

华宝中证 500 指数增强型发起式证券投资
基金
2024 年中期报告

2024 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：2024 年 8 月 30 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 2024 年 08 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 01 月 01 日起至 2024 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	12
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	12
§ 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	14
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	16
§ 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	46
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	46

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	46
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	46
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	46
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	46
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	48
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	48
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	49
§ 10 重大事件揭示	50
10.1 基金份额持有人大会决议	50
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	50
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	50
10.4 基金投资策略的改变	50
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	50
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	50
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	50
10.8 其他重大事件	51
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	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	52
§ 12 备查文件目录	52
12.1 备查文件目录	52
12.2 存放地点	52
12.3 查阅方式	52

§ 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	
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	64,389,840.63 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	23,966,434.51 份	40,423,406.12 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	袁耀光
	联系电话	021-38505888	010-58560666
	电子邮箱	xxpl@fsfund.com	tgxxpl@cmbc.com.cn
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(2024 年 1 月 1 日-2024 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	-406,048.84	-1,038,130.03
本期利润	-1,070,512.78	-1,840,109.97
加权平均基金份额 本期利润	-0.0427	-0.0366
本期加权平均净 值利润率	-4.17%	-3.66%
本期基金份额净 值增长率	-4.21%	-4.40%
3.1.2 期末数 据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利	-153,520.97	-1,244,886.69

润		
期末可供分配基金份额利润	-0.0064	-0.0308
期末基金资产净值	23,812,913.54	39,178,519.43
期末基金份额净值	0.9936	0.9692
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	-0.64%	-3.08%

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	-5.53%	0.94%	-6.55%	0.91%	1.02%	0.03%
过去三个月	-3.74%	1.05%	-6.16%	1.09%	2.42%	-0.04%
过去六个月	-4.21%	1.46%	-8.46%	1.53%	4.25%	-0.07%
过去一年	-13.09%	1.16%	-16.71%	1.21%	3.62%	-0.05%
过去三年	-24.29%	1.11%	-26.01%	1.14%	1.72%	-0.03%
自基金合同生效起至今	-0.64%	1.25%	-15.79%	1.28%	15.15%	-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
----	----------	-------------	------------	---------------	-----	-----

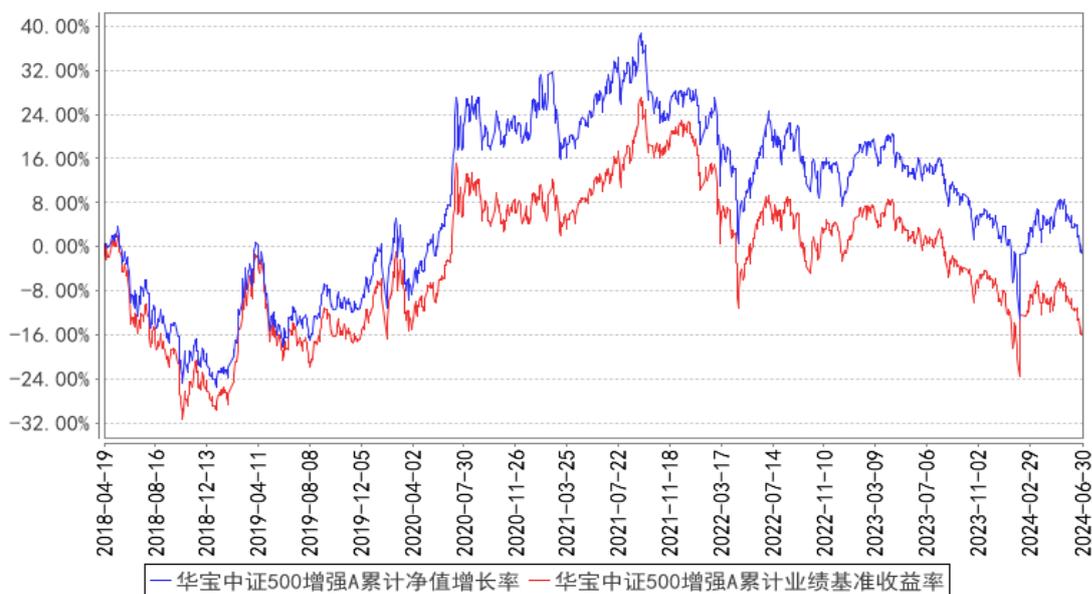
过去一个月	-5.56%	0.94%	-6.55%	0.91%	0.99%	0.03%
过去三个月	-3.84%	1.05%	-6.16%	1.09%	2.32%	-0.04%
过去六个月	-4.40%	1.46%	-8.46%	1.53%	4.06%	-0.07%
过去一年	-13.44%	1.16%	-16.71%	1.21%	3.27%	-0.05%
过去三年	-25.20%	1.11%	-26.01%	1.14%	0.81%	-0.03%
自基金合同生效起至今	-3.08%	1.25%	-15.79%	1.28%	12.71%	-0.03%

