

华宝中证 500 指数增强型发起式证券投资
基金
2023 年中期报告

2023 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：中国民生银行股份有限公司

送出日期：2023 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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 08 月 29 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。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 01 月 01 日起至 2023 年 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	11
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 净资产（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	35
7.1 期末基金资产组合情况	35
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	35
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	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	45
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	47
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	47

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	47
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	47
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	47
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	47
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	47
7.12 投资组合报告附注	47
§ 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	49
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	49
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	49
§ 9 开放式基金份额变动	50
§ 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	51
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	51
10.8 其他重大事件	51
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	52
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	52
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	53
§ 12 备查文件目录	53
12.1 备查文件目录	53
12.2 存放地点	53
12.3 查阅方式	53

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华宝中证 500 指数增强型发起式证券投资基金	
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	
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	
报告期末基金份 额总额	40,813,448.44 份	
基金合同存续期	不定期	
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	21,281,897.57 份	19,531,550.87 份

2.2 基金产品说明

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，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。

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	中国民生银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	周雷
	联系电话	021-38505888
	电子邮箱	xxpl@fsfund.com
客户服务电话	400-700-5588、400-820-5050	95568

传真	021-38505777	010-57093382
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	北京市西城区复兴门内大街 2 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	北京市西城区复兴门内大街 2 号
邮政编码	200120	100031
法定代表人	黄孔威	高迎欣

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)	
	华宝中证 500 增强 A	华宝中证 500 增强 C
本期已实现收益	532,037.72	447,456.71
本期利润	998,669.48	832,178.48
加权平均基金份额本期利润	0.0462	0.0410
本期加权平均净值利润率	3.98%	3.60%
本期基金份额净值增长率	4.23%	4.02%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	3,049,201.77	2,338,541.82

期末可供分配基金份额利润	0.1433	0.1197
期末基金资产净值	24,331,099.34	21,870,092.69
期末基金份额净值	1.1433	1.1197
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	14.33%	11.97%

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

2. 所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3. 净值相关数据计算中涉及天数的，包括所有交易日以及季末最后一自然日（如非交易日）。

4. 期末可供分配利润采用资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华宝中证 500 增强 A

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	1.10%	0.83%	-0.77%	0.89%	1.87%	-0.06%
过去三个月	-3.72%	0.75%	-5.10%	0.78%	1.38%	-0.03%
过去六个月	4.23%	0.71%	2.20%	0.75%	2.03%	-0.04%
过去一年	-6.17%	0.89%	-6.65%	0.91%	0.48%	-0.02%
过去三年	4.63%	1.13%	2.48%	1.13%	2.15%	0.00%
自基金合同生效起至今	14.33%	1.26%	1.11%	1.29%	13.22%	-0.03%

华宝中证 500 增强 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	1.06%	0.83%	-0.77%	0.89%	1.83%	-0.06%

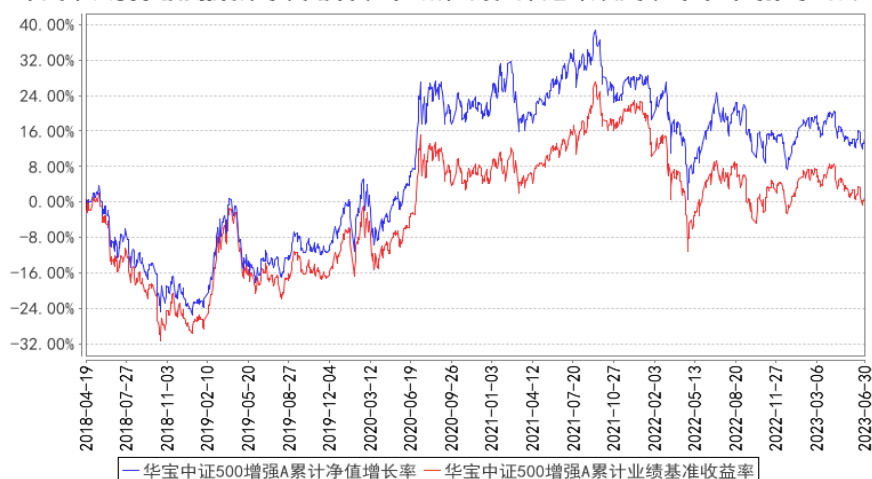
过去三个月	-3.82%	0.75%	-5.10%	0.78%	1.28%	-0.03%
过去六个月	4.02%	0.71%	2.20%	0.75%	1.82%	-0.04%
过去一年	-6.55%	0.89%	-6.65%	0.91%	0.10%	-0.02%
过去三年	3.37%	1.13%	2.48%	1.13%	0.89%	0.00%
自基金合同生效起 至今	11.97%	1.26%	1.11%	1.29%	10.86%	-0.03%

注：（1）基金业绩基准：中证 500 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%；

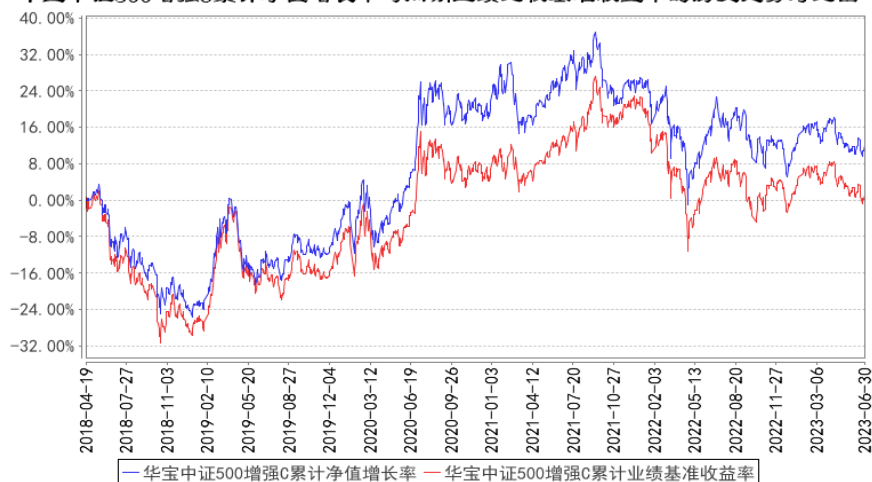
（2）净值以及比较基准相关数据计算中涉及天数的，包括所有交易日以及季末最后一自然日（如非交易日）。

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

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，基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定，截至 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 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

