

华宝沪深 300 指数增强型发起式证券投资
基金
2020 年第 3 季度报告

2020 年 9 月 30 日

基金管理人：华宝基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：2020 年 10 月 28 日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 10 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2020 年 07 月 01 日起至 09 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	华宝沪深 300 增强
基金主代码	003876
基金运作方式	契约型开放式、发起式
基金合同生效日	2016 年 12 月 9 日
报告期末基金份额总额	331,628,010.45 份
投资目标	本基金为沪深 300 指数增强型基金，在实现对沪深 300 指数有效跟踪的基础上，通过数量化的方法进行积极的组合配置和管理，力争实现稳定的优于标的指数的投资收益，追求基金资产的长期增值。
投资策略	<p>本基金在复制标的指数的基础上通过数量化模型优化投资组合，力求在控制与业绩比较基准偏离度前提下获得超越标的指数的投资收益。</p> <p>1、资产配置策略</p> <p>本基金主要投资于沪深 300 指数成分股及备选股票。本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产的 80%，其中投资于沪深 300 指数</p>

成分股及备选成分股的比例不低于非现金基金资产的 80%。同时，基于流动性管理及策略性投资的需要，本基金也会在控制风险前提下适度投资于债券、股指期货、货币市场工具及其他金融工具。

2、股票投资策略

本基金主要采用量化行业配置模型和量化 Alpha 选股模型构建指数增强股票组合，在控制跟踪偏离度的前提下力争实现超额表现。

（1）量化行业配置模型

在跟踪偏离风险可控的前提下，结合行业景气度、投资时钟、行业动量和行业超跌偏离度等基本面和技术面模型，在标的指数行业权重的基础上进行优化。

（2）量化 Alpha 选股模型

本基金采用的是基金管理人量化团队经过对中国证券市场运行特征的长期研究和检验后自主开发的量化 Alpha 选股模型。该模型主要选取估值、成长、盈利质量、市场预期等基本面因子以及股权激励、并购、重要股东投资行为、业绩超预期等事件驱动因子，通过实证分析确定各因子的权重，对股票池中的股票进行综合打分后，构建股票投资组合。在此基础上，本基金进一步根据个股价格波动、风险收益变化、特殊事件等实际情况，对行业内的个股权重进行动态调整，以保证股票组合的跟踪误差处于可控范围内。股票池包括标的指数的成分股及备选股、预计指数定期调整中即将被调入的股票、非成分股中流动性良好、基本面优质及与成分股相关度高的股票。

（3）投资组合调整与风险控制

本基金将定期调整投资组合，并会对标的指数成分股保持密切跟踪。在出现因增发、送配、长期停牌后复牌等对成分股在标的指数中权重有影响的情况，或者成分股临时调入调出、成分股出现黑天鹅事件等情况时，本基金将及时对投资组合进行调整。

本基金将通过风险评估模型控制投资组合的跟踪偏离风险。本基金主要采用“跟踪误差”和“跟踪偏离度”这两个指标对投资组合进行监控与评估。

本基金的风险控制目标为力争使基金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 7.75%。

(4) 模型的动态调整

基金管理人量化团队会根据市场变化趋势，定期对量化模型进行动态调整，不断改进量化模型的有效性。

3、股指期货投资策略

基金管理人可运用股指期货提高投资效率，以更好地实现本基金的投资目标，降低跟踪误差。此外，在预期大额申购赎回、大额分红等情形发生时，本基金可以通过股指期货进行有效的现金头寸管理。本基金参与股指期货交易时，将根据风险管理的原则，在风险可控的前提下，选择流动性好、交易活跃的期货合约进行投资。

4、固定收益类投资策略

本基金基于流动性管理及策略性投资的需要，可投资于债券、货币市场工具和资产支持证券等固定收益类品种，以保证基金资产流动性，有效利用基金资产，提高基金资产的投资收益。

5、资产支持证券投资策略

在严格控制投资风险的前提下，本基金将从信用风险、流动性风险、利率风险、税收因素和提前还款因素等方面综合评估资产支持证券的投资品种，选择低估的品种进行投资。

6、其他金融工具投资策略

在法律法规许可的前提下，本基金可基于谨慎原则运用权证等相关金融衍生工具对基金投资组合进行管理，以期更好地实现本基金的投资目标。

未来如法律法规或监管机构以后允许基金投资于其他金融产品，基金管理人将根据监管机构的规定及本基金的投资目标，制定与本基金相适应的投资策略、比例限制、信息披露方式等。