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





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。截至本报告期末（2024 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 141 只，涵盖股票型基金、混合型基金、债券型基金、货币市场基金、FOF 等。

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		
喻银尤	本基金基金经理	2022-07-05	-	8 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 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，本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

2024 年上半年，A 股总体震荡探底，不同风格表现较为分化。总体来看，市值方面，大市值占优，中小市值较弱；风格方面，红利占优，成长较弱。如今大盘股在经历了连续 3 年下跌之后

估值处于底部，疫情 3 年的影响基本逐渐褪去，基本面也处于底部位置。另一方面小微盘在经历了 2 月份和 4 月份及最近 6 月初三次小微盘的回调之后，大的风险基本已经释放。站在当下，对未来资本市场充满期待。

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-4.21%，本报告期基金份额 C 类净值增长率为-4.40%；同期业绩比较基准收益率为-8.46%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2024 年 A 股市场上行拐点或已出现，当前市场或处于政策底、盈利底、估值底三重相对底部区域。首先政策逐步加码，更多呵护资本市场的硬招、实招陆续推出，政策效果有望逐步显现。估值角度看，A 股市场持续震荡回调，股权风险溢价率处在历史相对高位区间，市场估值处于相对较低水平，安全边际较充足。最后，从上市公司业绩来看，2024 年一季报基本确认 A 股上市公司净利润同比处于周期底部，业绩底或基本确立。

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

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遵规守信、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：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	1,438,154.79	4,686,608.05
结算备付金		2,207,195.11	1,939,206.66
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	59,645,427.58	80,834,467.57
其中：股票投资		59,645,427.58	80,834,467.57
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		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		58,870.46	83,729.78
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		63,349,647.94	87,544,012.06
负债和净资产	附注号	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		216,258.50	1,889,003.53
应付管理人报酬		54,148.80	75,117.31
应付托管费		6,497.85	9,014.09
应付销售服务费		13,555.95	20,653.05
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	67,753.87	106,005.06
负债合计		358,214.97	2,099,793.04
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	64,389,840.63	83,661,421.02
未分配利润	6.4.7.8	-1,398,407.66	1,782,798.00
净资产合计		62,991,432.97	85,444,219.02
负债和净资产总计		63,349,647.94	87,544,012.06

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额总额 64,389,840.63 份，其中华宝中证 500 增强 A 基金份额总额 23,966,434.51 份，基金份额净值 0.9936 元；华宝中证 500 增强 C 基金份额总额

40,423,406.12 份，基金份额净值 0.9692 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：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-2,307,129.60	2,199,622.79
1. 利息收入		8,640.14	6,680.69
其中：存款利息收入	6.4.7.9	8,640.14	6,680.69
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		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-861,944.90	1,336,150.63
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-1,808,104.67	813,749.25
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-	-
资产支持证券投资	6.4.7.12	-	-
收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	101,363.06	-
股利收益	6.4.7.15	844,796.71	522,401.38
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-1,466,443.88	851,353.53
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	12,619.04	5,437.94
减：二、营业总支出		603,493.15	368,774.83
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	378,454.61	239,015.91
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	45,414.49	28,681.92
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	100,224.39	45,782.03
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	6.4.7.18	-	-
7. 税金及附加		367.12	19.17
8. 其他费用	6.4.7.19	79,032.54	55,275.80
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-2,910,622.75	1,830,847.96
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-2,910,622.75	1,830,847.96
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-2,910,622.75	1,830,847.96

