

华宝中证 500 指数增强型发起式证券投资
基金
2020 年第 4 季度报告

2020 年 12 月 31 日

基金管理人：华宝基金管理有限公司

基金托管人：中国民生银行股份有限公司

报告送出日期：2021 年 1 月 22 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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 01 月 20 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 10 月 01 日起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	华宝中证 500 增强
基金主代码	005607
基金运作方式	契约型开放式、发起式
基金合同生效日	2018 年 4 月 19 日
报告期末基金份额总额	40,863,628.91 份
投资目标	本基金为中证 500 指数增强型基金，在实现对中证 500 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，力争实现超越标的指数的投资收益。
投资策略	本基金主要投资于中证 500 指数成分股及备选股票，也会根据中证 500 股指期货的基差情况择机部分使用期货替代现货，降低成本。视市场情况本基金也会谨慎地参与一些绝对收益策略。同时，本基金将预留必要的现金，应对期货保证金的增加要求或投资者的赎回申请。 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，并根据市场变化趋势，定期对模型进行调整，以改进模型的有效性。	
业绩比较基准	中证 500 指数收益率*95%+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	中国民生银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	华宝中证 500 增强 A	华宝中证 500 增强 C
下属分级基金的交易代码	005607	005608
报告期末下属分级基金的份额总额	27,178,518.05 份	13,685,110.86 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 10 月 1 日-2020 年 12 月 31 日）	
	华宝中证 500 增强 A	华宝中证 500 增强 C
1. 本期已实现收益	580,794.67	304,177.38
2. 本期利润	1,116,784.40	676,589.53
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0443	0.0502
4. 期末基金资产净值	33,408,626.67	16,641,564.44
5. 期末基金份额净值	1.2292	1.2160

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。

3.2 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

华宝中证 500 增强 A

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	4.17%	1.06%	2.70%	1.10%	1.47%	-0.04%
过去六个月	12.49%	1.35%	8.20%	1.38%	4.29%	-0.03%
过去一年	29.59%	1.50%	19.94%	1.54%	9.65%	-0.04%
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	22.92%	1.41%	6.76%	1.47%	16.16%	-0.06%

华宝中证 500 增强 C

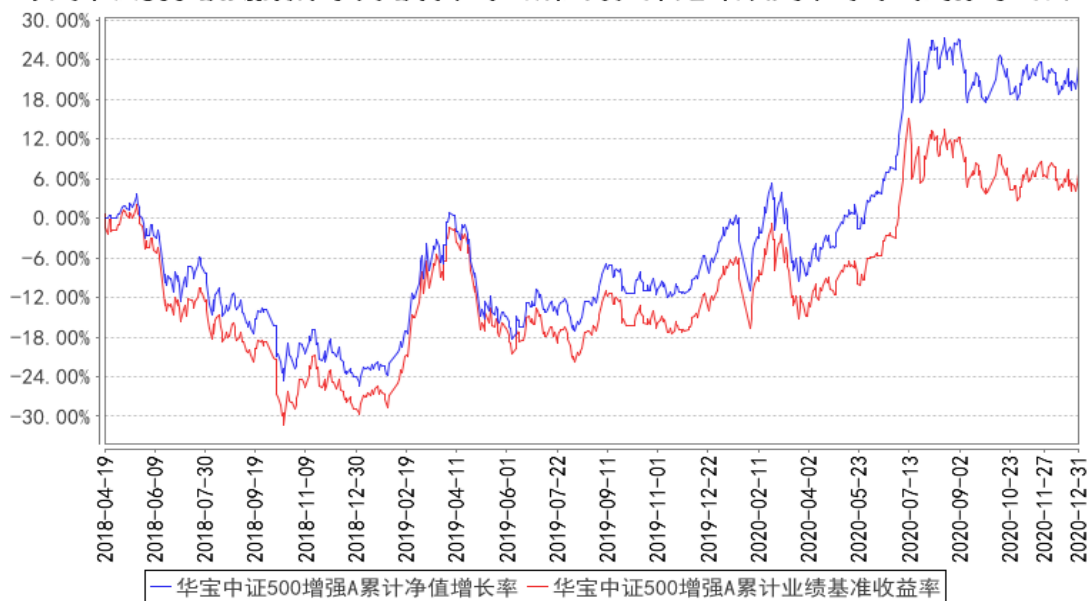
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	4.07%	1.06%	2.70%	1.10%	1.37%	-0.04%
过去六个月	12.26%	1.35%	8.20%	1.38%	4.06%	-0.03%
过去一年	29.09%	1.50%	19.94%	1.54%	9.15%	-0.04%
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	21.60%	1.41%	6.76%	1.47%	14.84%	-0.06%