7、融资及转融通证券出借业务投资策略

本基金将在法律法规允许的范围和比例内，以及风险可控的前提下，基于谨慎原则参与融资和转融通证券出借业务。

业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*95%+1.5% (指年收益率, 评价时按期间折算)。	
风险收益特征	本基金为股票型基金, 属于高预期风险、高预期收益的证券投资基金品种, 其预期风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。	
基金管理人	华宝基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	华宝沪深 300 增强	华宝沪深 300 增强 C
下属分级基金的交易代码	003876	007404
报告期末下属分级基金的份额总额	266,507,902.15 份	65,120,108.30 份

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位: 人民币元

主要财务指标	报告期 (2020 年 7 月 1 日-2020 年 9 月 30 日)	
	华宝沪深 300 增强	华宝沪深 300 增强 C
1. 本期已实现收益	63,979,932.88	9,601,086.34
2. 本期利润	68,263,597.89	4,708,307.19
3. 加权平均基金份额本期利润	0.2727	0.1108
4. 期末基金资产净值	497,338,085.99	120,915,548.51
5. 期末基金份额净值	1.8661	1.8568

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. 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. C 类份额的实际起始日为 2019 年 5 月 27 日。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

华宝沪深 300 增强

阶段	净值增长率①	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
过去三个月	15.76%	1.52%	10.09%	1.54%	5.67%	-0.02%
过去六个月	37.08%	1.26%	24.08%	1.26%	13.00%	0.00%
过去一年	38.01%	1.34%	21.09%	1.32%	16.92%	0.02%
过去三年	54.02%	1.31%	24.31%	1.27%	29.71%	0.04%
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	86.61%	1.19%	38.43%	1.15%	48.18%	0.04%

华宝沪深 300 增强 C

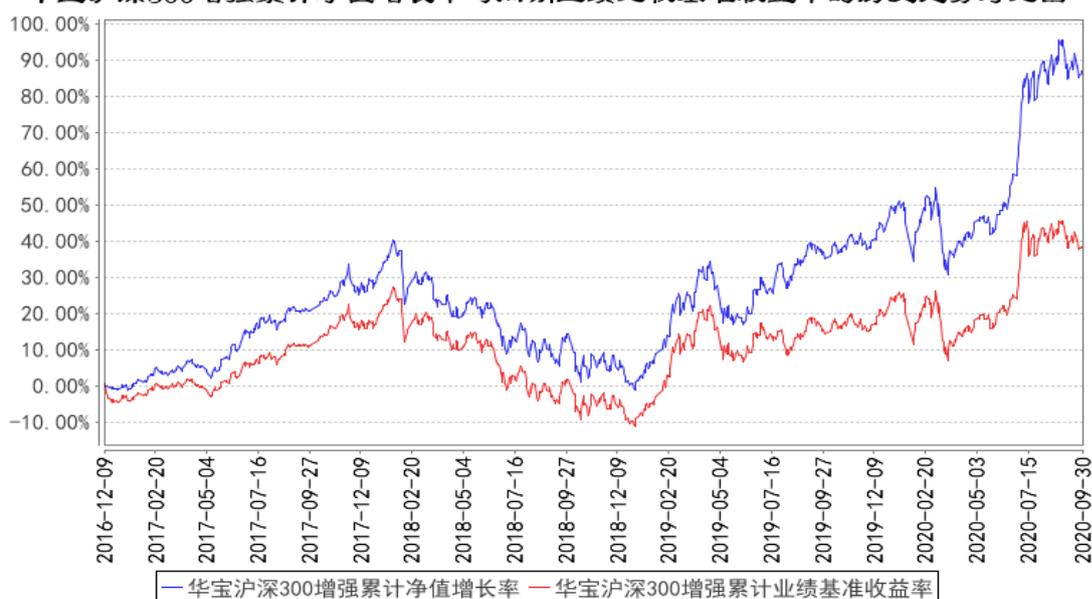
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	15.65%	1.52%	10.09%	1.54%	5.56%	-0.02%
过去六个月	36.82%	1.26%	24.08%	1.26%	12.74%	0.00%
过去一年	37.48%	1.34%	21.09%	1.32%	16.39%	0.02%
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	57.88%	1.26%	28.84%	1.23%	29.04%	0.03%