6.3 净资产变动表

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：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	83,661,421.02	-	1,782,798.00	85,444,219.02
二、本期期初净资产	83,661,421.02	-	1,782,798.00	85,444,219.02
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-19,271,580.39	-	-3,181,205.66	-22,452,786.05
（一）、综合收益总额	-	-	-2,910,622.75	-2,910,622.75
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-19,271,580.39	-	-270,582.91	-19,542,163.30
其中：1. 基金申购款	12,895,124.61	-	-119,829.63	12,775,294.98
2. 基金赎回款	-32,166,705.00	-	-150,753.28	-32,317,458.28
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-

四、本期期末净资产	64,389,840.63	-	-1,398,407.66	62,991,432.97
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	41,337,509.51	-	3,598,772.86	44,936,282.37
二、本期期初净资产	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净资产变动数(净资产减少以“-”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净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
四、本期期末净资产	40,813,448.44	-	5,387,743.59	46,201,192.03

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：

向辉

基金管理人负责人

向辉

主管会计工作负责人

张幸骏

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 2024 年 8 月 30 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 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及 2024 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。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(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 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	1,438,154.79
等于：本金	1,437,969.04
加：应计利息	185.75
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-

减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	1,438,154.79

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	62,552,223.35	-	59,645,427.58	-2,906,795.77
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	62,552,223.35	-	59,645,427.58	-2,906,795.77

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 2024 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-

应付赎回费	70.79
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	57,683.08
应付指数使用费	10,000.00
合计	67,753.87

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	
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	26,697,284.10	26,697,284.10
本期申购	1,398,872.49	1,398,872.49
本期赎回（以“-”号填列）	-4,129,722.08	-4,129,722.08
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	23,966,434.51	23,966,434.51

华宝中证 500 增强 C

项目	本期	
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	56,964,136.92	56,964,136.92
本期申购	11,496,252.12	11,496,252.12
本期赎回（以“-”号填列）	-28,036,982.92	-28,036,982.92
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	40,423,406.12	40,423,406.12

注：申购含红利再投以及转换入份(金)额，赎回含转换出份(金)额。

6.4.7.8 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	3,886,646.34	-2,892,055.78	994,590.56
本期期初	3,886,646.34	-2,892,055.78	994,590.56

本期利润	-406,048.84	-664,463.94	-1,070,512.78
本期基金份额交易产生的变动数	-312,455.32	234,856.57	-77,598.75
其中：基金申购款	168,913.17	-136,380.79	32,532.38
基金赎回款	-481,368.49	371,237.36	-110,131.13
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,168,142.18	-3,321,663.15	-153,520.97

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	6,864,187.53	-6,075,980.09	788,207.44
本期期初	6,864,187.53	-6,075,980.09	788,207.44
本期利润	-1,038,130.03	-801,979.94	-1,840,109.97
本期基金份额交易产生的变动数	-1,566,887.25	1,373,903.09	-192,984.16
其中：基金申购款	997,773.92	-1,150,135.93	-152,362.01
基金赎回款	-2,564,661.17	2,524,039.02	-40,622.15
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,259,170.25	-5,504,056.94	-1,244,886.69

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	4,353.71
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	4,286.43
其他	-
合计	8,640.14

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	167,209,974.82
减：卖出股票成本总额	168,645,419.96
减：交易费用	372,659.53
买卖股票差价收入	-1,808,104.67

6.4.7.11 债券投资收益

本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 贵金属投资收益

6.4.7.13.1 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	101,363.06

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	844,796.71
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	844,796.71

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-1,466,443.88
股票投资	-1,466,443.88
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	-1,466,443.88

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	12,458.29
基金转换费收入	160.75
合计	12,619.04

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。

6.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
审计费用	17,901.52
信息披露费	39,781.56
证券出借违约金	-
银行费用	1,340.85
指数使用费	20,000.00
存托服务费	8.61
合计	79,032.54

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)	基金管理人的股东

Asset Management. L. P.)	
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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	378,454.61	239,015.91
其中：应支付销售机构的客户维护费	125,910.87	61,626.67
应支付基金管理人的净管理费	252,543.74	177,389.24

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	45,414.49	28,681.92

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	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