华宝基金管理有限公司（公司原名“华宝兴业基金管理有限公司”）于 2003 年 2 月 12 日经中国证监会批准设立，2003 年 3 月 7 日在国家工商总局注册登记并正式开业，是国内首批中外合资基金管理公司。成立之初，公司注册资本为 1 亿元人民币，2007 年经中国证监会批准，公司注册资本增加至 1.5 亿元人民币。2017 年公司名称变更为“华宝基金管理有限公司”。目前公司股东为华宝信托有限责任公司、美国华平资产管理有限合伙（Warburg Pincus Asset Management, L.P.）和江苏省铁路集团有限公司，持有股权占比分别为 51%、29%、20%。公司在北京和深圳设有分公司，在香港设有子公司——华宝资产管理(香港)有限公司。截至本报告期末（2023 年 06 月 30 日），本公司正在管理运作的公开募集证券投资基金共 139 只。

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		
庄皓亮	本基金基金经理	2021-03-16	-	10 年	硕士。曾在长江证券、华夏基金从事证券研究、投资管理工作，2021 年 1 月加入华宝基金管理有限公司。2021 年 3 月至 2022 年 8 月任华宝智慧产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2021 年 3 月起任华宝中证 500 指数增强型发起式证券投资基金、华宝第三产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2021 年 12 月起任华宝中证稀有金属主题指数增强型发起式证券投资基金基金经理，2022 年 8 月起任华宝科技先锋混合型证券投资基金基金经理。
喻银尤	本基金基金经理	2022-07-05	-	7 年	硕士。曾在中信建投证券股份有限公司从事量化研究工作，2018 年 9 月加入华宝基金管理有限公司，历任量化分析师、投资经理等职务。2022 年 7 月起任华宝中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金经理，2023 年 2 月起任华宝量化选股混合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《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期内，本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作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 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

本基金管理人旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 1 次，均为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。

本报告期内，本基金没有发现异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2023 年上半年，A 股市场表现总体平稳。经济复苏和政策利好的推动下，股指呈现上涨趋势，投资者信心逐渐恢复。经济复苏是 A 股市场表现良好的重要原因之一。随着全球疫情逐渐得到控制，国内经济逐渐恢复增长势头，企业盈利能力得到提升，这对于股市的推动起到了积极作用。政策利好也是 A 股市场上半年表现不错的原因之一。政府出台了一系列支持经济发展的政策，包括减税降费、扩大内需、推动科技创新等，这些政策的实施对于相关行业和企业有着积极的影响，进一步提振了投资者的信心。然而，市场仍然面临一些不确定因素和挑战，投资者需要保持警惕并做好风险管理。

本基金采取行业中性策略，不赌风格、不押赛道、不追热点，追求稳定高性价比的超额收益策略。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金份额 A 类净值增长率为 4.23%，本报告期基金份额 C 类净值增长率为 4.02%；同期业绩比较基准收益率为 2.20%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年企业盈利大概率是周期低点，未来企业盈利将触底回升，市场对于 A 股的投资热情将增加，股市将有望表现良好。同时利好政策大概率更多推出，政府将加大对资本市场的支持力度，有助于提振市场信心，推动 A 股市场的表现。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。

本基金管理人设有估值委员会，定期评价现行估值政策和程序，在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况后及时修订估值方法。基金在投资新品种时，由估值委员会评价现有估值政策和程序的适用性。参与估值的人员均具备估值业务所需的专业胜任能力，参与估值各方之间不存在重大利益冲突。

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

截至本报告期末，本基金基金资产净值存在连续超过六十个工作日低于五千万元的情形。根据相关规定，本基金管理人已拟定了相应的解决方案，并已将方案报告监管机构。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明

本报告期内，中国民生银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规的规定和基金合同、托管协议的约定，依法安全保管了基金财产，不存在损害基金份额持有人利益的行为，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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，按照相关法律法规规定和基金合同、托管协议的有关约定，本托管人对本基金的投资运作方面进行了监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的约定进行。

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

本托管人复核审查的本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、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：华宝中证 500 指数增强型发起式证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	2,691,492.18	4,510,634.22
结算备付金		304,149.46	104,417.27
存出保证金		5,516.74	9,894.63
交易性金融资产	6.4.7.2	43,616,091.90	42,306,248.02
其中：股票投资		43,616,091.90	42,306,248.02
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		60,225.47	94,547.08
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		46,677,475.75	47,025,741.22
负债和净资产	附注号	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022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		21,240.04	1,706,728.64
应付赎回款		31,875.44	5,130.29
应付管理人报酬		38,224.58	38,673.65
应付托管费		4,586.94	4,640.83
应付销售服务费		7,187.33	7,337.90
应付投资顾问费		-	-
应交税费		178.95	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	372,990.44	326,947.54
负债合计		476,283.72	2,089,458.85
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	40,813,448.44	41,337,509.51
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	5,387,743.59	3,598,772.86
净资产合计		46,201,192.03	44,936,282.37
负债和净资产总计		46,677,475.75	47,025,741.22

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额总额 40,813,448.44 份，其中华宝中证 500 增强 A 基金份额总额 21,281,897.57 份，基金份额净值 1.1433 元；华宝中证 500 增强 C 基金份额总额 19,531,550.87 份，基金份额净值 1.1197 元。

6.2 利润表

会计主体：华宝中证 500 指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		2,199,622.79	-1,619,305.85
1. 利息收入		6,680.69	6,970.68
其中：存款利息收入	6.4.7.13	6,680.69	6,970.68
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）		1,336,150.63	-3,014,407.76
其中：股票投资收益	6.4.7.14	813,749.25	-3,569,667.56
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	-
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益		-	-
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	522,401.38	555,259.80
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	851,353.53	1,342,717.62
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	5,437.94	45,413.61
减：二、营业总支出		368,774.83	325,670.72
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	239,015.91	207,671.33
2. 托管费	6.4.10.2.2	28,681.92	24,920.53
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	45,782.03	39,024.12
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		19.17	-

8. 其他费用	6.4.7.23	55,275.80	54,054.74
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,830,847.96	-1,944,976.57
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,830,847.96	-1,944,976.57
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		1,830,847.96	-1,944,976.57

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：华宝中证 500 指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 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（基金净值）	41,337,509.51	-	3,598,772.86	44,936,282.37
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	41,337,509.51	-	3,598,772.86	44,936,282.37
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-524,061.07	-	1,788,970.73	1,264,909.66
（一）、综合收益总额	-	-	1,830,847.96	1,830,847.96
（二）、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）	-524,061.07	-	-41,877.23	-565,938.30
其中：1. 基金申购款	6,318,493.38	-	955,765.95	7,274,259.33
2. 基金赎回款	-6,842,554.45	-	-997,643.18	-7,840,197.63
（三）、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）				
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	40,813,448.44	-	5,387,743.59	46,201,192.03
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 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（基金净值）	30,140,935.70	-	8,466,560.60	38,607,496.30
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	30,140,935.70	-	8,466,560.60	38,607,496.30
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	7,448,697.64	-	-627,307.77	6,821,389.87
（一）、综合收益总额	-	-	-1,944,976.57	-1,944,976.57
（二）、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）	7,448,697.64	-	1,317,668.80	8,766,366.44
其中：1. 基金申购款	17,080,106.51	-	2,962,733.96	20,042,840.47
2. 基金赎回款	-9,631,408.87	-	-1,645,065.16	-11,276,474.03
（三）、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）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-

