华宝标普沪港深中国增强价值指数证券投资基金（LOF）
2020年中期报告

2020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：2020年8月31日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 8 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 2020 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录 2
1.1 重要提示 2
1.2 目录 3
§2 基金简介 5
2.1 基金基本情况 5
2.2 基金产品说明 5
2.3 基金管理人和基金托管人 6
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 7
3.1 主要会计数据和财务指标 7
3.2 基金净值表现 8
3.3 其他指标 9
§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遵规守信情况的说明 12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 12
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 13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 15
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 15
§5 托管人报告 15
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 15
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 16
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 16
§6 半年度财务会计报告（未经审计） 16
6.1 资产负债表 16
6.2 利润表 17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表 18
6.4 报表附注 20
§7 投资组合报告 44
7.1 期末基金资产组合情况 44
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 44
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 45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 50

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 50
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 50
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 50
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 50
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 50
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 51
7.12 市场中性策略执行情况 51
7.13 投资组合报告附注 51

§8 基金份额持有人信息 52

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 52
8.2 期末上市基金前十名持有人 53
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 53
8.4 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 53

§9 开放式基金份额变动 54

§10 重大事件揭示 54

10.1 基金份额持有人大会决议 54
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 54
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 54
10.4 基金投资策略的改变 55
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 55
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 55
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 55
10.8 其他重大事件 57

§11 影响投资者决策的其他重要信息 59

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 59
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 59

§12 备查文件目录 59

12.1 备查文件目录 59
12.2 存放地点 59
12.3 查阅方式 59

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华宝标普沪港深中国增强价值指数证券投资基金（LOF）	
基金简称	华宝标普沪港深中国增强价值指数	
场内简称	价值基金	
基金主代码	501310	
基金运作方式	上市契约型开放式（LOF）	
基金合同生效日	2018 年 10 月 25 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	163,930,812.31 份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所	
上市日期	2018 年 11 月 22 日	
下属分级基金的基金简称	华宝价值基金	华宝价值基金 C
下属分级基金的交易代码	501310	007397
报告期末下属分级基金的份额总额	160,803,010.56 份	3,127,801.75 份

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。正常情况下，本基金力争控制净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 5%。
投资策略	本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好的跟踪标的指数，实现基金投资目标。 1、组合复制策略 主要采取完全复制法，并根据标的指数成份股及其权重的变动对股票投资组合进行相应地调整。

	2、替代性策略 对于出现市场流动性不足、因法律法规原因个别成份股被限制投资等情况，导致本基金无法获得足够数量的股票时，基金管理人将通过投资成份股、非成份股、成份股个股衍生品等进行替代。 3、债券投资策略 采用自上而下的投资策略，根据宏观经济分析、资金面动向分析等判断未来利率变动走势，并利用债券定价技术，进行个券选择。
业绩比较基准	标普沪港深中国增强价值指数收益率×95%＋人民币银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，其长期平均风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。本基金为指数型基金，具有与标的指数相似的风险收益特征。本基金将通过港股通投资香港证券市场，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华宝基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	周雷	李申
	联系电话	021-38505888	021-60637102
	电子邮箱	xxpl@fsfund.com	lishen.zh@ccb.com
客户服务电话		400-700-5588、400-820-5050、021-38924558	021-60637111
传真		021-38505777	021-60635778
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号上海环球金融中心 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		孔祥清	田国立

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.fsfund.com
基金中期报告备置地点	本基金半年报置备地点包括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	中国证券登记结算有限责任公司、基金管理人	北京市西城区太平桥大街 17 号、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(2020 年 1 月 1 日-2020 年 6 月 30 日)	
	华宝价值基金	华宝价值基金 C
本期已实现收益	502,101.42	20,259.40
本期利润	-25,497,003.78	-264,842.14
加权平均基金份额本期利润	-0.1600	-0.1242
本期加权平均净值利润率	-17.84%	-14.09%
本期基金份额净值增长率	-16.24%	-16.39%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	-24,837,005.91	-494,333.37
期末可供分配基金份额利润	-0.1545	-0.1580
期末基金资产净值	135,966,004.65	2,633,468.38
期末基金份额净值	0.8455	0.8420
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	-15.45%	-14.46%

注：1、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要

低于所列数字。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

华宝价值基金

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	0.37%	0.88%	-1.42%	0.84%	1.79%	0.04%
过去三个月	-3.05%	1.01%	-4.82%	0.95%	1.77%	0.06%
过去六个月	-16.24%	1.53%	-17.80%	1.46%	1.56%	0.07%
过去一年	-16.27%	1.20%	-17.71%	1.15%	1.44%	0.05%
过去三年	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
自基金合同生效起至	-15.45%	1.12%	-14.92%	1.09%	-0.53%	0.03%

华宝价值基金 C

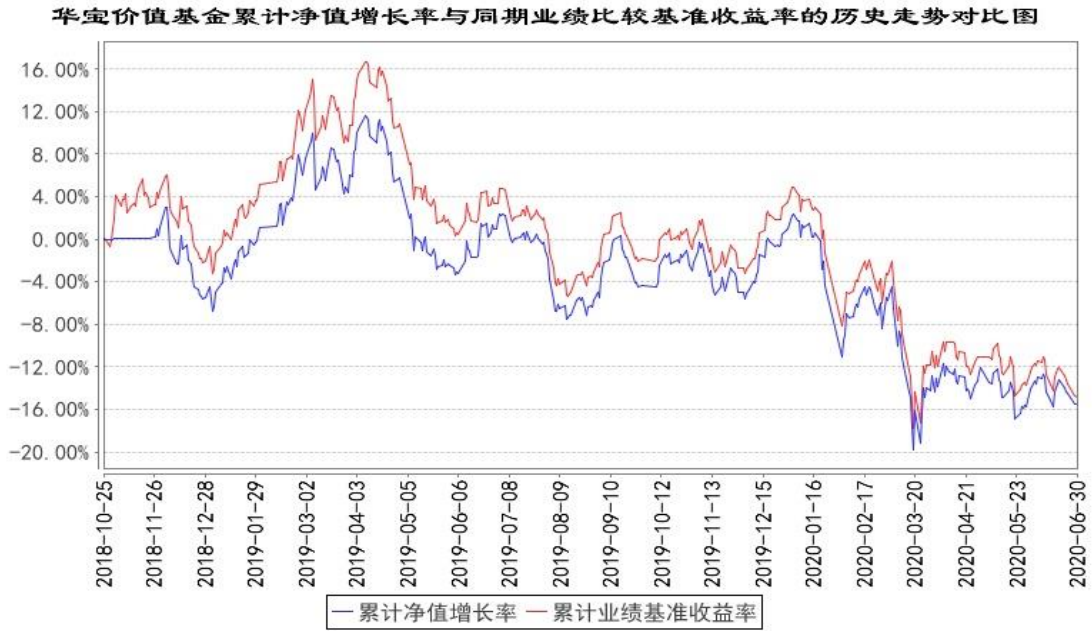
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	0.35%	0.88%	-1.42%	0.84%	1.77%	0.04%
过去三个月	-3.13%	1.01%	-4.82%	0.95%	1.69%	0.06%
过去六个月	-16.39%	1.53%	-17.80%	1.46%	1.41%	0.07%
过去一年	-16.59%	1.20%	-17.71%	1.15%	1.12%	0.05%
过去三年	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
自基金合同生效起至	-14.46%	1.16%	-17.50%	1.11%	3.04%	0.05%

