893	航发动力	154,667.00	2.06
30	688176	亚虹医药	153,384.31	2.04
31	600999	招商证券	153,344.00	2.04
32	300662	科锐国际	152,770.00	2.03
33	600760	中航沈飞	151,009.00	2.01
34	601985	中国核电	150,504.00	2.00

注：“卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

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	14,059,884.82
卖出股票收入（成交）总额	12,444,263.41

注：“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

山东赫达集团股份有限公司（股票代码：002810.SZ）：因其公司高管邱某亲属涉嫌短线交易，深圳证券交易所于 2023 年 8 月 4 日对邱某出具监管函，中国证监会于 2023 年 10 月对邱某立案，并于 2024 年 1 月 3 日对邱某给予警告并处以罚款。

招商证券股份有限公司（股票代码：600999.SH），因公司对从业人员的管理存在问题，中国证监会深圳监管局于 2024 年 1 月 1 日对其采取责令增加内部合规检查次数措施的行政监管措施；因公司在“15 城六局”债券的受托管理方面，存在未督导发行人做好募集资金管理、未持续跟踪和监督发行人履行有关信披临时报告义务等情形，中国证监会安徽监管局于 2024 年 1 月 12 日对其采取出具警示函的行政监管措施，并记入证券期货市场诚信档案；因公司未对发行人充分、审

慎核查，深圳证券交易所于 2023 年 9 月 1 日对其采取书面警示的自律监管措施。

中信证券股份有限公司（股票代码：600030.SH），因公司在持续督导履职中存在违规行为，中国证监会广东监管局于 2024 年 5 月 8 日对其采取出具警示函的行政监管措施；因公司违反《证券法》第一百八十六条，中国证监会于 2024 年 3 月 13 日对其立案，于 4 月 30 日下发《行政处罚决定书》，对其违反限制性规定转让股票的违法行为，责令改正，给予警告，合计没收违法所得 1,910,680.83 元，并处以 23,250,000 元罚款；因公司保荐的可转债项目，中国证监会于 2024 年 1 月 12 日对其采取出具警示函的行政监管措施；因公司在担任收购项目财务顾问时存在违规情形，中国证监会于 2023 年 9 月 22 日对其采取监管谈话的行政监管措施；因公司存在机房基础设施建设安全性不足，信息系统设备可靠性管理疏漏等问题，深圳证券交易所于 2023 年 9 月 22 日对其采取书面警示的自律监管措施，上海证券交易所于 2023 年 8 月 29 日对其采取书面警示的监管措施，中国证监会深圳监管局于 2023 年 7 月 7 日对其采取出具警示函的行政监管措施。

本基金基金经理依据基金合同及公司投资管理制度，在投资授权范围内，经正常投资决策程序对上述证券进行了投资。

本报告期内基金投资的前十名证券的其余发行主体没有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。

7.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

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	3,865.20
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,146.28
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,011.48

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的情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中分项之和与合计可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
784	7,700.58	1,879,723.79	31.14%	4,157,532.53	68.86%

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	20,215.76	0.3349%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2016年9月22日）基金份额总额	201,825,782.39
本报告期期初基金份额总额	6,381,183.99
本报告期基金总申购份额	254,701.20
减：本报告期基金总赎回份额	598,628.87
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	6,037,256.32

§ 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

本报告期内，本基金管理人股东会决议，选举朱晓亮先生、肖书强先生、孙娟女士担任公司董事。详情请参阅本基金管理人发布的相关公告。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金会计师事务所为上会会计师事务所（特殊普通合伙）自 2020 年 11 月 19 日起为本基金提供审计服务至今。

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，本基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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等情况。

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	
渤海证券	1	13,536,810.92	51.07%	3,193.24	45.44%	-
财通证券	2	6,368,108.61	24.03%	865.57	12.32%	-
国金证券	2	2,714,404.00	10.24%	1,454.64	20.70%	-
国投证券	2	2,354,874.01	8.88%	555.43	7.90%	-
中银国际证券	1	852,083.69	3.21%	452.49	6.44%	-

申万宏源证 券	1	677,867.00	2.56%	505.64	7.20%	-
------------	---	------------	-------	--------	-------	---