方名称	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	-	889.96	889.96
华宝证券	-	9,038.95	9,038.95
民生银行	-	1,037.43	1,037.43
合计	-	10,966.34	10,966.34
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	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

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

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。

6.4.10.5 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自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	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）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	10,000,450.05	-
报告期内申购/买入总份额	0.00	-
报告期内因拆分变动份额	0.00	-
减：报告期内赎回/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	41.73%	-
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	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）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	10,000,450.05	-
报告期内申购/买入总份额	0.00	-
报告期内因拆分变动份额	0.00	-
减：报告期内赎回/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%	-

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
民生银行	1,438,154.79	4,353.71	2,691,492.18	5,313.26

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（2024 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

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大型股份制商业银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均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净资产的比例较低（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货币资金和存出保证金等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	1,438,154.79	-	-	-	1,438,154.79
结算备付金	2,207,195.11	-	-	-	2,207,195.11
交易性金融资产	-	-	-	59,645,427.58	59,645,427.58
应收申购款	-	-	-	58,870.46	58,870.46
资产总计	3,645,349.90	-	-	59,704,298.04	63,349,647.94
负债					
应付赎回款	-	-	-	216,258.50	216,258.50
应付管理人报酬	-	-	-	54,148.80	54,148.80
应付托管费	-	-	-	6,497.85	6,497.85
应付销售服务费	-	-	-	13,555.95	13,555.95
其他负债	-	-	-	67,753.87	67,753.87
负债总计	-	-	-	358,214.97	358,214.97

利率敏感度缺口	3,645,349.90	-	-	59,346,083.07	62,991,432.97
上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	4,686,608.05	-	-	-	4,686,608.05
结算备付金	1,939,206.66	-	-	-	1,939,206.66
交易性金融资产	-	-	-	80,834,467.57	80,834,467.57
应收申购款	-	-	-	83,729.78	83,729.78
资产总计	6,625,814.71	-	-	80,918,197.35	87,544,012.06
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,889,003.53	1,889,003.53
应付管理人报酬	-	-	-	75,117.31	75,117.31
应付托管费	-	-	-	9,014.09	9,014.09
应付销售服务费	-	-	-	20,653.05	20,653.05
其他负债	-	-	-	106,005.06	106,005.06
负债总计	-	-	-	2,099,793.04	2,099,793.04
利率敏感度缺口	6,625,814.71	-	-	78,818,404.31	85,444,219.02

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 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	59,645,427.58	94.69	80,834,467.57	94.60
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	59,645,427.58	94.69	80,834,467.57	94.60

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（2024 年 6 月 30 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	2,990,060.98	3,986,393.81
	业绩比较基准下降	-2,990,060.98	-3,986,393.81

	5%		
--	----	--	--

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	59,645,427.58	80,653,055.57
第二层次	-	181,412.00
第三层次	-	-
合计	59,645,427.58	80,834,467.57

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	59,645,427.58	94.15
	其中：股票	59,645,427.58	94.15
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	3,645,349.90	5.75
8	其他各项资产	58,870.46	0.09
9	合计	63,349,647.94	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	478,503.00	0.76
B	采矿业	1,971,372.00	3.13
C	制造业	32,741,748.32	51.98
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,096,357.00	3.33
E	建筑业	361,494.00	0.57
F	批发和零售业	475,116.92	0.75
G	交通运输、仓储和邮政业	525,118.00	0.83
H	住宿和餐饮业	60,515.00	0.10
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,829,050.19	6.08
J	金融业	3,969,689.00	6.30
K	房地产业	362,186.00	0.57
L	租赁和商务服务	127,905.00	0.20

	业		
M	科学研究和技术服务业	157,288.00	0.25
N	水利、环境和公共设施管理业	463,210.00	0.74
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	100,062.00	0.16
Q	卫生和社会工作	235,668.00	0.37
R	文化、体育和娱乐业	1,433,624.00	2.28
S	综合	65,472.00	0.10
	合计	49,454,378.43	78.51

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	-	-
B	采矿业	190,409.32	0.30
C	制造业	6,326,936.24	10.04
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	286,944.00	0.46
F	批发和零售业	2,378,264.50	3.78
G	交通运输、仓储和邮政业	212,040.00	0.34
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	378,790.27	0.60
J	金融业	209,844.00	0.33
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	1,640.82	0.00
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	206,180.00	0.33
S	综合	-	-