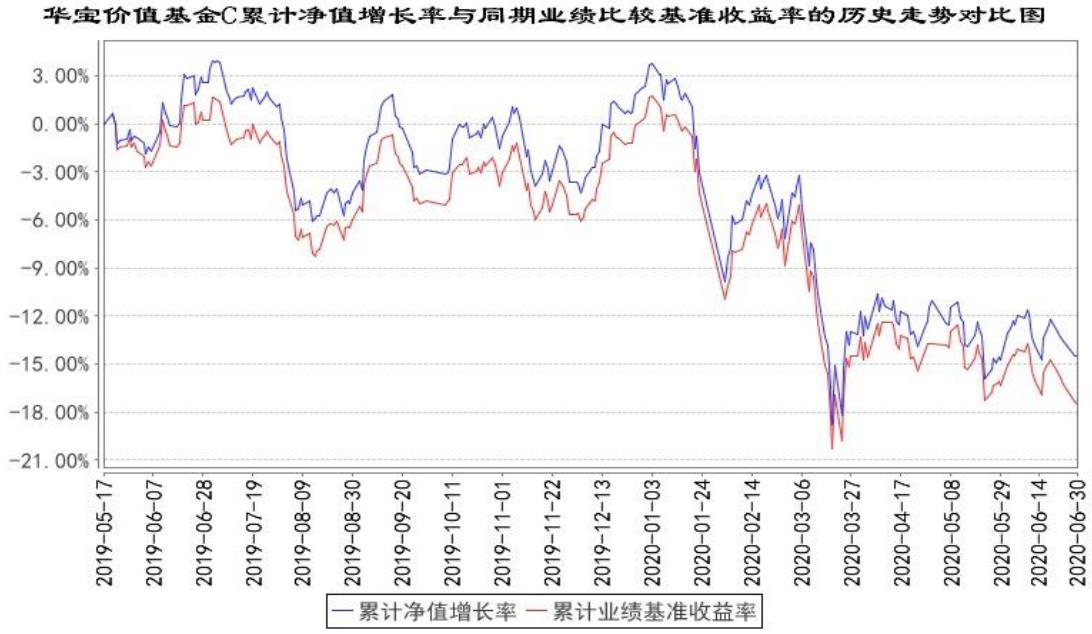
注：1、本基金基金合同生效于 2018 年 10 月 25 日，截至报告日，本基金基金合同生效未满一年。

2、截至 2019 年 4 月 24 日，本基金已达到合同规定的资产配置比例。

3、本基金 C 份额成立于 2019 年 5 月 21 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：1、按照基金合同的约定，自基金成立日期的 6 个月内达到规定的资产组合，截至 2019 年 4 月 24 日，本基金已达到合同规定的资产配置比例。

2、本基金 C 份额成立于 2019 年 5 月 21 日。

3.3 其他指标

无

§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

基金管理人是 2003 年 3 月 7 日正式成立的合资基金管理公司，截至本报告期末（2020 年 6 月 30 日），正在管理运作的证券投资基金分别为：华宝宝康债券投资基金、华宝宝康消费品证券投资基金、华宝宝康灵活配置证券投资基金、华宝多策略增长开放式证券投资基金、华宝现金宝货币市场基金、华宝动力组合混合型证券投资基金、华宝收益增长混合型证券投资基金、华宝先进成长混合型证券投资基金、华宝行业精选混合型证券投资基金、华宝海外中国成长混合型证券投资基金、华宝大盘精选混合型证券投资基金、华宝增强收益债券型证券投资基金、华宝中证 100 指数证券投资基金、华宝上证 180 价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华宝上证 180 价值交易型开放式指数证券投资基金、华宝新兴产业混合型证券投资基金、华宝可转债债券型证券投资基金、华宝中证银行交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华宝标普石油天然气上游股票指数证券投资基金(LOF)、华宝医药生物优选混合型证券投资基金、华宝资源优选混合型证券投资基金、华宝现金添益交易型货币市场基金、华宝服务优选混合型证券投资基金、华宝创新优选混合型证券投资基金、华宝生态中国混合型证券投资基金、华宝量化对冲策略混合型发起式证券投资基金、华宝高端制造股票型证券投资基金、华宝品质生活股票型证券投资基金、华宝稳健回报灵活配置混合型证券投资基金、华宝事件驱动混合型证券投资基金、华宝国策导向混合型证券投资基金、华宝中证医疗指数分级证券投资基金、华宝新价值灵活配置混合型证券投资基金、华宝中证 1000 指数分级证券投资基金、华宝新机遇灵活配置混合型证券投资基金(LOF)、华宝万物互联灵活配置混合型证券投资基金、华宝转型升级灵活配置混合型证券投资基金、华宝核心优势灵活配置混合型证券投资基金、华宝标普美国品质消费股票指数证券投资基金(LOF)、华宝标普香港上市中国中小盘指数证券投资基金(LOF)、华宝中证军工交易型开放式指数证券投资基金、华宝中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金、华宝新活力灵活配置混合型证券投资基金、华宝未来主导产业灵活配置混合型证券投资基金、华宝沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金、华宝新起点灵活配置混合型证券投资基金、华宝标普中国 A 股红利机会指数证券投资基金(LOF)、华宝新飞跃灵活配置混合型证券投资基金、华宝新优选一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、华宝港股通恒生中国(香港上市)25 指数证券投资基金(LOF)、华宝智慧产业灵活配置混合型证券投资基金、华宝第三产业灵活配置混合型证券投资基金、华宝中证银行交易型开放式指数证券投资基金、华宝价值发现混合型证券投资基金、华宝港股通恒生香港 35 指数证券投资基金(LOF)、华宝中证 500 指数增强型发起式证券投资基金、华宝港股通香港精选混合型证券投资基