注：1、本基金业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率*95%+1.5%（指年收益率，评价时按期间折算）。

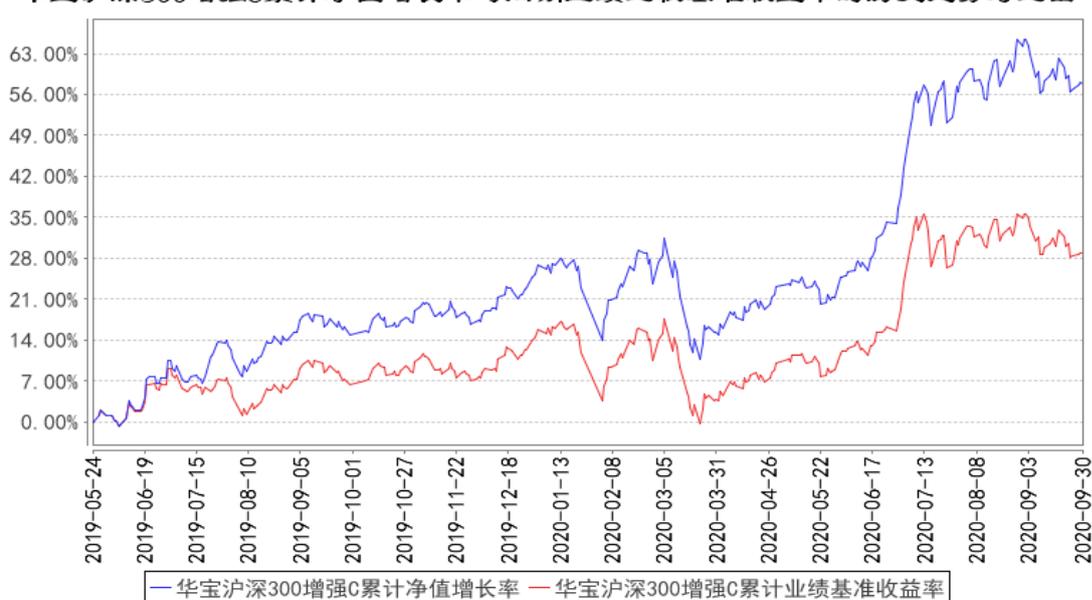
2、净值以及比较基准相关数据计算中涉及天数的，包括所有交易日以及季末最后一自然日（如非交易日）。

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

华宝沪深300增强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



华宝沪深300增强C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：按照基金合同的约定，自基金成立日期的6个月内达到规定的资产组合，截至2017年6月9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 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
徐林明	量化投资部总经理	2016年12月9日	-	18年	硕士。曾在兴业证券、凯龙财经（上海）有限公司、中原证券从事金融工程研究工

	(投资副 总监)、本 基金基金 经理、华 宝量化对 冲混合、 华宝科技 先锋混合 基金经理				作。2005 年 8 月加入华宝基金管理有限 公司，先后担任金融工程部数量分析师、 金融工程部副总经理等职务，现任量化投 资部总经理（投资副总监总监）。2009 年 9 月至 2015 年 11 月任华宝中证 100 指 数型证券投资基金基金经理。2010 年 4 月 至 2015 年 11 月任上证 180 价值交易型开 放式指数证券投资基金、华宝上证 180 价值交易型开放式指数证券投资基金联 接基金基金经理。2014 年 9 月起任华宝 量化对冲策略混合型发起式证券投资基 金基金经理。2015 年 4 月至 2020 年 2 月 任华宝事件驱动混合型证券投资基金基 金经理。2016 年 12 月起任华宝沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金基金经 理。2019 年 2 月起任华宝科技先锋混 合型证券投资基金基金经理。
王正	本基金基 金经理、 华宝量化 对冲混合 基金经理	2020 年 1 月 2 日	-	7 年	硕士。2012 年 7 月加入华宝基金管理有 限公司，先后担任助理量化分析师、分 析师、基金经理助理等职务。2020 年 1 月 起任华宝量化对冲策略混合型发起式证 券投资基金、华宝沪深 300 指数增强型发 起式证券投资基金基金经理。

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。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期内，本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《华宝沪深 300 指数增强型发起式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 公平交易专项说明