四、本期期末净资产(基金净值)	37,589,633.34	-	7,839,252.83	45,428,886.17
-----------------	---------------	---	--------------	---------------

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：

<u>向辉</u>	<u>向辉</u>	<u>张幸骏</u>
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

华宝中证 500 指数增强型发起式证券投资基金(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[2018]第 15 号《关于准予华宝中证 500 指数增强型发起式证券投资基金注册的批复》准予注册,由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》和《华宝中证 500 指数增强型发起式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发起式,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 55,152,857.21 元,业经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)德师报(验)字(18)第 00004 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华宝中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》于 2018 年 4 月 19 日生效,基金合同生效日的基金份额总额为 55,157,340.21 份基金份额,其中认购资金利息折合 4,483.00 份基金份额。本基金的基金管理人为华宝基金管理有限公司,基金托管人为中国民生银行股份有限公司。

根据经批准的《华宝中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》和《华宝中证 500 指数增强型发起式证券投资基金招募说明书》的规定,本基金根据认购/申购费用与销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取认购/申购费用的基金份额,称为 A 类基金份额;从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取认购/申购费用的基金份额,称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同,本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值,计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华宝中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围主要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(包含中小板、创业板、存托凭证及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期

融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、货币市场工具、权证、资产支持证券、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。本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产的 80%，其中投资于中证 500 指数成分股及备选成分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%。本基金投资股指期货、权证及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准为：中证 500 指数收益率 \times 95%+银行活期存款利率(税后) \times 5%。

本财务报表由本基金的基金管理人华宝基金管理有限公司于 2023 年 8 月 29 日批准报出。

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于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华宝中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》和在财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及 2023 年上半年度的经营成果和净资产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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《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《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《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《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《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《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，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，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对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，股票的股息、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。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，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。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%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。

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育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 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	2,691,492.18
等于：本金	2,691,214.14
加：应计利息	278.04
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	2,691,492.18

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	43,539,383.72	-	43,616,091.90	76,708.18
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	43,539,383.72	-	43,616,091.90	76,708.18

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 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	403.78
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	310,874.48
其中：交易所市场	310,874.48
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	51,712.18
应付指数使用费	10,000.00
合计	372,990.44

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

华宝中证 500 增强 A

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	21,477,543.15	21,477,543.15
本期申购	1,846,182.78	1,846,182.78
本期赎回（以“-”号填列）	-2,041,828.36	-2,041,828.36
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	21,281,897.57	21,281,897.57

华宝中证 500 增强 C

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	19,859,966.36	19,859,966.36

本期申购	4,472,310.60	4,472,310.60
本期赎回（以“-”号填列）	-4,800,726.09	-4,800,726.09
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	19,531,550.87	19,531,550.87

6.4.7.8 其他综合收益

6.4.7.9 未分配利润

单位：人民币元

华宝中证 500 增强 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	4,327,773.65	-2,246,942.69	2,080,830.96
本期利润	532,037.72	466,631.76	998,669.48
本期基金份额交易产生的变动数	-51,041.17	20,742.50	-30,298.67
其中：基金申购款	438,712.90	-135,438.23	303,274.67
基金赎回款	-489,754.07	156,180.73	-333,573.34
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,808,770.20	-1,759,568.43	3,049,201.77

华宝中证 500 增强 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	3,565,038.05	-2,047,096.15	1,517,941.90
本期利润	447,456.71	384,721.77	832,178.48
本期基金份额交易产生的变动数	-81,404.21	69,825.65	-11,578.56
其中：基金申购款	956,016.62	-303,525.34	652,491.28
基金赎回款	-1,037,420.83	373,350.99	-664,069.84
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,931,090.55	-1,592,548.73	2,338,541.82

6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	5,313.26
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	1,312.47
其他	54.96
合计	6,680.69

6.4.7.11 股票投资收益

6.4.7.11.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	124,494,614.16
减：卖出股票成本总额	123,307,032.09
减：交易费用	373,832.82
买卖股票差价收入	813,749.25

6.4.7.11.2 股票投资收益——证券出借差价收入

6.4.7.12 债券投资收益

本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.13 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
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	522,401.38
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	522,401.38

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	851,353.53
股票投资	851,353.53
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	851,353.53

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	5,115.31
基金转换费收入	322.63
合计	5,437.94

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中不低于转出基金的赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产。

6.4.7.19 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	9,916.99
信息披露费	24,795.19
证券出借违约金	-
银行费用	549.50
指数使用费	20,000.00
存托服务费	14.12
合计	55,275.80

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无需要披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行交易。

6.4.10.2 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 2023年1月1日至2023年6 月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	239,015.91	207,671.33
其中：支付销售机构的客户维护费	61,626.67	51,989.71

注：支付基金管理人华宝基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.00%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 × 1.00% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6 月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	28,681.92	24,920.53

注：支付基金托管人中国民生银行股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值 0.12%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 × 0.12% / 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华宝中证 500 增强 A	华宝中证 500 增强 C	合计
华宝基金	-	10,510.13	10,510.13
华宝证券	-	10,240.24	10,240.24
民生银行	-	1,730.09	1,730.09
合计	-	22,480.46	22,480.46
获得销售服务费的各关联方 名称	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华宝中证 500 增强 A	华宝中证 500 增强 C	合计
华宝基金	-	8,551.40	8,551.40
华宝证券	-	9,347.20	9,347.20
民生银行	-	2,102.75	2,102.75
合计	-	20,001.35	20,001.35

注：销售服务费每日计提，按月支付。A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.4% 年费率计提。本基金 C 类基金份额销售服务费计提的计算方法如下： $H = E \times 0.4\% \div \text{当年天数}$ ，H 为 C 类基金份额每日应计提的基金销售服务费 E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期内及上年度可比期间无转融通证券出借业务。

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

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
		华宝中证 500 增强 A
基金合同生效日（2018 年 4 月 19 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	10,000,450.05	-
报告期间申购/买入总份额	0.00	-
报告期间因拆分变动份额	0.00	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	-
报告期末持有的基金份额	10,000,450.05	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	46.99%	-
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
		华宝中证 500 增强 C
基金合同生效日（2018 年 4 月 19 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	10,000,450.05	-
报告期间申购/买入总份额	0.00	-
报告期间因拆分变动份额	0.00	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	-
报告期末持有的基金份额	10,000,450.05	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	52.36%	-

注：基金管理人投资本基金适用的认(申)购/赎回费率按照本基金招募说明书的规定执行。

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外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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 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