金、华宝中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、华宝宝丰高等级债券型发起式证券投资基金、华宝绿色主题混合型证券投资基金、华宝标普沪港深中国增强价值指数证券投资基金(LOF)、华宝标普中国 A 股质量价值指数证券投资基金(LOF)、华宝科技先锋混合型证券投资基金、华宝大健康混合型证券投资基金、华宝中短债债券型发起式证券投资基金、华宝宝裕纯债债券型证券投资基金、华宝稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、华宝中证医疗交易型开放式指数证券投资基金、华宝宝盛纯债债券型证券投资基金、华宝消费升级混合型证券投资基金、华宝宝怡纯债债券型证券投资基金、华宝中证科技龙头交易型开放式指数证券投资基金、华宝 MSCI 中国 A 股国际通 ESG 通用指数证券投资基金（LOF）、华宝中证科技龙头交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、华宝浮动净值型发起式货币市场基金、华宝政策性金融债债券型证券投资基金、华宝绿色领先股票型证券投资基金、华宝宝润纯债债券型证券投资基金、华宝致远混合型证券投资基金（QDII）、华宝宝惠纯债 39 个月定期开放债券型证券投资基金、华宝中证消费龙头指数证券投资基金（LOF）、华宝成长策略混合型证券投资基金、华宝红利精选混合型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
周晶	公司总经理助理/国际业务部总经理、本基金基金经理、华宝油气、美国消费、华宝标普香港上市中国中小盘指数（LOF）、华宝港股通恒生中国（香港上市）25 指数（场内简称“香港大	2018 年 10 月 25 日	-	15	博士。先后在美国德州奥斯丁市德亚资本、泛太平洋证券（美国）和汇丰证券（美国）从事数量分析、另类投资分析和证券投资研究工作。2005 年至 2007 年任华宝基金管理有限公司内控审计风险管理部主管。2011 年再次加入华宝基金管理有限公司，现任公司总经理助理/国际业务部总经理/首席策略分析师。2013 年 6 月至 2015 年 11 月任华宝成熟市场动量优选证券投资基金基金经理。2014 年 9 月起任华宝标普石油天然气上游股票指数证券投资基金(LOF)基金经理。2015 年 9 月至 2017 年 8 月任华宝中国互联网股票型证券投资基金基金经理。2016 年 3 月起任华宝标普美国品质消费股票指数证券投资基金（LOF）基金经理。2016 年 6 月起任华宝标普香港上市中国中小盘指数证券投资基金（LOF）基金经理。2017 年 4 月起任华宝港股通恒生中国（香港上市）25 指数证券投资基金（LOF）基金经理。2018 年 3 月起任华宝港股通恒生香港 35 指数

	盘”)、华宝港股通恒生香港35指数（场内简称“香港本地”)、华宝致远混合基金经理				证券投资基金（LOF)基金经理。2018年10月起任华宝标普沪港深中国增强价值指数证券投资基金（LOF）基金经理。2019年11月起任华宝致远混合型证券投资基金（QDII）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、证券从业含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》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》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》及其各项实施细则、《华宝标普沪港深中国增强价值指数证券投资基金（LOF）基金合同》和其他相关法律法规的规定、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋取最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，基金管理人未发生所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少

的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%。

本报告期内，本基金未发现异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金采用全复制方法跟踪标普沪港深中国增强价值指数。该指数在沪港深三地上市的股票中采用量化的方法精选估值偏低的股票。整个基金通过 A 股和港股通进行交易。以下为对上半年影响标的指数表现的市场因素分析。

2020 年上半年，A 股港股皆经历高波动模式。一季度，受到新冠疫情影响和随之而来的全球金融条件大幅收紧影响，以及沙特俄罗斯原油减产协议破裂，A 股港股指数迅速回撤。整个二季度，全球股票市场普遍上涨。主要原因为：1、美联储开启大规模 QE，同时充当最后贷款人角色，3 月以来迅速宣布了 9 项特别贷款安排合计提供 2.3 万亿美元信贷，有效解决了市场流动性问题，和财政部紧密合作，推出多个计划为中小企业和市政部门进行纾困，同时和多国央行加码货币互换规模，减缓美元荒的问题；2、全球主要股指估值受到大幅压缩，前期极度超卖，多空力量过度失衡；3、3 月末，欧洲主要国家疫情日新增数开始下降，4 月初以来，美国疫情日新增数进入平台期,疫情得到控制预期提升，多个前期疫情严重国家开始逐渐解除封锁；4、OPEC+达成减产协议，油价预期趋于稳定有利于全球金融条件的改善。

中国资产方面，国内疫情控制情况较好，2-4 月超宽松的货币政策使得近期的经济前瞻指标社融增速持续回升，专项债提前且加速发行，央行通过直达实体的政策工具达到宽信用的目的，近期 PMI、工业企业利润、工业增加值、地产相关数据皆稳中向好，市场对短周期经济回升逐渐形成预期。但投资者依然对于经济向上幅度和持续程度存在怀疑，因此资金集中在赛道更佳的消费和科技等远期向好且近期持续改善的“新经济”板块，叠加价值板块内较多行业容易受到疫情反复的干扰，市场对于低估值顺周期板块重视程度有限。这样造成了 A 股和港股的顺周期价值板块在二季度的反弹中普遍表现不佳。

截止今年二季度末，标普沪港深中国增强价值指数（人民币）， 从 1561.42 下跌到 1269.31，跌幅 18.7%。恒生国企指数这段期间下跌 12.6%，沪深 300 指数这段期间上涨 1.64%。指数表现相对其他主要宽基指数偏弱。 标普沪港深中国增强价值指数上半年年化波动率为 24.9%，相较恒生国企指数的 28.7%略低，相较沪深 300 指数的 24.2%略高。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金份额 A 净值收益率为-16.24%，基金份额 C 净值收益率为-16.39%，同期业绩比较基准收益率为-17.80%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从当前时点展望 2020 年下半年，我们对于 A 股和港股持谨慎乐观的态度，波动性相对二季度上升的概率有所加大。我们预计 A 股和港股市场将呈现出成长和价值轮动的风格特征，经济改善幅度和持续性，以及疫情相关的变化将对于低估值板块有较大影响。

流动性方面，国内层面，虽然近期总量和中观经济数据恢复较快，但中小企业压力依然较大，国内流动性边际进一步宽松可能性较小，但大概率依然会维持稳定。国际层面，美国后续联储货币政策大概率维持宽松，欧元区终于通过财政刺激，疫情控制较为良好，欧美经济增长差缩窄，美元指数持续走弱，有利于包括 A 股和港股在内的新兴市场。业绩层面，复工逐步推进，三季度信用债额度释放力度可期，中国 PPI 筑底回升带来中国资产业绩上行暨大概率，对于 A 股和港股形成利好，同时也或将导致 A 股和港股整体价值和成长风格更为均衡。前期消费和科技板块涨幅较大，估值较高，市场存在向低估值切换的基础，但前提依然是经济复苏的持续性。

近期对于价值板块需要关注的风险因素在于，随着美国大选的临近，中美之间地缘政治风险上升的概率或将加大，对于市场的风险偏好和经济复苏预期形成扰动。但同时，下半年的疫苗研发进程也需要关注，疫苗研发的积极进展对于和经济增长预期更为敏感的价值板块或将形成较强的利好效应。

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。

（1）日常估值流程

本基金的估值由基金会计负责，基金会计以本基金为会计核算主体，基金会计核算独立于公司会计核算，独立建账、独立核算。基金会计采用专用的财务核算软件系统进行基金核算及帐务

处理；每日按时接收成交数据及权益数据，进行基金估值。基金会计核算采用基金管理人与托管银行双人同步独立核算、相互核对的方式进行；基金会计每日就基金的会计核算、基金估值等与托管银行进行核对，每日估值结果必须与托管行核对一致后才能对外公告。

（2）特殊业务估值流程

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期亏损，未有应分未分的利润。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华宝标普沪港深中国增强价值指数证券投资基金（LOF）