注：1、根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的规定及《新沃基金管理有限公司交易席位管理办法》，本基金管理人制定了券商选择标准和租用交易单元的程序，在对证券公司综合评估的基础上，选择财务状况良好，经营行为规范，研究实力较强的证券公司，向其租用专用交易席位。确定选用交易单元的券商后，本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租赁协议，并通知基金托管人。

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：无变更。

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
渤海证券	-	-	1,600,000.00	100.00%	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
中银国际证 券	-	-	-	-	-	-
申万宏源证 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	新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金 2023 年第 4 季度报告	指定报刊和/或管理人网站	2024 年 1 月 19 日
2	新沃基金管理有限公司关于更新旗下公募基金风险等级的公告	指定报刊和/或管理人网站	2024 年 2 月 8 日
3	新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金 2023 年年度报告	指定报刊和/或管理人网站	2024 年 3 月 28 日
4	新沃基金管理有限公司关于提醒投资者防范金融诈骗的风险提示公告	指定报刊和/或管理人网站	2024 年 4 月 4 日
5	新沃基金管理有限公司关于旗下部分基金新增和讯信息科技有限公司为基金销售机构的公告	指定报刊和/或管理人网站	2024 年 4 月 12 日
6	新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金招募说明书(更新)(2024	指定报刊和/或管理人网站	2024 年 4 月 19 日

	年第 1 号)		
7	新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要(更新)	指定报刊和/或管理人网站	2024 年 4 月 19 日
8	新沃基金管理有限公司关于董事变更情况的公告	指定报刊和/或管理人网站	2024 年 4 月 20 日
9	新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金 2024 年第 1 季度报告	指定报刊和/或管理人网站	2024 年 4 月 20 日
10	新沃基金管理有限公司关于新增注册资本及股东的公告	指定报刊和/或管理人网站	2024 年 5 月 13 日
11	新沃基金管理有限公司关于增加基金直销账户的公告	指定报刊和/或管理人网站	2024 年 6 月 19 日
12	新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要(更新)	指定报刊和/或管理人网站	2024 年 6 月 20 日

§ 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	2024/01/01-2024/06/30	1,878,908.13	-	-	1,878,908.13	31.12%
个人	2	2024/01/01-2024/06/30	1,276,933.73	-	-	1,276,933.73	21.15%
产品特有风险							
<p>(1) 赎回申请延期办理的风险 高比例投资者大额赎回时易使本基金发生巨额赎回或连续巨额赎回，中小投资者可能面临赎回申请需要与高比例投资者按同比例部分延期办理的风险。</p> <p>(2) 基金净值大幅波动的风险 当高比例投资者大量赎回本基金时，基金为支付赎回款项而卖出所持有的证券，可能造成证券价格波动，导致本基金资产净值发生波动。若高比例投资者赎回的基金份额收取赎回费，相应的赎回费用按约定将部分或全部归入基金资产，可能对基金资产净值造成较大波动。若高比例投资者大量赎回本基金，计算基金份额净值时进行四舍五入也可能引起基金份额净值发生波动。</p> <p>(3) 基金规模较小导致的风险 高比例投资者赎回后，可能导致基金规模较小，从而使得基金投资及运作管理的难度增加。</p> <p>(4) 提前终止基金合同的风险 高比例投资者赎回后，可能出现连续六十个工作日基金资产净值低于 5000 万元而面临的转换基金运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等风险。</p>							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

当持有基金份额比例达到或超过 20%的投资者较大比例赎回且基金的现金头寸不足时，基金管理人可能需要较高比例融入资金或较高比例变现资产，由此可能导致资金融入成本较高或较大冲击成本，造成基金财产损失、影响基金收益水平。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (一) 中国证监会准予新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金募集注册的文件
- (二) 《新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- (三) 《新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
- (四) 《关于申请募集注册新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金之法律意见书》
- (五) 基金管理人业务资格批件、营业执照
- (六) 基金托管人业务资格批件、营业执照
- (七) 中国证监会要求的其他文件

12.2 存放地点

基金管理人和/或基金托管人的办公场所。

12.3 查阅方式

投资者可以在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

新沃基金管理有限公司

2024年8月29日