民生银行	2,691,492.18	5,313.26	4,115,942.60	4,759.88
------	--------------	----------	--------------	----------

注：本基金的银行存款由基金托管人民生银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2023 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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有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

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

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为指数增强型基金，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。本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。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资、股指期货等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之

间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，公司内部监督和反馈系统包括内部控制委员会、督察长、合规审计部、风险管理部、各部门负责人和风险控制联络人、各业务岗位。内部控制委员会负责对公司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。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，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。

于本报告期末，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券和资产支持证券

占基金资产净值的比例较低（含债券投资比例为零），因此无重大信用风险（上年度末：同）。

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同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 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上述比例限制）。

本基金所持证券均在证券交易所上市，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评

估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

本报告期内，基金管理人坚持组合管理、分散投资的基本原则，严格按照法律法规的有关规定和基金合同约定的投资范围与比例限制实施投资管理。本基金所持证券均在证券交易所上市，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；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，主要包括利率风险、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和存出保证金等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 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	2,691,492.18	-	-	-	2,691,492.18
结算备付金	304,149.46	-	-	-	304,149.46
存出保证金	5,516.74	-	-	-	5,516.74
交易性金融资产	-	-	-	43,616,091.90	43,616,091.90
应收申购款	-	-	-	60,225.47	60,225.47

资产总计	3,001,158.38	-	-	43,676,317.37	46,677,475.75
负债					
应付赎回款	-	-	-	31,875.44	31,875.44
应付管理人报酬	-	-	-	38,224.58	38,224.58
应付托管费	-	-	-	4,586.94	4,586.94
应付清算款	-	-	-	21,240.04	21,240.04
应付销售服务费	-	-	-	7,187.33	7,187.33
应交税费	-	-	-	178.95	178.95
其他负债	-	-	-	372,990.44	372,990.44
负债总计	-	-	-	476,283.72	476,283.72
利率敏感度缺口	3,001,158.38	-	-	43,200,033.65	46,201,192.03
上年度末 2022 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	4,510,634.22	-	-	-	4,510,634.22
结算备付金	104,417.27	-	-	-	104,417.27
存出保证金	9,894.63	-	-	-	9,894.63
交易性金融资产	-	-	-	42,306,248.02	42,306,248.02
应收申购款	-	-	-	94,547.08	94,547.08
资产总计	4,624,946.12	-	-	42,400,795.10	47,025,741.22
负债					
应付赎回款	-	-	-	5,130.29	5,130.29
应付管理人报酬	-	-	-	38,673.65	38,673.65
应付托管费	-	-	-	4,640.83	4,640.83
应付清算款	-	-	-	1,706,728.64	1,706,728.64
应付销售服务费	-	-	-	7,337.90	7,337.90
其他负债	-	-	-	326,947.54	326,947.54
负债总计	-	-	-	2,089,458.85	2,089,458.85
利率敏感度缺口	4,624,946.12	-	-	40,311,336.25	44,936,282.37

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(上年度末：同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(上年度末：同)。

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。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，基金管理人主要运用股指期货等空头工具对持有的股票等权益类多头组合进行对冲操作，规避权益类多头组合的市场系统性风险；同时预留必要的现金，以应对保证金的增加要求或投资者的赎回申请。在股票投资方面，主要采用量化行业配置模型和量化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，严格控制运作风险，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，最大化超额收益。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金的投资组合比例为：投资于股票资产的比例不低于基金资产的 80%，其中投资于中证 500 指数成分股及备选成分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%。本基金投资股指期货、权证及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。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 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 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	43,616,091.90	94.40	42,306,248.02	94.15
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	43,616,091.90	94.40	42,306,248.02	94.15

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023 年 6 月 30 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	2,166,675.22	2,084,637.91
业绩比较基准下降 5%	-2,166,675.22	-2,084,637.91	

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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	43,616,091.90	42,306,248.02
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	43,616,091.90	42,306,248.02

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的证券等，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关证券等的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关证券公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本报告期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(上年度末：同)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	43,616,091.90	93.44
	其中：股票	43,616,091.90	93.44
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	2,995,641.64	6.42
8	其他各项资产	65,742.21	0.14
9	合计	46,677,475.75	100.00

注：本基金本报告期末“固定收益投资”、“买入返售金融资产”、“银行存款和结算备付金合计”等项目的列报金额已包含对应的“应计利息”和“减值准备”（若有），“其他资产”中的“应收利息”指本基金截至本报告期末已过付息期但尚未收到的利息金额（下同）。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末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	526,417.00	1.14
B	采矿业	1,907,386.50	4.13
C	制造业	23,430,967.42	50.72
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,043,843.00	2.26

E	建筑业	952,231.00	2.06
F	批发和零售业	1,418,463.78	3.07
G	交通运输、仓储和邮政业	429,598.00	0.93
H	住宿和餐饮业	92,855.00	0.20
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,171,535.50	4.70
J	金融业	2,673,625.80	5.79
K	房地产业	797,133.00	1.73
L	租赁和商务服务业	322,862.00	0.70
M	科学研究和技术服务业	170,692.00	0.37
N	水利、环境和公共设施管理业	231,110.00	0.50
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	1,310,306.00	2.84
S	综合	149,973.00	0.32
	合计	37,628,999.00	81.45

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

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	186,200.00	0.40
B	采矿业	344,910.00	0.75
C	制造业	3,377,120.99	7.31
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	90,347.00	0.20
F	批发和零售业	456,568.20	0.99
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	278,236.71	0.60
J	金融业	626,857.00	1.36
K	房地产业	266,123.00	0.58
L	租赁和商务服务业	179,670.00	0.39
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	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	181,060.00	0.39
S	综合	-	-
	合计	5,987,092.90	12.96

7.2.3 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。

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	300308	中际旭创	3,300	486,585.00	1.05
2	600582	天地科技	82,800	482,724.00	1.04
3	000783	长江证券	76,800	445,440.00	0.96
4	600329	达仁堂	8,700	390,543.00	0.85
5	603688	石英股份	3,400	387,056.00	0.84
6	600060	海信视像	15,600	386,100.00	0.84
7	002422	科伦药业	13,000	385,840.00	0.84
8	002373	千方科技	27,600	376,464.00	0.81
9	002056	横店东磁	20,300	369,663.00	0.80
10	601966	玲珑轮胎	16,600	368,852.00	0.80
11	000423	东阿阿胶	6,900	368,805.00	0.80
12	300487	蓝晓科技	5,900	368,278.00	0.80
13	002131	利欧股份	159,700	367,310.00	0.80
14	600398	海澜之家	52,700	362,576.00	0.78
15	000997	新大陆	19,100	360,990.00	0.78
16	600315	上海家化	11,800	342,318.00	0.74
17	600066	宇通客车	23,200	341,968.00	0.74
18	002600	领益智造	48,900	337,899.00	0.73
19	688281	华秦科技	1,661	336,352.50	0.73
20	603218	日月股份	17,700	336,123.00	0.73
21	688006	杭可科技	10,924	332,854.28	0.72
22	600699	均胜电子	18,400	324,576.00	0.70
23	300866	安克创新	3,700	323,750.00	0.70
24	002568	百润股份	8,900	323,515.00	0.70
25	688390	固德威	1,884	314,364.24	0.68
26	600481	双良节能	22,400	313,152.00	0.68