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	9,198,695.30	9,640,619.39
结算备付金		3,430.96	636,846.61
存出保证金		6,263.41	66,490.48
交易性金融资产	6.4.7.2	129,492,259.88	150,805,165.48
其中：股票投资		129,492,259.88	150,805,165.48
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	717,656.54
应收利息	6.4.7.5	1,811.29	2,495.94
应收股利		1,310,164.91	29,440.00
应收申购款		815,837.02	825,697.32
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-

资产总计		140,828,462.77	162,724,411.76
负债和所有者权益	**附注号**	**本期末 2020年6月30日**	**上年度末 2019年12月31日**
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		17.26	684.40
应付赎回款		1,701,256.33	3,225,348.62
应付管理人报酬		86,168.13	98,162.17
应付托管费		17,233.62	19,632.44
应付销售服务费		840.13	860.62
应付交易费用	6.4.7.7	21,469.89	25,917.77
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	402,004.38	249,166.47
负债合计		2,228,989.74	3,619,772.49
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	163,930,812.31	157,618,928.45
未分配利润	6.4.7.10	-25,331,339.28	1,485,710.82
所有者权益合计		138,599,473.03	159,104,639.27
负债和所有者权益总计		140,828,462.77	162,724,411.76

6.2 利润表

会计主体：华宝标普沪港深中国增强价值指数证券投资基金（LOF）

本报告期：2020年1月1日至2020年6月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日
一、收入		-24,777,286.53	3,425,043.72
1.利息收入		39,505.80	39,201.36
其中：存款利息收入	6.4.7.11	39,505.80	39,201.36
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		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-

2.投资收益（损失以“-”填列）		1,415,116.73	4,716,323.54
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-1,493,712.96	1,831,541.18
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	2,908,829.69	2,884,782.36
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-26,284,206.74	-1,538,373.59
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	52,297.68	207,892.41
减：二、费用		984,559.39	894,936.50
1．管理人报酬	6.4.10.2.1	540,268.68	349,341.29
2．托管费	6.4.10.2.2	108,053.75	69,868.32
3．销售服务费	6.4.10.2.3	3,710.08	4.36
4．交易费用	6.4.7.19	125,877.17	306,608.09
5．利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6．税金及附加		-	-
7．其他费用	6.4.7.20	206,649.71	169,114.44
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-25,761,845.92	2,530,107.22
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-25,761,845.92	2,530,107.22

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华宝标普沪港深中国增强价值指数证券投资基金（LOF）

本报告期：2020年1月1日至2020年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	157,618,928.45	1,485,710.82	159,104,639.27
二、本期经营活动产生的基金净	-	-25,761,845.92	-25,761,845.92

值变动数（本期利润）			
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	6,311,883.86	-1,055,204.18	5,256,679.68
其中：1.基金申购款	62,283,499.76	-6,039,956.48	56,243,543.28
2.基金赎回款	-55,971,615.90	4,984,752.30	-50,986,863.60
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	163,930,812.31	-25,331,339.28	138,599,473.03
项目	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	65,049,268.37	-2,955,590.44	62,093,677.93
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	2,530,107.22	2,530,107.22
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	57,238,385.54	1,626,752.07	58,865,137.61
其中：1.基金申购款	153,987,271.22	7,950,617.47	161,937,888.69
2.基金赎回款	-96,748,885.68	-6,323,865.40	-103,072,751.08
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者	122,287,653.91	1,201,268.85	123,488,922.76

权益(基金净值)			

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署：

黄小薏	向辉	张幸骏
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华宝标普沪港深中国增强价值指数证券投资基金(LOF)(以下简称“本基金”)系由基金管理人华宝基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《华宝标普沪港深中国增强价值指数证券投资基金(LOF)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[2018]582 号文批准公开募集。本基金为上市契约型开放式基金，存续期限为不定期，首次设立募集基金份额为 246,763,927.66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(18)第 00009号的验资报告。基金合同于2018年10月25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《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《华宝标普沪港深中国增强价值指数证券投资基金(LOF)招募说明书》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，包括标的指数成份股、备选成份股、依法发行上市的其他股票(包括港股通标的股票和中国证监会核准发行上市的股票)、债券(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、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、资产支持证券、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)。本基金可以参与融资和转融通证券出借业务。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。

根据《华宝基金管理有限公司关于华宝标普沪港深中国增强价值指数证券投资基金（LOF）增加C类基金份额并修改基金合同的公告》，自2019年5月17日起，增设C类基金份额。增加C类基金份额后，本基金原有基金份额为A类基金份额。本基金根据销售服务费及申购费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。不从本类别基金资产中计提销售服务费，且收取申购费的基金份额类别为A类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费，且不收取申购费的基金份

额类别为 C 类基金份额。两类基金份额分设不同的基金代码，并分别计算并公布基金份额净值和基金份额累计净值。A 类基金份额登记在登记结算系统，C 类基金份额登记在华宝基金管理有限公司登记系统。A 类基金份额参与上市交易，C 类基金份额不参与上市交易。

基金的投资组合比例为：本基金投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，且投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%；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，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)或者投资于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%。本基金出于跟踪标的指数的需要，选择将部分基金资产投资于港股或选择不将基金资产投资于港股，基金资产并非必然投资港股。本基金通过港股通投资标的指数的成份股、备选成份股，未来如果港股通业务规则发生变化或出现法律法规或监管部门允许投资的其他模式，基金管理人可在履行适当程序后相应调整。本基金的业绩比较基准为：标普沪港深中国增强价值指数收益率×95％+人民币银行活期存款利率(税后)×5％。

本基金的财务报表于 2020 年 8 月 31 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

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）和在财务报表附注所列示依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2020 半年度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 2020 年 6 月 30 日的财务状况以及 2020 半年度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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

-

6.4.5.2 会计估计变更的说明

-

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‰；

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

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

（2）增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

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

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。

（3）城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

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

（4）企业所得税

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

（5）个人所得税

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

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

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差

别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税；

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

（6）境外投资

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81 号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127 号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
活期存款	9,198,695.30
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计	9,198,695.30

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2020 年 6 月 30 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		158,634,212.68	129,492,259.88	-29,141,952.80
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		158,634,212.68	129,492,259.88	-29,141,952.80

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	1,804.63
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	1.50
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	2.36
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	2.80
合计	1,811.29

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	21,469.89
银行间市场应付交易费用	-
合计	21,469.89

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	3,151.10
应付证券出借违约金	-
预提费用	214,535.36
应付指数使用费	150,001.92
应付数据使用费	34,316.00
合计	402,004.38

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

华宝价值基金

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	156,452,245.14	156,452,245.14
本期申购	58,204,971.32	58,204,971.32
本期赎回（以“-”号填列）	-53,854,205.90	-53,854,205.90
-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	160,803,010.56	160,803,010.56

华宝价值基金 C

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,166,683.31	1,166,683.31
本期申购	4,078,528.44	4,078,528.44
本期赎回（以“-”号填列）	-2,117,410.00	-2,117,410.00
-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	3,127,801.75	3,127,801.75