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 报告期内基金的投资策略和运作分析

宏观环境来看，三季度随着全球基本面的缓慢复苏以及新冠肺炎疫情对国内经济增长的影响减弱，中国经济在内外需双驱动之下趋于回升，尤其是消费和基建投资出现加速，制造业与服务行业数据双双改善，这将有利于推动上市公司业绩正增长。而海外中美贸易摩擦的影响延续，美国大选不确定性、美股高波动等外部因素扰动仍是短期 A 股市场主要波动和不确定性的来源。市场方面，三季度权益市场先扬后抑，A 股在 7 月初经历了风险偏好的快速集中修复，随后维持横盘震荡，风格分化有所加大。受外部不确定性因素的影响，年初以来相对强势的成长风格在三季度有所抑制，而休闲服务、汽车、食品饮料等部分消费行业以及化工、建材等部分低估值顺周期板块表现相对偏强，价值因子阶段性弱复苏，反转、低波动和低换手因子表现较好。但市场仍然重视业绩的持续性和确定性，盈利能力与景气延续性仍然是判断股票投资价值的重要方向。

沪深 300 增强基金运用量化 Alpha 多因子选股模型和行业配置模型进行股票筛选和权重配置，在沪深 300 成分股及备选股内精选业绩和估值相匹配、基本面优质的股票，在跟踪沪深 300 指数的基础上力争实现稳定的超越指数的表现。本报告期因子表现出现了一定的扰动，但后期有所恢复，基金严格跟踪市场风格的变化，相对基准指数取得了小幅超额收益。另外，基金通过积极参与新股申购等低风险机会来增厚业绩。

4.5 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 15.76%；本报告期基金份额净值增长率为 15.65%；同期业绩比较基准收益率为 10.09%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	542,531,576.85	87.09
	其中：股票	542,531,576.85	87.09
2	基金投资	0.00	0.00
3	固定收益投资	14,952,231.20	2.40
	其中：债券	14,952,231.20	2.40
	资产支持证券	0.00	0.00
4	贵金属投资	0.00	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	0.00	0.00
	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	58,141,508.53	9.33
8	其他资产	7,352,528.25	1.18
9	合计	622,977,844.83	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 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	2,450,140.00	0.40
B	采矿业	12,972,408.00	2.10
C	制造业	234,979,560.09	38.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,446,810.00	1.04
E	建筑业	4,020,312.00	0.65
F	批发和零售业	3,164,298.00	0.51

G	交通运输、仓储和邮政业	15,155,818.00	2.45
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	20,335,519.85	3.29
J	金融业	155,437,713.74	25.14
K	房地产业	20,100,254.00	3.25
L	租赁和商务服务业	6,130,850.00	0.99
M	科学研究和技术服务业	5,978,350.00	0.97
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	4,200,360.00	0.68
R	文化、体育和娱乐业	4,633,020.00	0.75
S	综合	-	-
	合计	496,005,413.68	80.23

5.2.2 报告期末积极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	-	-
C	制造业	35,363,417.77	5.72
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	3,220,568.12	0.52
F	批发和零售业	28,264.03	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	18,653.36	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	55,709.13	0.01
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	2,661,492.00	0.43
M	科学研究和技术服务业	2,780,863.40	0.45
N	水利、环境和公共设施管理业	15,348.36	0.00
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	2,381,847.00	0.39
S	综合	-	-
	合计	46,526,163.17	7.53

5.2.3 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。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

5.3.1 报告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前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	19,500	32,535,750.00	5.26
2	601318	中国平安	313,470	23,905,222.20	3.87
3	000858	五粮液	87,761	19,395,181.00	3.14
4	600036	招商银行	489,301	17,614,836.00	2.85
5	600030	中信证券	525,600	15,783,768.00	2.55
6	601012	隆基股份	196,000	14,701,960.00	2.38
7	000333	美的集团	195,400	14,186,040.00	2.29
8	600276	恒瑞医药	135,781	12,195,849.42	1.97
9	002475	立讯精密	205,260	11,726,503.80	1.90
10	601166	兴业银行	720,000	11,613,600.00	1.88