注：1、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）。

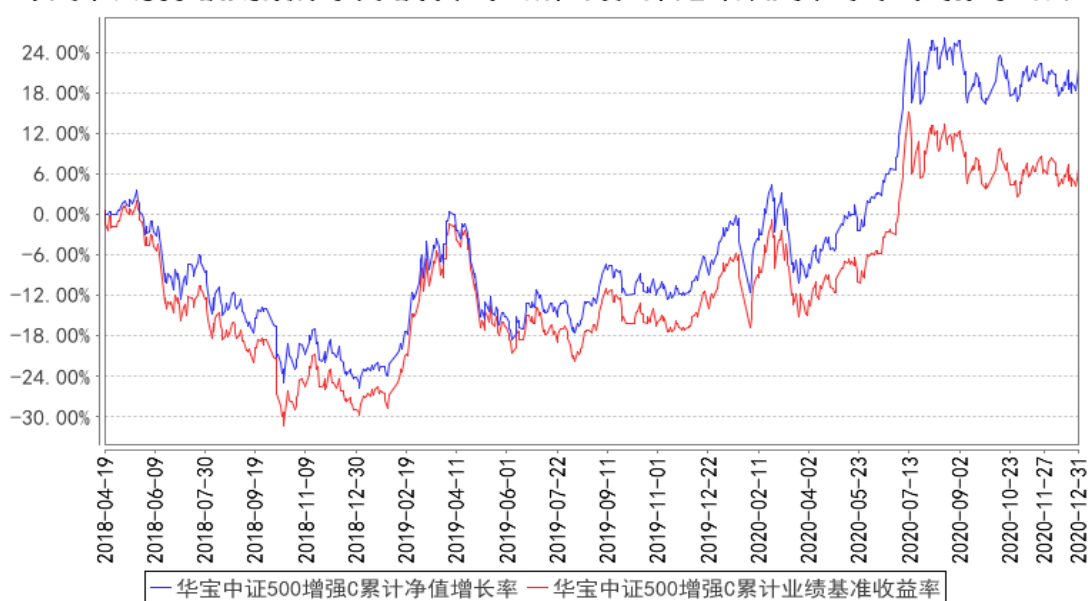
2、本基金业绩比较基准为：中证 500 指数收益率*95%+银行活期存款利率（税后）*5%。

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

华宝中证500增强A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



华宝中证500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2018年10月19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		

丰晨成	本基金基金经理、上证 180 价值 ETF、华宝上证 180 价值 ETF 联接、华宝中证全指证券公司 ETF、华宝券商 ETF 联接、华宝中证 1000 指数基金经理	2018 年 4 月 19 日	-	11 年	硕士。2009 年加入华宝基金管理有限公司,先后担任助理产品经理、数量分析师、投资经理助理、投资经理等职务,现任指数研发投资部基金经理。2015 年 11 月起任上证 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。2016 年 8 月起任华宝中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2018 年 4 月至 2021 年 1 月任华宝中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金经理。2018 年 6 月起任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。2018 年 8 月至 2020 年 11 月任华宝中证 1000 指数分级证券投资基金基金经理。2020 年 11 月起任华宝中证 1000 指数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。

3、丰晨成于 2021 年 1 月 4 日不再担任本基金基金经理，王正于 2021 年 1 月 4 日聘任为本基金基金经理，管理人已就此事项发布公告。

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遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《华宝中证 500 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

资产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，四季度国内经济持续复苏，宏观经济数据出现较强改善，这将有利于推动上市公司业绩修复和增长。而海外疫情仍未得到有效遏制，不过随着疫苗的推出，疫情对全球经济的影响必将逐步弱化，全球经济共振复苏的预期提升。但中美关系的紧张、全球流动性泛滥造成的通胀压力等外部不确定因素预计仍将给 A 股市场带来一定的扰动。市场方面，四季度 A 股整体震荡上行，特别是进入 12 月以后，市场在内外情绪共振的影响下强势上涨。一方面是由于海外充裕的流动性及中国优质资产的吸引力使得资金加速流向新兴市场，另一方面国内货币政策“不急转向”的稳健操作使得市场对政策风险的担心得到缓解，再加上资本市场一系列的优化改革措施如退市制度的完善等多重因素共同催化。但从中微观来看，市场上行的同时对应了行业和细分板块较为严重的分化，结构性行情较为极致，行业层面景气度较高的新能源板块及消费板块表现较强，而基建及 TMT 等偏弱；风格层面，龙头质优股票进一步获得资金认可，小市值风格持续大幅回撤。业绩的成长性、持续性和确定性是市场非常看重的要素，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。