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

华宝价值基金			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	6,882,574.51	-5,405,159.89	1,477,414.62
本期利润	502,101.42	-25,999,105.20	-25,497,003.78
本期基金份额交易产生的变动数	167,816.27	-985,233.02	-817,416.75
其中：基金申购款	2,197,558.81	-7,775,445.65	-5,577,886.84
基金赎回款	-2,029,742.54	6,790,212.63	4,760,470.09
本期已分配利润	-	-	-
本期末	7,552,492.20	-32,389,498.11	-24,837,005.91
华宝价值基金 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	48,705.23	-40,409.03	8,296.20
本期利润	20,259.40	-285,101.54	-264,842.14
本期基金份额交易产生的变动数	65,422.48	-303,209.91	-237,787.43
其中：基金申购款	136,986.81	-599,056.45	-462,069.64
基金赎回款	-71,564.33	295,846.54	224,282.21
本期已分配利润	-	-	-
本期末	134,387.11	-628,720.48	-494,333.37

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	37,617.06
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	1,439.59
其他	449.15
合计	39,505.80

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-1,493,712.96
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-1,493,712.96

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	30,389,226.87
减：卖出股票成本总额	31,882,939.83
买卖股票差价收入	-1,493,712.96

6.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

无

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

无

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	2,908,829.69
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	2,908,829.69

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	-26,284,206.74
股票投资	-26,284,206.74
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2.衍生工具	-
权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-26,284,206.74

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

基金赎回费收入	52,297.68
合计	52,297.68

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	125,877.17
银行间市场交易费用	-
合计	125,877.17

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
审计费用	24,863.02
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行费用	407.19
指数使用费	104,643.00
数据使用费	17,064.16
合计	206,649.71

注：根据基金合同及与标的指数许可方所签订的指数许可使用协议，本基金的指数许可使用费从基金财产中列支，按前一日基金资产净值的 0.05%的年费率计提。其计算公式为：日指数许可使用费=前一日基金资产净值×0.05%÷当年天数。指数许可使用费的收取下限为每年 30,000 美元。

6.4.7.21 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

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无其它需作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)	成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)
华宝证券	827,498.00	1.24	694,027.00	0.43

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本期无通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本期无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本期无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例（%）
华宝证券	770.64	1.34	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例（%）
华宝证券	646.42	0.47	646.42	0.92

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 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	540,268.68	349,341.29
其中：支付销售机构的客户维护费	172,918.19	132,476.24

注：支付基金管理人华宝基金的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 0.75%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：日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×0.75%÷当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	108,053.75	69,868.32

注：支付基金托管人中国建设银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.15%的年费率计提，逐

日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：日基金托管费=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 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华宝价值基金	华宝价值基金 C	合计
华宝基金	-	17.19	17.19
合计	-	17.19	17.19
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华宝价值基金	华宝价值基金 C	合计
华宝基金	-	0.83	0.83
合计	-	0.83	0.83

注：本基金 C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.40% ，销售服务费按前一日 C 类基金份额基金资产净值的 0.40% 年费率计提。

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

本基金本报告期内无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

本基金报告期及上年度可比期间未发生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

本基金报告期及上年度可比期间未发生转融通证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期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

本报告期末及上年度末除基金管理人以外的其他关联方未投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	9,198,695.30	37,863.66	8,180,324.13	32,649.49

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

本基金本报告期末投资于基金托管人中国建设银行发行的股票——建设银行(证券代码：00939) 1,322,000.00 股，期末公允价值为人民币 7,571,449.35 元，占本基金期末基金资产净值比例为 5.46%。

除以上情况外，无其他需要说明的关联方交易事项。

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(2020 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

本基金本报告期末持有的证券中无因新发/增发证券而于期末持有流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末持有的股票中无暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末，本基金未持有银行间市场债券正回购交易中作为质押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金未持有交易所市场债券正回购交易中作为质押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

截至本报告期末，本基金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

本基金为指数型基金，跟踪标普沪港深中国增强价值指数。本基金在日常经营活动中面临的与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与跟踪指数相同的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，公司内部监督和反馈系统包括内部控制委员会、督察长、合规审计部、风险管理部、各部门负责人和风险控制联络人、各业务岗位。内部控制委员会负责对公司在经营管理和基金运作中的风险进行评估并研究制订相应的控制制度。督察长向董事会负责，总管公司的内控事务并独立地就内控制度的执行情况履行检查、评价、报告和建议职能。风险管理部在督察长指导下对公司内部控制运行情况进行监控，主要针对公司内部控制制度的总体构架和内部控制的目标进行评估并提出改进意见；合规审计部在督察长的领导下对各部门和岗位的内部控制执行情况进行监督和核查，同时对内控的失控点进行查漏并责令改正。

本基金的基金管理人根据自身经营特点设立顺序递进、权责统一、严密有效的四层监控防线。第一层监控防线为一线岗位自控与互控；第二层防线为大业务板块内部各部门和部门之间的自控和互控；第三层监控防线为风险管理部和合规审计部对各岗位、各部门、各项业务全面实施的监督反馈；最后是以内部控制委员会为主体的第四层防线，实施对公司各类业务和风险的总体监督、

控制，并对风险管理部和合规审计部的工作予以直接指导。

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

6.4.13.2 信用风险

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

为了规避信用风险，本公司在交易前对交易对手的资信状况进行充分的评估。本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，违约风险发生的可能性很小；在场外交易市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

于本报告期末，本基金无债券投资。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末无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

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的债券投资。

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，本基金所承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（自 2017 年 10 月 1 日起施行）等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

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

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

本基金所持证券均在证券交易所上市。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；开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

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

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面

临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

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

本基金持有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 2020 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	9,198,695.30	-	-	-	9,198,695.30
结算备付金	3,430.96	-	-	-	3,430.96
存出保证金	6,263.41	-	-	-	6,263.41
交易性金融资产	-	-	-	129,492,259.88	129,492,259.88
应收利息	-	-	-	1,811.29	1,811.29
应收股利	-	-	-	1,310,164.91	1,310,164.91
应收申购款	6,441.32	-	-	809,395.70	815,837.02
资产总计	9,214,830.99	-	-	131,613,631.78	140,828,462.77
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,701,256.33	1,701,256.33
应付管理人报酬	-	-	-	86,168.13	86,168.13
应付托管费	-	-	-	17,233.62	17,233.62
应付证券清算款	-	-	-	17.26	17.26
应付销售服务费	-	-	-	840.13	840.13
应付交易费用	-	-	-	21,469.89	21,469.89
其他负债	-	-	-	402,004.38	402,004.38
负债总计	-	-	-	2,228,989.74	2,228,989.74
利率敏感度缺口	9,214,830.99	-	-	129,384,642.04	138,599,473.03
上年度末 2019 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	9,640,619.39	-	-	-	9,640,619.39
结算备付金	636,846.61	-	-	-	636,846.61
存出保证金	66,490.48	-	-	-	66,490.48
交易性金融资产	-	-	-	150,805,165.48	150,805,165.48
应收利息	-	-	-	2,495.94	2,495.94
应收股利	-	-	-	29,440.00	29,440.00
应收申购款	9,539.87	-	-	816,157.45	825,697.32