27	002223	鱼跃医疗	8,700	313,113.00	0.68
28	300144	宋城演艺	24,800	307,520.00	0.67
29	601717	郑煤机	24,200	301,290.00	0.65
30	000683	远兴能源	41,700	299,823.00	0.65
31	603444	吉比特	600	294,666.00	0.64
32	603228	景旺电子	11,400	292,410.00	0.63
33	600598	北大荒	21,900	291,927.00	0.63
34	002409	雅克科技	4,000	291,520.00	0.63
35	002673	西部证券	45,900	291,465.00	0.63
36	000623	吉林敖东	18,000	288,720.00	0.62
37	600008	首创环保	97,400	280,512.00	0.61
38	300442	润泽科技	9,000	276,840.00	0.60
39	603338	浙江鼎力	4,800	268,848.00	0.58
40	688516	奥特维	1,425	268,470.00	0.58
41	600373	中文传媒	19,700	262,404.00	0.57
42	002739	万达电影	20,700	259,578.00	0.56
43	688029	南微医学	3,158	257,566.48	0.56
44	001914	招商积余	17,000	255,850.00	0.55
45	000988	华工科技	6,400	243,264.00	0.53
46	000933	神火股份	18,500	240,500.00	0.52
47	002761	浙江建投	15,700	238,326.00	0.52
48	600153	建发股份	21,800	237,838.00	0.51
49	600486	扬农化工	2,700	236,034.00	0.51
50	688002	睿创微纳	5,220	233,856.00	0.51
51	601168	西部矿业	21,900	230,169.00	0.50
52	601958	金钼股份	20,200	225,230.00	0.49
53	002244	滨江集团	25,300	223,146.00	0.48
54	002128	电投能源	16,500	218,130.00	0.47
55	002925	盈趣科技	11,100	215,340.00	0.47
56	600517	国网英大	37,600	214,320.00	0.46
57	000937	冀中能源	32,700	208,626.00	0.45
58	603866	桃李面包	20,500	207,460.00	0.45
59	600885	宏发股份	6,500	207,025.00	0.45
60	600271	航天信息	15,000	205,350.00	0.44
61	000807	云铝股份	16,000	203,680.00	0.44
62	600161	天坛生物	7,400	200,910.00	0.43
63	300017	网宿科技	28,100	199,791.00	0.43
64	600667	太极实业	27,100	196,746.00	0.43
65	000630	铜陵有色	67,600	195,364.00	0.42
66	600027	华电国际	29,000	194,010.00	0.42
67	600282	南钢股份	57,400	193,438.00	0.42
68	000960	锡业股份	12,400	192,820.00	0.42
69	002273	水晶光电	16,100	192,234.00	0.42

70	600563	法拉电子	1,400	192,220.00	0.42
71	002025	航天电器	3,000	191,400.00	0.41
72	600998	九州通	18,371	190,690.98	0.41
73	600873	梅花生物	21,200	189,316.00	0.41
74	002683	广东宏大	6,400	188,416.00	0.41
75	600325	华发股份	18,500	182,225.00	0.39
76	600348	华阳股份	22,950	181,534.50	0.39
77	000878	云南铜业	16,400	181,220.00	0.39
78	600970	中材国际	14,000	178,500.00	0.39
79	600859	王府井	8,900	176,131.00	0.38
80	600390	五矿资本	32,600	175,388.00	0.38
81	601098	中南传媒	15,100	175,160.00	0.38
82	000739	普洛药业	9,800	173,852.00	0.38
83	603233	大参林	6,180	173,101.80	0.37
84	603885	吉祥航空	11,200	172,816.00	0.37
85	002511	中顺洁柔	15,400	171,710.00	0.37
86	601928	凤凰传媒	14,900	169,860.00	0.37
87	002384	东山精密	6,500	168,350.00	0.36
88	002518	科士达	4,200	168,042.00	0.36
89	601000	唐山港	47,200	166,616.00	0.36
90	002423	中粮资本	20,700	165,600.00	0.36
91	600339	中油工程	40,400	164,428.00	0.36
92	002563	森马服饰	26,100	162,342.00	0.35
93	002985	北摩高科	3,500	154,420.00	0.33
94	600765	中航重机	5,800	153,758.00	0.33
95	600170	上海建工	55,500	149,295.00	0.32
96	300146	汤臣倍健	6,200	148,676.00	0.32
97	300395	菲利华	3,000	147,600.00	0.32
98	600566	济川药业	5,000	145,200.00	0.31
99	300058	蓝色光标	15,000	145,050.00	0.31
100	600655	豫园股份	21,000	144,060.00	0.31
101	601187	厦门银行	27,900	140,058.00	0.30
102	002266	浙富控股	33,900	140,007.00	0.30
103	002249	大洋电机	24,200	137,940.00	0.30
104	600707	彩虹股份	28,900	137,564.00	0.30
105	601077	渝农商行	38,200	137,138.00	0.30
106	002299	圣农发展	7,100	135,965.00	0.29
107	600642	申能股份	19,400	135,606.00	0.29
108	600956	新天绿能	15,500	135,160.00	0.29
109	600297	广汇汽车	64,900	134,992.00	0.29
110	601869	长飞光纤	3,600	133,236.00	0.29
111	603939	益丰药房	3,600	133,200.00	0.29
112	600096	云天化	7,800	133,146.00	0.29