5.3.2 报告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前五名股票投资明细

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	300760	迈瑞医疗	11,500	4,002,000.00	0.65
2	000932	华菱钢铁	717,800	3,617,712.00	0.59
3	002081	金螳螂	331,700	3,207,539.00	0.52
4	601966	玲珑轮胎	101,800	2,972,560.00	0.48
5	603018	中设集团	225,800	2,766,050.00	0.45

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	14,485,500.00	2.34
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	466,731.20	0.08
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	14,952,231.20	2.42

5.5 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债券投资明细

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	019627	20 国债 01	145,000	14,485,500.00	2.34
2	113038	隆 20 转债	3,040	466,731.20	0.08

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资 明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
IF2011	IF2011	6	8,151,840.00	-94,440.00	-
IF2012	IF2012	23	31,083,120.00	-326,340.00	-
公允价值变动总额合计（元）					-420,780.00
股指期货投资本期收益（元）					3,330,349.52
股指期货投资本期公允价值变动（元）					-1,275,300.00

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金主要利用股指期货提高投资效率，以更好地实现本基金的投资目标，降低跟踪误差。此外，在预期大额申购赎回、大额分红等情形发生时，本基金可以通过股指期货进行有效的现金头寸管理。

本基金投资于股指期货，对基金总体风险的影响很小，并符合既定的投资政策和投资目标。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金未投资国债期货。

5.10.2 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。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

沪深 300 增强基金截至 2020 年 9 月 30 日持仓前十名证券中的中信证券（600030）作为债务融资工具主承销商，在部分债务融资工具选聘主承销商的投标过程中，中标承销费率远低于市场正常水平，预估承销费收入远低于其业务开展平均成本，于 2020 年 5 月 15 日收到中国银行间市场交易商协会警告处分，责令其针对本次事件中暴露出的问题进行全面深入的整改。

本基金管理人通过对上述上市公司进行进一步了解和视为，认为上述处分不会对公司的投资价值构成实质性影响，因此本基金管理人对上述证券的投资判断未发生改变。报告期内，本基金投资的前十名证券的其余九名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.11.2

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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	5,241,458.28
2	应收证券清算款	693,745.40
3	应收股利	-
4	应收利息	254,253.30

5	应收申购款	1,163,071.27
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,352,528.25

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

5.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华宝沪深 300 增强	华宝沪深 300 增强 C
报告期期初基金份额总额	268,721,956.94	11,594,486.79
报告期期间基金总申购份额	106,653,288.54	91,300,084.62
减：报告期期间基金总赎回份额	108,867,343.33	37,774,463.11
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	266,507,902.15	65,120,108.30

注：总申购份额含转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

项目	华宝沪深 300 增强	华宝沪深 300 增强 C
报告期期初管理人持有的本基金份额	10,479,245.17	-
报告期期间买入/申购总份额	-	-
报告期期间卖出/赎回总份额	10,000,450.05	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	478,795.12	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.18	-

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率(%)
1	赎回	2020年8月21日	10,000,450.05	18,591,836.69	0.00
合计			10,000,450.05	18,591,836.69	

注：交易日期为确认日期，交易金额为确认金额。适用费率与招募说明书规定一致。

§ 8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例(%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例(%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	-	-	10,000,450.05	3.02	不少于三年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	-	-	10,000,450.05	3.02	-

注：1、本基金募集期间，本基金管理人运用固有资金作为发起资金总计 10,001,000.00 元认购了本基金。发起资金认购的基金份额自基金合同生效之日起持有期不少于 3 年；

2、本基金管理人运用固有资金于 2016 年 12 月 6 日通过本公司直销柜台认购本基金作为发起资金的认购费用为 1,000 元，符合基金合同和招募说明书等法律文件的约定；

3、发起份额已满足承诺持有期限，管理人于 2020 年 8 月 21 日赎回 10,000,450.05 份。

§ 9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

- 1、2020 年 9 月 4 日，基金管理人发布高级管理人员变更公告，聘任李孟恒为公司首席信息官。
- 2、2020 年 9 月 23 日，基金管理人发布高级管理人员变更公告，朱永红担任公司董事长，孔祥清不再担任公司董事长。

§ 10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

中国证监会批准基金设立的文件；
华宝沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金基金合同；
华宝沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金招募说明书；
华宝沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金托管协议；
基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
基金管理人报告期内在指定报刊上披露的各种公告；
基金托管人业务资格批件和营业执照。

10.2 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。

10.3 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 10 月 28 日