应收证券清算款	-	-	-	717,656.54	717,656.54

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日				
资产总计	10,353,496.35	-	-	152,370,915.41	162,724,411.76
负债					
应付赎回款	-	-	-	3,225,348.62	3,225,348.62
应付管理人报酬	-	-	-	98,162.17	98,162.17
应付托管费	-	-	-	19,632.44	19,632.44
应付证券清算款	-	-	-	684.40	684.40
应付销售服务费	-	-	-	860.62	860.62
应付交易费用	-	-	-	25,917.77	25,917.77
其他负债	-	-	-	249,166.47	249,166.47
负债总计	-	-	-	3,619,772.49	3,619,772.49
利率敏感度缺口	10,353,496.35	-	-	148,751,142.92	159,104,639.27

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

于本报告期末，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于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。本基金持有不以记账本位币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。

截至本报告期末，本基金所持有的交易性金融资产部分投资于香港股票市场，以港币计价，金额折合成人民币为 78,596,852.58 元。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

	美元 折合人民币元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	78,596,852.58	-	78,596,852.58
资产合计	-	78,596,852.58	-	78,596,852.58
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	78,596,852.58	-	78,596,852.58

项目	上年度末 2019年12月31日			
	美元 折合人民币元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	97,654,164.38	-	97,654,164.38
资产合计	-	97,654,164.38	-	97,654,164.38
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	97,654,164.38	-	97,654,164.38

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2020年6月30日）	上年度末（2019年12月31日）
分析	1. 所有外币相对人民币升值5%	3,929,842.63	4,882,708.22
	2. 所有外币相对	-3,929,842.62	-4,882,708.22

	人民币贬值 5%		

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的股票，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。

本基金采用指数化投资策略，股票资产跟踪的标的指数为标普沪港深中国增强价值指数，通过指数化分散投资降低其他价格风险。本基金投资于标的指数成份股及其备选成份股股票资产的比例不低于基金资产净值的 90%，且投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%。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 2020 年 6 月 30 日		上年度末 2019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	129,492,259.88	93.43	150,805,165.48	94.78
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	129,492,259.88	93.43	150,805,165.48	94.78

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变。	
	相关风险变量的变	对资产负债表日基金资产净值的

	动	影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2020年6月30日）	上年度末（2019年12月31日）
分析	1.业绩比较基准上升5%	7,123,260.32	8,138,235.71
	2.业绩比较基准下降5%	-7,123,260.32	-8,138,235.71

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1)公允价值

(a)不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括银行存款、结算备付金、存出保证金、应收申购款、应收利息以及其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(b)以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于本报告期末，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币129,492,259.88元，无划分为第二层次或第三层次的余额（于上年度末，属于第一层次的余额为人民币150,805,165.48元，无划分为第二层次或第三层次的余额）。

(ii)公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的证券，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的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关证券公允价值应属第二层次或第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

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

(2)承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大承诺事项。

(3)其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的其他重要事项

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	129,492,259.88	91.95
	其中：股票	129,492,259.88	91.95
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	9,202,126.26	6.53
8	其他各项资产	2,134,076.63	1.52
9	合计	140,828,462.77	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

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	713,216.50	0.51
C	制造业	14,941,275.80	10.78
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	13,857,040.00	10.00
F	批发和零售业	6,239,904.00	4.50
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	-	-
J	金融业	7,866,870.00	5.68
K	房地产业	6,994,895.00	5.05
L	租赁和商务服务业	282,206.00	0.20

M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	50,895,407.30	36.72

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资部分的股票投资。

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
基础材料	4,475,518.03	3.23
消费者非必需品	2,686,906.59	1.94
消费者常用品	-	-
能源	11,257,344.18	8.12
金融	39,028,682.42	28.16
医疗保健	2,445,181.15	1.76
工业	7,010,565.22	5.06
信息技术	918,007.20	0.66
电信服务	2,604,272.25	1.88
公用事业	2,472,572.47	1.78
房地产	5,697,803.07	4.11
合计	78,596,852.58	56.71

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

7.3.1 期末指数投资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	00939	建设银行	1,322,000	7,571,449.35	5.46
2	01288	农业银行	2,594,000	7,392,725.68	5.33
3	03328	交通银行	1,606,000	7,012,186.58	5.06
4	03988	中国银行	2,671,000	7,002,220.95	5.05
5	601668	中国建筑	1,419,200	6,769,584.00	4.88
6	00386	中国石油化工股份	1,896,000	5,593,979.64	4.04
7	601169	北京银行	1,089,780	5,339,922.00	3.85

8	600104	上汽集团	290,500	4,935,595.00	3.56
9	00857	中国石油股份	2,052,000	4,817,153.72	3.48
10	00998	中信银行	1,054,000	3,254,148.27	2.35
11	600019	宝钢股份	652,600	2,975,856.00	2.15
12	03323	中国建材	350,000	2,637,558.00	1.90
13	002024	苏宁易购	300,400	2,634,508.00	1.90
14	600015	华夏银行	412,900	2,526,948.00	1.82
15	01988	民生银行	458,500	2,228,081.12	1.61
16	00728	中国电信	994,000	1,970,271.81	1.42
17	01800	中国交通建设	457,000	1,824,221.89	1.32
18	00267	中信股份	266,000	1,768,858.29	1.28
19	601669	中国电建	509,200	1,761,832.00	1.27
20	600606	绿地控股	222,800	1,376,904.00	0.99
21	000069	华侨城A	223,700	1,355,622.00	0.98
22	01099	国药控股	74,000	1,341,076.07	0.97
23	00390	中国中铁	361,000	1,312,412.32	0.95
24	00966	中国太平	107,200	1,216,175.94	0.88
25	600068	葛洲坝	203,600	1,211,420.00	0.87
26	601618	中国中冶	476,300	1,195,513.00	0.86
27	01339	中国人民保险集团	538,000	1,110,633.43	0.80
28	600153	建发股份	133,100	1,078,110.00	0.78
29	00836	华润电力	114,000	948,643.98	0.68
30	01186	中国铁建	167,500	931,777.31	0.67
31	00148	建滔集团	50,000	918,007.20	0.66
32	600170	上海建工	291,900	896,133.00	0.65
33	00489	东风集团股份	210,000	888,137.71	0.64
34	03383	雅居乐集团	106,000	883,040.72	0.64
35	01359	中国信达	634,000	880,263.86	0.64
36	002146	荣盛发展	108,300	877,230.00	0.63
37	00392	北京控股	37,000	875,349.55	0.63
38	000402	金 融 街	128,900	855,896.00	0.62
39	01813	合景泰富集团	71,500	850,348.70	0.61
40	01171	兖州煤业股份	160,000	846,210.82	0.61
41	02333	长城汽车	185,500	820,104.70	0.59
42	600325	华发股份	101,000	713,060.00	0.51
43	00144	招商局港口	82,000	686,103.05	0.50