113	002926	华西证券	15,800	131,298.00	0.28
114	000830	鲁西化工	12,300	129,888.00	0.28
115	002372	伟星新材	6,300	129,402.00	0.28
116	000563	陕国投 A	42,300	129,015.00	0.28
117	600985	淮北矿业	11,100	127,872.00	0.28
118	603156	养元饮品	5,100	125,970.00	0.27
119	603456	九洲药业	4,600	125,948.00	0.27
120	002572	索菲亚	7,100	123,682.00	0.27
121	603127	昭衍新药	3,000	122,700.00	0.27
122	603529	爱玛科技	3,700	119,214.00	0.26
123	600927	永安期货	7,100	115,446.00	0.25
124	000021	深科技	5,400	107,946.00	0.23
125	300136	信维通信	5,300	106,424.00	0.23
126	600879	航天电子	12,200	103,578.00	0.22
127	600839	四川长虹	20,400	103,020.00	0.22
128	600820	隧道股份	16,800	100,968.00	0.22
129	600580	卧龙电驱	6,900	100,809.00	0.22
130	002936	郑州银行	42,300	97,290.00	0.21
131	002203	海亮股份	8,100	97,281.00	0.21
132	300296	利亚德	14,800	96,644.00	0.21
133	000039	中集集团	13,800	95,082.00	0.21
134	002153	石基信息	6,780	94,920.00	0.21
135	603858	步长制药	4,600	94,714.00	0.21
136	600673	东阳光	13,100	94,451.00	0.20
137	000893	亚钾国际	4,100	94,054.00	0.20
138	000060	中金岭南	19,700	93,575.00	0.20
139	002019	亿帆医药	6,400	93,440.00	0.20
140	600258	首旅酒店	4,900	92,855.00	0.20
141	600959	江苏有线	27,400	92,612.00	0.20
142	000987	越秀资本	14,400	91,440.00	0.20
143	000598	兴蓉环境	16,800	91,224.00	0.20
144	601162	天风证券	30,600	91,188.00	0.20
145	601992	金隅集团	41,600	90,688.00	0.20
146	000156	华数传媒	10,400	90,480.00	0.20
147	688208	道通科技	2,985	90,475.35	0.20
148	002745	木林森	9,800	90,160.00	0.20
149	600967	内蒙一机	8,900	89,890.00	0.19
150	600056	中国医药	6,900	89,562.00	0.19
151	000785	居然之家	23,500	89,535.00	0.19
152	601555	东吴证券	12,900	89,526.00	0.19
153	300257	开山股份	5,900	89,503.00	0.19
154	600871	石化油服	45,200	89,496.00	0.19
155	000559	万向钱潮	16,300	88,835.00	0.19

156	002081	金螳螂	19,600	88,396.00	0.19
157	600968	海油发展	28,300	86,881.00	0.19
158	603317	天味食品	5,860	85,614.60	0.19
159	688072	拓荆科技	200	85,194.00	0.18
160	002463	沪电股份	4,000	83,760.00	0.18
161	603737	三棵树	1,240	81,120.80	0.18
162	601608	中信重工	18,100	76,201.00	0.16
163	601991	大唐发电	22,100	73,151.00	0.16
164	600597	光明乳业	6,800	70,720.00	0.15
165	002738	中矿资源	1,180	60,109.20	0.13
166	002966	苏州银行	9,000	58,950.00	0.13
167	600487	亨通光电	3,900	57,174.00	0.12
168	601058	赛轮轮胎	5,000	56,950.00	0.12
169	300699	光威复材	1,840	56,764.00	0.12
170	000009	中国宝安	4,600	55,522.00	0.12
171	000066	中国长城	4,000	55,320.00	0.12
172	600901	江苏金租	13,160	54,350.80	0.12
173	600352	浙江龙盛	5,800	54,230.00	0.12
174	300474	景嘉微	600	53,994.00	0.12
175	000998	隆平高科	3,500	53,725.00	0.12
176	002625	光启技术	3,500	53,410.00	0.12
177	300024	机器人	3,200	53,344.00	0.12
178	600862	中航高科	2,100	53,151.00	0.12
179	600160	巨化股份	3,800	52,364.00	0.11
180	688567	孚能科技	2,419	52,226.21	0.11
181	600705	中航产融	13,600	52,088.00	0.11
182	300253	卫宁健康	4,800	51,936.00	0.11
183	002281	光迅科技	1,400	51,926.00	0.11
184	002465	海格通信	5,000	51,700.00	0.11
185	002497	雅化集团	2,900	51,562.00	0.11
186	000975	银泰黄金	4,400	51,480.00	0.11
187	300118	东方日升	2,000	51,260.00	0.11
188	601128	常熟银行	7,500	51,150.00	0.11
189	002444	巨星科技	2,300	50,324.00	0.11
190	002078	太阳纸业	4,700	50,243.00	0.11
191	603927	中科软	1,300	50,128.00	0.11
192	300088	长信科技	8,300	50,049.00	0.11
193	002195	岩山科技	17,300	49,997.00	0.11
194	600499	科达制造	4,400	49,984.00	0.11
195	000729	燕京啤酒	4,000	49,880.00	0.11
196	601198	东兴证券	6,200	49,724.00	0.11
197	600521	华海药业	2,700	49,707.00	0.11
198	600416	湘电股份	2,600	49,634.00	0.11

199	603816	顾家家居	1,300	49,595.00	0.11
200	300383	光环新网	4,600	49,450.00	0.11
201	002507	涪陵榨菜	2,700	49,437.00	0.11
202	600166	福田汽车	14,500	49,300.00	0.11
203	002432	九安医疗	1,400	49,294.00	0.11
204	000636	风华高科	3,200	49,088.00	0.11
205	300682	朗新科技	2,100	48,888.00	0.11
205	600498	烽火通信	2,400	48,888.00	0.11
206	000703	恒逸石化	7,200	48,816.00	0.11
207	000738	航发控制	2,000	48,800.00	0.11
208	689009	九号公司	1,322	48,715.70	0.11
209	300373	扬杰科技	1,200	48,684.00	0.11
210	600739	辽宁成大	3,700	48,655.00	0.11
211	300595	欧普康视	1,600	48,304.00	0.10
212	600435	北方导航	4,200	48,258.00	0.10
213	300676	华大基因	800	47,992.00	0.10
214	002939	长城证券	5,900	47,967.00	0.10
215	601231	环旭电子	3,200	47,872.00	0.10
216	600038	中直股份	1,200	47,784.00	0.10
217	002353	杰瑞股份	1,900	47,747.00	0.10
218	002092	中泰化学	7,400	47,730.00	0.10
219	300115	长盈精密	4,000	47,640.00	0.10
220	600021	上海电力	4,400	47,388.00	0.10
221	300363	博腾股份	1,600	47,344.00	0.10
222	600895	张江高科	3,400	47,328.00	0.10
223	002531	天顺风能	3,100	47,213.00	0.10
224	300070	碧水源	8,800	47,168.00	0.10
225	300357	我武生物	1,400	47,082.00	0.10
226	300009	安科生物	4,700	47,000.00	0.10
227	600316	洪都航空	2,000	46,900.00	0.10
228	002030	达安基因	4,700	46,859.00	0.10
229	000050	深天马 A	5,100	46,818.00	0.10
229	688200	华峰测控	306	46,818.00	0.10
230	600131	国网信通	2,300	46,437.00	0.10
231	002155	湖南黄金	3,800	46,360.00	0.10
232	688538	和辉光电	18,211	46,255.94	0.10
233	603160	汇顶科技	1,000	46,250.00	0.10
234	600208	新湖中宝	18,600	46,128.00	0.10
235	601666	平煤股份	6,100	45,994.00	0.10
236	603786	科博达	700	45,990.00	0.10
237	603650	彤程新材	1,400	45,920.00	0.10
238	603707	健友股份	3,400	45,900.00	0.10
239	600737	中粮糖业	5,700	45,885.00	0.10