中证 500 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，在中证 500 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，在跟踪中证 500 指数的基础上力争实现稳定的超越指数的表现。本报告期内 11 月因子表现出现了一定的反转，但进入 12 月又有所恢复，基金紧密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 A 净值增长率为 4.17%；本报告期基金份额 C 净值增长率为 4.07%；同期业绩比较基准收益率为 2.70%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金为发起式基金，基金合同于 2018 年 4 月 19 日生效，基金管理人于 2018 年 4 月 17 日运用固有资金作为发起资金认购本基金，且承诺持有期限自本基金合同生效之日起不少于 3 年。

根据本基金基金合同的规定：基金合同生效日起三年后的对应日，若基金资产规模低于 2 亿元，本基金应当按照基金合同约定的程序进行清算并终止，且不得通过召开基金份额持有人大会的方式延续。基金合同生效三年后继续存续的，基金存续期内，连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 60 个工作日出现前述情形之一的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。

截止 2020 年 12 月 31 日，本基金基金合同生效未满三年，基金管理人暂无需对基金持有人数或基金资产净值进行预警说明。

§ 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	47,263,455.46	92.74
	其中：股票	47,263,455.46	92.74
2	基金投资	0.00	0.00
3	固定收益投资	0.00	0.00
	其中：债券	0.00	0.00
	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	3,396,701.90	6.66
8	其他资产	303,409.95	0.60
9	合计	50,963,567.31	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	232,925.00	0.47
B	采矿业	1,505,470.00	3.01
C	制造业	25,215,998.73	50.38
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	962,594.00	1.92
E	建筑业	486,787.00	0.97
F	批发和零售业	909,253.00	1.82
G	交通运输、仓储和邮政业	682,653.00	1.36
H	住宿和餐饮业	163,686.00	0.33
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,110,845.60	6.22
J	金融业	2,484,339.00	4.96
K	房地产业	1,119,144.00	2.24
L	租赁和商务服务业	815,372.00	1.63
M	科学研究和技术服务业	418,761.00	0.84
N	水利、环境和公共设施管理业	478,454.00	0.96
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	38,720.00	0.08
Q	卫生和社会工作	281,864.00	0.56
R	文化、体育和娱乐业	245,100.00	0.49
S	综合	117,468.00	0.23
	合计	39,269,434.33	78.46

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	535,548.00	1.07
C	制造业	5,586,283.15	11.16
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	86,592.00	0.17
E	建筑业	157,595.00	0.31
F	批发和零售业	90,886.00	0.18
G	交通运输、仓储和邮政业	158,080.00	0.32
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	373,983.38	0.75
J	金融业	318,942.60	0.64
K	房地产业	185,112.00	0.37
L	租赁和商务服务业	286,906.00	0.57

M	科学研究和技术服务业	45,911.00	0.09
N	水利、环境和公共设施管理业	57,063.00	0.11
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	111,119.00	0.22
S	综合	-	-
	合计	7,994,021.13	15.97

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	300274	阳光电源	7,900	571,012.00	1.14
2	000547	航天发展	17,600	484,000.00	0.97
3	300496	中科创达	3,700	432,900.00	0.86
4	600143	金发科技	25,100	430,214.00	0.86
5	300012	华测检测	15,300	418,761.00	0.84
6	002385	大北农	43,200	417,312.00	0.83
7	600739	辽宁成大	15,700	381,824.00	0.76
8	601799	星宇股份	1,900	380,950.00	0.76
9	002920	德赛西威	4,400	370,216.00	0.74
10	300285	国瓷材料	7,900	356,369.00	0.71

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	000799	酒鬼酒	1,400	219,100.00	0.44
2	601012	隆基股份	2,000	184,400.00	0.37
3	002179	中航光电	2,300	180,067.00	0.36
4	300253	卫宁健康	10,190	178,325.00	0.36
5	600583	海油工程	38,000	170,620.00	0.34