44	600297	广汇汽车	209,800	669,262.00	0.48
45	02607	上海医药	54,900	652,925.09	0.47
46	600755	厦门国贸	98,800	652,080.00	0.47
47	00902	华能国际电力股份	244,000	648,578.94	0.47
48	03669	永达汽车	75,500	642,061.54	0.46
49	601992	金隅集团	208,400	637,704.00	0.46
50	00552	中国通信服务	144,000	634,000.44	0.46
51	02777	富力地产	75,600	622,885.70	0.45
52	02689	玖龙纸业	97,000	621,111.80	0.45
53	600820	隧道股份	106,800	603,420.00	0.44
54	00358	江西铜业股份	84,000	599,253.18	0.43
55	600282	南钢股份	185,100	597,873.00	0.43
56	000709	河钢股份	289,600	590,784.00	0.43
57	600704	物产中大	137,300	578,033.00	0.42
58	01233	时代中国控股	44,000	575,540.28	0.42
59	601117	中国化学	104,900	574,852.00	0.41
60	00123	越秀地产	426,000	536,993.11	0.39
61	600567	山鹰纸业	181,200	534,540.00	0.39
62	600039	四川路桥	138,500	529,070.00	0.38
63	000778	新兴铸管	147,200	504,896.00	0.36
64	06818	中国光大银行	187,000	497,066.64	0.36
65	600376	首开股份	84,100	492,826.00	0.36
66	03311	中国建筑国际	118,000	487,192.36	0.35
67	000932	华菱钢铁	125,140	471,777.80	0.34
68	002110	三钢闽光	69,900	465,534.00	0.34
69	000825	太钢不锈	138,900	461,148.00	0.33
70	03618	重庆农村商业银行	164,000	456,902.69	0.33
71	600782	新钢股份	111,100	453,288.00	0.33
72	03320	华润医药	110,500	451,179.99	0.33
73	00081	中国海外宏洋集团	113,000	451,065.81	0.33
74	002092	中泰化学	95,700	433,521.00	0.31
75	000983	西山煤电	110,630	414,862.50	0.30
76	02799	中国华融	571,000	406,827.91	0.29
77	01966	中骏集团控	131,000	402,059.75	0.29

		股			
78	01638	佳兆业集团	150,000	400,086.72	0.29
79	600466	蓝光发展	72,400	390,236.00	0.28
80	600808	马钢股份	144,000	371,520.00	0.27
81	01238	宝龙地产	93,000	368,682.65	0.27
82	01628	禹洲集团	119,000	364,142.86	0.26
83	000732	泰禾集团	68,600	349,174.00	0.25
84	002091	江苏国泰	56,600	342,430.00	0.25
85	01958	北京汽车	110,000	336,602.64	0.24
86	00338	上海石油化工股份	198,000	336,401.68	0.24
87	601717	郑煤机	56,700	333,963.00	0.24
88	600823	世茂股份	74,400	332,568.00	0.24
89	600500	中化国际	65,100	329,406.00	0.24
90	000933	神火股份	78,500	325,775.00	0.24
91	600970	中材国际	59,700	315,216.00	0.23
92	600348	阳泉煤业	70,700	298,354.00	0.22
93	600694	大商股份	11,900	285,481.00	0.21
94	000415	渤海租赁	94,700	282,206.00	0.20
95	02314	理文造纸	74,000	281,193.37	0.20
96	000898	鞍钢股份	109,100	267,295.00	0.19
97	600565	迪马股份	90,100	251,379.00	0.18
98	000717	韶钢松山	66,000	250,800.00	0.18
99	03301	融信中国	39,000	242,956.77	0.18

7.3.2 期末积极投资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

本报告期末未持有积极投资部分的股票投资。

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	00728	中国电信	2,801,231.33	1.76
2	601169	北京银行	2,047,311.00	1.29
3	000069	华侨城A	1,750,026.00	1.10
4	002024	苏宁易购	1,483,867.00	0.93
5	600104	上汽集团	1,352,171.62	0.85
6	00386	中国石油化工股份	1,191,470.10	0.75
7	00836	华润电力	1,118,974.84	0.70
8	002146	荣盛发展	1,045,814.00	0.66

9	03328	交通银行	1,032,283.65	0.65
10	01288	农业银行	1,018,040.11	0.64
11	601668	中国建筑	988,075.00	0.62
12	601669	中国电建	949,484.00	0.60
13	600019	宝钢股份	872,058.00	0.55
14	00902	华能国际电力股份	797,964.18	0.50
15	00552	中国通信服务	741,039.78	0.47
16	601117	中国化学	726,759.00	0.46
17	00939	建设银行	715,588.43	0.45
18	03988	中国银行	709,560.09	0.45
19	600820	隧道股份	590,549.00	0.37
20	00081	中国海外宏洋集团	546,676.74	0.34

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	600000	浦发银行	7,581,392.00	4.77
2	00267	中信股份	3,540,843.79	2.23
3	01658	邮储银行	1,889,310.66	1.19
4	00939	建设银行	1,030,878.04	0.65
5	00884	旭辉控股集团	843,589.15	0.53
6	03360	远东宏信	688,486.88	0.43
7	00958	华能新能源	660,368.98	0.42
8	03988	中国银行	635,521.74	0.40
9	00165	中国光大控股	576,637.06	0.36
10	03377	远洋集团	574,110.91	0.36
11	00606	中国粮油控股	525,529.09	0.33
12	03323	中国建材	471,879.93	0.30
13	600998	九州通	464,511.00	0.29
14	02600	中国铝业	432,896.30	0.27
15	01378	中国宏桥	394,547.52	0.25
16	00857	中国石油股份	391,191.43	0.25
17	000078	海王生物	389,945.00	0.25
18	01988	民生银行	380,732.19	0.24
19	01288	农业银行	351,971.79	0.22
20	01919	中远海控	343,171.55	0.22

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	36,854,240.97
卖出股票收入（成交）总额	30,389,226.87

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

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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金未投资股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金未投资国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金未投资国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

7.12 市场中性策略执行情况

无

7.13 投资组合报告附注

7.13.1

沪港深价值基金截至 2020 年 6 月 30 日持仓前十名证券中的北京银行（601169）于 2019 年 9 月 3 日和 2019 年 9 月 25 日收到中国银保监会北京监管局罚款处罚，由于公司存在：个人消费贷款被挪用于支付购房首付款或投资股权,个别个人商办用房贷款违反房地产调控政策,同业投资通过信托通道违规发放土地储备贷款；员工大额消费贷款违规行为长期未有效整改，同业业务专营部门制改革不到位，同业投资违规接受第三方金融机构信用担保。

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九名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

7.13.2

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.13.3 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	6,263.41
2	应收证券清算款	-

3	应收股利	1,310,164.91
4	应收利息	1,811.29
5	应收申购款	815,837.02
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,134,076.63

7.13.4 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。

7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.13.5.1 期末指数投资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。

7.13.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极投资。

7.13.6 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

份额级别	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（%）
华宝价值基金	12,919	12,447.02	-	0.00	160,803,010.56	100.00
华宝价	1,242	2,518.36	-	0.00	3,127,801.75	100.00