	合计	10,191,049.15	16.18
--	----	---------------	-------

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	300677	英科医疗	34,300	919,583.00	1.46
2	600066	宇通客车	35,500	915,900.00	1.45
3	000830	鲁西化工	63,900	740,601.00	1.18
4	002273	水晶光电	41,600	706,368.00	1.12
5	601058	赛轮轮胎	47,400	663,600.00	1.05
6	000400	许继电气	18,700	643,467.00	1.02
7	002958	青农商行	230,900	618,812.00	0.98
8	002008	大族激光	29,000	603,200.00	0.96
9	002532	天山铝业	74,100	600,951.00	0.95
10	601615	明阳智能	63,000	594,720.00	0.94
11	601128	常熟银行	77,130	583,874.10	0.93
12	300251	光线传媒	67,200	565,152.00	0.90
13	300207	欣旺达	35,900	544,603.00	0.86
14	603160	汇顶科技	7,500	515,625.00	0.82
15	601666	平煤股份	45,800	512,960.00	0.81
16	300001	特锐德	25,400	511,048.00	0.81
17	000027	深圳能源	66,500	485,450.00	0.77
18	002557	洽洽食品	16,900	476,411.00	0.76
19	688213	思特威	9,808	475,688.00	0.76
20	300002	神州泰岳	57,900	470,148.00	0.75
21	300144	宋城演艺	57,200	459,316.00	0.73
22	600872	中炬高新	20,000	453,800.00	0.72
23	600282	南钢股份	91,100	453,678.00	0.72
24	000921	海信家电	13,800	444,912.00	0.71
25	300502	新易盛	4,000	422,200.00	0.67
26	300529	健帆生物	15,500	421,755.00	0.67
27	002078	太阳纸业	30,000	418,500.00	0.66
28	002128	电投能源	19,600	413,560.00	0.66
29	300724	捷佳伟创	7,600	410,476.00	0.65
30	002152	广电运通	37,300	390,158.00	0.62
31	000887	中鼎股份	31,800	389,232.00	0.62
32	000563	陕国投 A	139,500	383,625.00	0.61
33	601233	桐昆股份	23,600	376,656.00	0.60
34	600737	中粮糖业	38,800	372,092.00	0.59

35	600863	内蒙华电	79,900	370,736.00	0.59
36	300253	卫宁健康	62,000	365,800.00	0.58
37	600141	兴发集团	18,900	360,612.00	0.57
38	601198	东兴证券	44,900	357,404.00	0.57
39	002185	华天科技	43,000	350,450.00	0.56
40	603893	瑞芯微	5,700	337,269.00	0.54
41	002409	雅克科技	5,300	333,423.00	0.53
42	603568	伟明环保	16,200	333,396.00	0.53
43	601555	东吴证券	56,400	332,760.00	0.53
44	603379	三美股份	8,500	332,690.00	0.53
45	600398	海澜之家	35,600	328,944.00	0.52
46	002444	巨星科技	13,300	328,510.00	0.52
47	688188	柏楚电子	1,765	325,730.75	0.52
48	600315	上海家化	18,000	320,040.00	0.51
49	600901	江苏金租	62,660	316,433.00	0.50
50	300474	景嘉微	4,900	309,827.00	0.49
51	300395	菲利华	9,900	304,425.00	0.48
52	600096	云天化	15,500	301,010.00	0.48
53	688234	天岳先进	6,400	300,288.00	0.48
54	300776	帝尔激光	6,440	295,982.40	0.47
55	000683	远兴能源	41,000	283,310.00	0.45
56	000060	中金岭南	66,300	281,112.00	0.45
57	002138	顺络电子	10,100	277,346.00	0.44
58	000423	东阿阿胶	4,400	275,440.00	0.44
59	688516	奥特维	6,531	273,061.11	0.43
60	601019	山东出版	22,600	267,132.00	0.42
61	300383	光环新网	31,600	267,020.00	0.42
62	002517	恺英网络	27,800	265,490.00	0.42
63	002572	索菲亚	17,300	265,209.00	0.42
64	002223	鱼跃医疗	7,000	263,200.00	0.42
65	601717	郑煤机	17,700	261,960.00	0.42
66	600885	宏发股份	9,300	257,424.00	0.41
67	000630	铜陵有色	70,900	255,949.00	0.41
68	002028	思源电气	3,800	254,220.00	0.40
69	600598	北大荒	20,100	251,049.00	0.40
70	688777	中控技术	6,620	249,574.00	0.40
71	600642	申能股份	28,100	248,123.00	0.39
72	600380	健康元	22,100	246,857.00	0.39
73	300604	长川科技	8,800	239,096.00	0.38
74	002340	格林美	37,400	238,238.00	0.38
75	600707	彩虹股份	34,900	237,669.00	0.38
76	600988	赤峰黄金	14,400	235,296.00	0.37
77	600566	济川药业	7,400	234,654.00	0.37