5.4 报告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投资。

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

本基金本报告期末未持有债券投资。

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

本基金本报告期末未投资股指期货。

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

中证 500 指数增强基金截至 2020 年 12 月 31 日持仓前十名证券中的金发科技（600143）于 2020 年 9 月 24 日收到广东证监局出具警示函的监管措施。由于公司存在以下信息披露违规行为：2020 年 5 月 18 日，金发科技发布《关于子公司签订特别重大合同的公告》，披露子公司广东金发科技有限公司（以下简称广东金发）于 5 月 16 日收到美国某公司（以下简称买方）关于 KN95 口罩的采购订单，订购金额 9.75 亿美元，双方签订了《货物买卖合同》，在合同期限内，广东金发将根据合同约定向买方出售 KN95 口罩。金发科技后续披露，买方未按照约定支付采购订单金额 40% 的前期款项。核查发现，7 月 10 日至 11 日，买方向金发科技发来电子邮件，表示要取消 9.75 亿美元的 KN95 口罩订单，后续金发科技多次尝试与买方沟通是否继续履约，但买方一直未予回复。这一重大合同进展披露不及时、风险揭示不充分。8 月 10 日，金发科技发布《关于子公司特别重大合同终止的公告》，披露该合同订单终止。金发科技在知悉买方拟取消重大合同订单的情况下，未及时履行重大合同进展信息披露义务，未及时充分揭示相关风险，其行为违反了《上市公司信息披露管理办法》第二条、第三十二条的相关规定。袁志敏作为金发科技董事长、宁凯军作为董事会秘书，未按照《上市公司信息披露管理办法》第三条的规定履行勤勉尽责义务，对公司上述违规行为负有主要责任。

本基金管理人通过对上述上市公司进行进一步了解和他分析，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。

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	19,979.89
2	应收证券清算款	184,742.61
3	应收股利	-
4	应收利息	457.23
5	应收申购款	98,230.22
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	303,409.95

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的说明。

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	华宝中证 500 增强 A	华宝中证 500 增强 C
报告期期初基金份额总额	20,610,291.26	12,390,088.86

报告期期间基金总申购份额	9,658,242.52	6,821,049.23
减:报告期期间基金总赎回份额	3,090,015.73	5,526,027.23
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	27,178,518.05	13,685,110.86

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	华宝中证 500 增强 A	华宝中证 500 增强 C
报告期期初管理人持有的本基金份额	10,000,450.05	-
报告期期间买入/申购总份额	-	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	10,000,450.05	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	36.80	-

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§ 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	24.47	10,000,450.05	24.47	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	24.47	10,000,450.05	24.47	-

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 2018 年 4 月 16 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。

§ 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

投资者类别	序号	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况	
		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	20201001-20201231	10,000,450.05	0.00	0.00	10,000,450.05	24.47
	2	20201228-20201229, 20201231-20201231	0.00	8,229,629.62	0.00	8,229,629.62	20.14
产品特有风险							
报告期内本基金出现单一投资者持有基金份额比例超过 20%的情况。在单一投资者持有基金份额比例较高的情况下，如该投资者集中赎回，可能会增加基金的流动性风险。此外，由于基金在遇到大额赎回的时候可能需要变现部分资产，可能对持有资产的价格形成冲击，增加基金的市场风险。基金管理人将专业审慎、勤勉尽责地运作基金资产，加强防范流动性风险、市场风险，保护持有人利益。							

注：无

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

2020 年 12 月 1 日，基金管理人发布法定代表人变更公告， 法定代表人变更为 XIAOYI HELEN HUANG（黄小蕙）。

2020 年 12 月 21 日，基金管理人发布高级管理人员变更公告，聘任刘欣为公司常务副总经理。基金管理人于 2020 年 11 月 13 日发布《华宝基金管理有限公司关于修订旗下部分公募基金基金合同的公告》，公司根据《中华人民共和国证券法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《存托凭证发行与交易管理办法（试行）》，对旗下部分基金基金合同有关条款进行修订并相应修订了托管协议，具体修订内容详见公司公告，请投资者予以关注。

§ 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；

华宝中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金合同；
华宝中证 500 指数增强型发起式证券投资基金招募说明书；
华宝中证 500 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住所备投资者查阅。

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

2021 年 1 月 22 日