240	688188	柏楚电子	243	45,820.08	0.10
241	603267	鸿远电子	700	45,710.00	0.10
242	000778	新兴铸管	11,200	45,696.00	0.10
242	601106	中国一重	13,600	45,696.00	0.10
243	000709	河钢股份	20,200	45,652.00	0.10
244	600500	中化国际	8,200	45,592.00	0.10
245	600827	百联股份	3,400	45,458.00	0.10
246	601866	中远海发	18,400	45,448.00	0.10
247	300618	寒锐钴业	1,400	45,374.00	0.10
248	000930	中粮科技	5,600	45,360.00	0.10
249	603225	新凤鸣	4,100	45,305.00	0.10
250	300251	光线传媒	5,600	45,304.00	0.10
251	000012	南玻 A	7,600	45,296.00	0.10
252	600062	华润双鹤	2,600	45,292.00	0.10
253	300482	万孚生物	1,700	45,271.00	0.10
254	603638	艾迪精密	2,200	45,144.00	0.10
255	601778	晶科科技	9,100	44,954.00	0.10
256	601118	海南橡胶	10,000	44,800.00	0.10
257	600155	华创云信	7,200	44,784.00	0.10
258	603883	老百姓	1,500	44,775.00	0.10
259	603056	德邦股份	2,900	44,718.00	0.10
260	002010	传化智联	8,400	44,688.00	0.10
261	600801	华新水泥	3,600	44,460.00	0.10
262	600195	中牧股份	3,800	44,384.00	0.10
263	601718	际华集团	14,900	44,253.00	0.10
264	603077	和邦生物	18,200	44,226.00	0.10
265	600409	三友化工	8,100	44,145.00	0.10
266	600507	方大特钢	9,500	43,985.00	0.10
267	000967	盈峰环境	8,700	43,935.00	0.10
268	601828	美凯龙	9,100	43,589.00	0.09
269	600764	中国海防	1,600	43,552.00	0.09
270	688289	圣湘生物	2,578	43,413.52	0.09
271	600623	华谊集团	6,900	42,987.00	0.09
272	000869	张裕 A	1,400	42,924.00	0.09
273	601969	海南矿业	6,500	42,770.00	0.09
274	000031	大悦城	11,600	42,456.00	0.09
275	002399	海普瑞	3,700	42,439.00	0.09
276	688052	纳芯微	266	42,126.42	0.09
277	600995	南网储能	3,800	41,838.00	0.09
278	688082	盛美上海	361	39,854.40	0.09
279	300888	稳健医疗	80	3,333.60	0.01
280	300776	帝尔激光	40	2,596.00	0.01
281	301029	怡合达	40	1,787.20	0.00

282	002407	多氟多	40	794.40	0.00
283	300390	天华新能	10	358.00	0.00

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

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	300511	雪榕生物	24,500	186,200.00	0.40
2	002535	林州重机	24,400	101,992.00	0.22
3	603283	赛腾股份	2,200	97,900.00	0.21
4	002605	姚记科技	2,100	97,503.00	0.21
5	300246	宝莱特	7,700	95,865.00	0.21
6	300538	同益股份	5,500	95,425.00	0.21
7	688080	映翰通	1,948	95,257.20	0.21
8	002489	浙江永强	23,500	95,175.00	0.21
9	300132	青松股份	16,700	94,689.00	0.20
10	688556	高测股份	1,753	93,154.42	0.20
11	301004	嘉益股份	2,400	93,120.00	0.20
12	300389	艾比森	4,500	91,665.00	0.20
13	603096	新经典	4,500	91,620.00	0.20
14	688299	长阳科技	5,845	91,591.15	0.20
15	000425	徐工机械	13,500	91,395.00	0.20
16	002983	芯瑞达	3,700	91,279.00	0.20
17	603878	武进不锈	10,800	91,260.00	0.20
18	002706	良信股份	8,100	91,125.00	0.20
19	600908	无锡银行	17,000	91,120.00	0.20
20	000166	申万宏源	19,700	91,014.00	0.20
21	300063	天龙集团	21,000	90,930.00	0.20
22	300041	回天新材	7,700	90,860.00	0.20
23	002269	美邦服饰	57,800	90,746.00	0.20
24	002668	奥马电器	10,500	90,720.00	0.20
25	000404	长虹华意	13,100	90,652.00	0.20
26	002154	报喜鸟	16,400	90,528.00	0.20
27	002004	华邦健康	18,100	90,500.00	0.20
28	002062	宏润建设	16,700	90,347.00	0.20
29	300368	汇金股份	13,600	90,304.00	0.20
30	300096	易联众	14,700	90,258.00	0.20
31	600351	亚宝药业	12,700	90,170.00	0.20
32	300147	香雪制药	17,100	90,117.00	0.20
33	300731	科创新源	4,300	89,999.00	0.19
34	300198	纳川股份	35,000	89,950.00	0.19
35	002697	红旗连锁	15,400	89,936.00	0.19
36	300753	爱朋医疗	4,900	89,817.00	0.19
37	603071	物产环能	5,400	89,586.00	0.19
38	000686	东北证券	12,900	89,526.00	0.19

39	001332	锡装股份	2,300	89,493.00	0.19
40	600757	长江传媒	10,400	89,440.00	0.19
41	301116	益客食品	5,800	89,320.00	0.19
42	000951	中国重汽	5,300	89,305.00	0.19
43	603323	苏农银行	21,200	89,252.00	0.19
44	600064	南京高科	13,500	89,235.00	0.19
45	300811	铂科新材	1,500	89,160.00	0.19
46	000921	海信家电	3,300	88,935.00	0.19
47	002807	江阴银行	24,100	88,929.00	0.19
48	002419	天虹股份	15,200	88,920.00	0.19
48	600583	海油工程	15,200	88,920.00	0.19
49	600120	浙江东方	23,200	88,856.00	0.19
50	600971	恒源煤电	11,400	88,806.00	0.19
51	002377	国创高新	37,000	88,800.00	0.19
52	600057	厦门象屿	10,200	88,740.00	0.19
53	601318	中国平安	1,900	88,160.00	0.19
54	000014	沙河股份	7,700	88,088.00	0.19
55	300783	三只松鼠	4,500	87,930.00	0.19
56	603179	新泉股份	2,000	87,780.00	0.19
57	603758	秦安股份	8,200	87,248.00	0.19
58	603197	保隆科技	1,600	86,800.00	0.19
59	300856	科思股份	1,100	86,647.00	0.19
60	688004	博汇科技	2,465	86,201.05	0.19
61	600397	安源煤业	29,500	85,550.00	0.19
62	688599	天合光能	2,000	85,220.00	0.18
63	000568	泸州老窖	400	83,828.00	0.18
64	600256	广汇能源	11,900	81,634.00	0.18
65	300750	宁德时代	20	4,575.80	0.01
66	603605	珀莱雅	40	4,496.00	0.01
67	688005	容百科技	71	3,835.42	0.01
68	003020	立方制药	70	2,590.70	0.01
69	000028	国药一致	50	2,180.50	0.00
70	603613	国联股份	53	1,957.29	0.00
71	300785	值得买	50	1,309.00	0.00
72	300168	万达信息	89	1,008.37	0.00
73	603052	可川科技	20	647.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002738	中矿资源	744,391.00	1.66
2	600376	首开股份	643,698.00	1.43