值基金 C						
合计	14,161	11,576.22	-	0.00	163,930,812.31	100.00

8.2 期末上市基金前十名持有人

华宝价值基金

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例（%）
1	叶秀华	1,793,415.00	4.32
2	慕永青	1,513,920.00	3.65
3	张积彬	1,405,702.00	3.39
4	冯银月	1,384,476.00	3.34
5	余旭娇	1,082,098.00	2.61
6	周军	929,881.00	2.24
7	王继翔	851,278.00	2.05
8	张光明	705,529.00	1.70
9	麦琼娣	601,640.00	1.45
10	王月东	550,373.00	1.33

注：上述持有人均为场内持有人。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	华宝价值基金	64,344.58	0.0400
	华宝价值基金 C	2,134.59	0.0682
	合计	66,479.17	0.0406

8.4 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	份额级别	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	华宝价值基金	0
	华宝价值基金 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	华宝价值基金	0
	华宝价值基金 C	0
	合计	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华宝价值基金	华宝价值基金 C
基金合同生效日（2018 年 10 月 25 日）基金份额总额	246,763,927.66	-
本报告期期初基金份额总额	156,452,245.14	1,166,683.31
本报告期基金总申购份额	58,204,971.32	4,078,528.44
减：本报告期基金总赎回份额	53,854,205.90	2,117,410.00
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	160,803,010.56	3,127,801.75

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、基金管理人的重大人事变动

2020 年 5 月 20 日，基金管理人发布高级管理人员变更公告，经公司董事会审议通过，聘任周雷为公司督察长。公司总经理黄小薏自 2020 年 5 月 20 日起不再代任督察长职务。

2、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内基金托管人未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金资产和基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未发生变更。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

基金管理人为本基金聘任的会计师事务所向本基金提供的审计服务持续期限为：2019 年 11 月 20 日至本报告期末。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、托管人及其高级管理人员未有受到稽查或处罚的情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信证券	2	36,060,487.67	54.04%	29,020.93	50.54%	-
天风证券	2	10,074,778.00	15.10%	9,382.61	16.34%	-
瑞银证券	1	7,211,247.12	10.81%	6,715.85	11.70%	-
招商证券	2	6,885,862.00	10.32%	6,274.93	10.93%	-
安信证券	1	1,181,157.00	1.77%	1,100.09	1.92%	-
信达证券	1	1,126,842.00	1.69%	1,049.41	1.83%	-
中投证券	1	959,816.00	1.44%	894.05	1.56%	-
华宝证券	1	827,498.00	1.24%	770.64	1.34%	-
长江证券	1	430,670.00	0.65%	401.22	0.70%	-

国泰君安	2	412,545.00	0.62%	382.82	0.67%	-
万联证券	1	310,692.00	0.47%	283.15	0.49%	-
华西证券	1	305,653.00	0.46%	278.53	0.49%	-
方正证券	2	214,827.00	0.32%	195.76	0.34%	-
中泰证券	2	179,256.00	0.27%	163.40	0.28%	-
东吴证券	1	169,573.00	0.25%	157.93	0.28%	-
东方证券	2	167,709.00	0.25%	156.20	0.27%	-
中信建投	2	114,385.00	0.17%	104.24	0.18%	-
兴业证券	2	92,588.00	0.14%	84.38	0.15%	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
广州证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
红塔证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华金证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
华信证券	1	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-

平安证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	3	-	-	-	-	-
申万宏源西部	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
中航证券	1	-	-	-	-	-
中金国际	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-

注：基金管理人选择交易单元的标准和程序如下：

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

（2）选择程序：（a）服务评价；（b）拟定备选交易单元；（c）签约。

2. 本基金本报告期券商交易单元新增:申万宏源。

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

本基金本报告期内未租用证券公司交易单元进行其它证券投资。

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	关于华宝基金管理有限公司旗下部分开放式基金 2020 年非港股通交易日暂停申购、赎回及定期定额投资业务的公告	上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报、基金管理人网站	2020-01-14
2	华宝标普沪港深中国增强价值指数证券投资基金（LOF）暂停申购、赎回及	证券时报、基金管理人网站	2020-01-17

	定期定额投资业务的公告		
3	华宝标普沪港深中国增强价值指数证券投资基金（LOF）2019年第4季度报告	基金管理人网站	2020-01-21
4	华宝基金管理有限公司旗下部分基金季度报告提示性公告	上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报、基金管理人网站	2020-01-21
5	华宝基金关于旗下部分开放式基金新增东方财富证券为代销机构的公告	上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报、基金管理人网站	2020-03-06
6	华宝基金管理有限公司关于旗下上海证券交易所上市基金增加扩位证券简称的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站	2020-03-14
7	华宝标普沪港深中国增强价值指数证券投资基金（LOF）2019年年度报告	基金管理人网站	2020-03-30
8	华宝基金管理有限公司旗下部分基金年度报告提示性公告	上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报、基金管理人网站	2020-03-30
9	华宝标普沪港深中国增强价值指数证券投资基金（LOF）暂停申购、赎回及定期定额投资业务的公告	证券时报、基金管理人网站	2020-03-30
10	华宝标普沪港深中国增强价值指数证券投资基金（LOF）暂停申购赎回及定期定额投资业务的公告	证券时报、基金管理人网站	2020-04-07
11	关于华宝现金宝货币基金E类份额转换、赎回转申购、定期转换、定期赎回转申购业务费率优惠公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站	2020-04-14
12	华宝基金旗下部分开放式证券投资基金新增安信证券为代销机构的公告	上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报、基金管理人网站	2020-04-20
13	华宝标普沪港深中国增强价值指数证券投资基金（LOF）2020年第1季度报告	基金管理人网站	2020-04-21
14	华宝标普沪港深中国增强价值指数证券投资基金（LOF）暂停申购、赎回及定期定额投资业务的公告	证券时报、基金管理人网站	2020-04-24
15	华宝基金关于旗下部分基金新增陆享基金公司为代销机构的公告	上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报、基金管理人网站	2020-05-18
16	华宝标普沪港深中国增强价值指数证券投资基金（LOF）招募说明书（更新）	基金管理人网站	2020-05-30
17	华宝标普沪港深中国增强价值指数证券投资基金（LOF）招募说明书（更新）摘要	基金管理人网站	2020-05-30

18	华宝标普沪港深中国增强价值指数证券投资基金（LOF）暂停申购赎回及定期定额投资业务的公告	证券时报、基金管理人网站	2020-06-19
19	华宝标普沪港深中国增强价值指数证券投资基金（LOF）暂停申购、赎回及定期定额投资业务的公告	证券时报、基金管理人网站	2020-06-29

§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

无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

基金管理人于 2020 年 3 月 14 日发布《华宝基金管理有限公司关于旗下上海证券交易所上市基金增加扩位证券简称的公告》具体内容详见公司公告，请投资者予以关注。

§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；

华宝标普沪港深中国增强价值指数证券投资基金(LOF)基金合同；

华宝标普沪港深中国增强价值指数证券投资基金(LOF)招募说明书；

华宝标普沪港深中国增强价值指数证券投资基金(LOF)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

2020 年 8 月 31 日