3	688006	杭可科技	606,155.24	1.35
4	300073	当升科技	565,187.00	1.26
5	000783	长江证券	560,445.00	1.25
6	000999	华润三九	559,371.00	1.24
7	600582	天地科技	541,883.00	1.21
8	002603	以岭药业	531,646.00	1.18
9	002423	中粮资本	531,640.00	1.18
10	688390	固德威	530,080.86	1.18
11	600699	均胜电子	522,215.00	1.16
12	600060	海信视像	521,919.00	1.16
13	603218	日月股份	494,450.00	1.10
14	002131	利欧股份	492,481.00	1.10
15	600728	佳都科技	490,965.00	1.09
16	603596	伯特利	479,383.00	1.07
17	000997	新大陆	472,887.00	1.05
18	000630	铜陵有色	458,092.00	1.02
19	300487	蓝晓科技	456,765.50	1.02
20	000739	普洛药业	453,561.00	1.01

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	300308	中际旭创	1,055,539.00	2.35
2	002738	中矿资源	1,044,711.49	2.32
3	300073	当升科技	1,018,459.00	2.27
4	603605	珀莱雅	892,674.00	1.99
5	603345	安井食品	886,805.00	1.97
6	688777	中控技术	824,029.86	1.83
7	300390	天华新能	814,880.00	1.81
8	300724	捷佳伟创	772,463.00	1.72
9	600895	张江高科	763,308.00	1.70
10	002625	光启技术	734,277.00	1.63
11	603613	国联股份	702,612.00	1.56
12	601699	潞安环能	700,829.00	1.56
13	603596	伯特利	698,577.00	1.55
14	688390	固德威	682,076.45	1.52
15	688063	派能科技	654,804.34	1.46
16	002444	巨星科技	645,779.00	1.44
17	000999	华润三九	637,790.00	1.42
18	000878	云南铜业	634,409.00	1.41
19	688256	寒武纪	615,967.74	1.37
20	002299	圣农发展	612,502.00	1.36

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	123,765,522.44
卖出股票收入（成交）总额	124,494,614.16

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投资。

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投资。

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 本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

基金管理人没有发现本基金投资的前十名证券的发行主体在报告期内被监管部门立案调查，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚，无证券投资决策程序需特别说明。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	5,516.74
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	60,225.47
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	65,742.21

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

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，合计数可能不等于分项之和。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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 (%)
华宝中证 500 增强 A	2,779	7,658.11	10,002,803.44	47.00	11,279,094.13	53.00
华宝中证 500 增强 C	2,524	7,738.33	4,219,409.28	21.60	15,312,141.59	78.40
合计	5,303	7,696.29	14,222,212.72	34.85	26,591,235.72	65.15

8.2 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	华宝中证 500 增强 A	65,610.70	0.3083
	华宝中证 500 增强 C	641.50	0.0033
	合计	66,252.20	0.1623

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	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	华宝中证 500 增强 A	0
	华宝中证 500 增强 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	华宝中证 500 增强 A	0
	华宝中证 500 增强 C	0
	合计	0

8.4 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	24.50	10,000,450.05	24.50	不少于 3 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	24.50	10,000,450.05	24.50	-

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 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
基金合同生效日 (2018 年 4 月 19 日) 基金份额总额	21,918,920.54	33,238,419.67
本报告期期初基金份 额总额	21,477,543.15	19,859,966.36
本报告期基金总申购 份额	1,846,182.78	4,472,310.60
减：本报告期基金总 赎回份额	2,041,828.36	4,800,726.09
本报告期基金拆分变 动份额	-	-
本报告期期末基金份 额总额	21,281,897.57	19,531,550.87

§ 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

本报告期内，基金管理人无重大人事变动。

2、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，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，无涉及基金托管业务的诉讼。

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：自 2022 年 12 月 23 日起至本报告期末。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚的情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，托管人及其高级管理人员在开展基金托管业务过程中未受到相关监管部门稽查或处罚。

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	174,689,943.56	70.43	162,244.80	70.60	-
东方证券	1	73,347,940.69	29.57	67,575.21	29.40	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-

注：1. 基金管理人选择交易单元的标准和程序如下：

(1) 选择标准： 资力雄厚，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、本报告期租用的证券公司交易单元退租的有：国信证券。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

本基金本报告期内未租用证券公司交易单元进行其他证券投资。

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	华宝中证 500 指数增强型发起式证券	基金管理人网站	2023-01-19

	投资基金 2022 年第 4 季度报告		
2	华宝中证 500 指数增强型发起式证券投资基金 2022 年年度报告	基金管理人网站	2023-03-31
3	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	基金管理人网站, 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2023-04-18
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	2023-04-22
5	华宝中证 500 指数增强型发起式证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	基金管理人网站	2023-04-23
6	华宝基金关于旗下部分基金新增兴业银行股份有限公司(银银平台)为代销机构的公告	基金管理人网站, 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2023-04-26
7	华宝基金关于旗下部分基金新增麦高证券有限责任公司为代销机构的公告	基金管理人网站, 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2023-05-08
8	华宝基金关于旗下部分基金新增西部证券股份有限公司为代销机构的公告	基金管理人网站, 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2023-06-16
9	华宝基金关于旗下部分基金新增德邦证券股份有限公司为代销机构的公告	基金管理人网站, 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2023-06-29

§ 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

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	20230101~20230630	10,000,450.05	0.00	0.00	10,000,450.05	24.50

产品特有风险

报告期内本基金出现单一投资者持有基金份额比例超过 20%的情况。

在单一投资者持有基金份额比例较高的情况下, 如该投资者集中赎回, 可能会增加基金的流动性风险。此外, 由于基金在遇到大额赎回的时候可能需要变现部分资产, 可能对持有资产的价格形成冲击, 增加基金的市场风险。基金管理人将专业审慎、勤勉尽责地运作基金资产, 加强防范流动性风险、市场风险, 保护持有人利益。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

中国证监会批准基金设立的文件；

华宝中证 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。

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

2023 年 8 月 31 日