78	000513	丽珠集团	6,300	234,423.00	0.37
79	603979	金诚信	4,600	232,438.00	0.37
80	300394	天孚通信	2,600	229,892.00	0.36
81	603712	七一二	12,600	229,194.00	0.36
82	002984	森麒麟	9,500	228,855.00	0.36
83	688169	石头科技	564	221,426.40	0.35
84	601016	节能风电	72,200	215,878.00	0.34
85	601608	中信重工	56,200	214,122.00	0.34
86	002558	巨人网络	22,600	213,344.00	0.34
87	000703	恒逸石化	29,900	211,991.00	0.34
88	300009	安科生物	24,800	211,792.00	0.34
89	688520	神州细胞	5,338	210,050.30	0.33
90	002372	伟星新材	13,600	209,712.00	0.33
91	601991	大唐发电	69,600	209,496.00	0.33
92	002850	科达利	2,700	206,226.00	0.33
93	002507	涪陵榨菜	16,700	204,575.00	0.32
94	688180	君实生物	7,000	203,350.00	0.32
95	600536	中国软件	6,700	200,464.00	0.32
96	600816	建元信托	73,900	200,269.00	0.32
97	601636	旗滨集团	30,800	198,660.00	0.32
98	603156	养元饮品	9,300	197,811.00	0.31
99	000066	中国长城	22,600	197,750.00	0.31
100	601990	南京证券	25,600	196,608.00	0.31
101	300595	欧普康视	12,500	196,000.00	0.31
102	600038	中直股份	4,700	193,217.00	0.31
103	002563	森马服饰	33,200	192,892.00	0.31
104	000883	湖北能源	31,800	191,118.00	0.30
105	601179	中国西电	23,700	190,548.00	0.30
106	000997	新大陆	13,500	187,785.00	0.30
107	688561	奇安信	7,800	184,236.00	0.29
108	688065	凯赛生物	4,000	181,560.00	0.29
109	603939	益丰药房	7,080	173,814.00	0.28
110	688153	唯捷创芯	4,680	173,160.00	0.27
111	603225	新凤鸣	11,100	173,049.00	0.27
112	300866	安克创新	2,420	172,328.20	0.27
113	000818	航锦科技	7,800	172,224.00	0.27
114	002408	齐翔腾达	30,600	171,360.00	0.27
115	002155	湖南黄金	9,300	168,330.00	0.27
116	600399	抚顺特钢	29,800	167,774.00	0.27
117	601118	海南橡胶	36,200	164,710.00	0.26
118	601156	东航物流	8,000	162,800.00	0.26
119	300558	贝达药业	4,900	159,495.00	0.25
120	002797	第一创业	31,200	158,808.00	0.25

121	600862	中航高科	8,400	157,752.00	0.25
122	688525	佰维存储	2,400	153,960.00	0.24
123	002625	光启技术	8,800	152,680.00	0.24
124	688567	孚能科技	15,615	149,904.00	0.24
125	002202	金风科技	20,600	138,432.00	0.22
126	600516	方大炭素	32,000	137,920.00	0.22
127	600208	新潮中宝	86,800	137,144.00	0.22
128	000032	深桑达 A	8,900	133,322.00	0.21
129	300114	中航电测	2,800	126,700.00	0.20
130	300054	鼎龙股份	5,200	117,936.00	0.19
131	002423	中粮资本	15,700	117,593.00	0.19
132	600529	山东药玻	4,600	116,564.00	0.19
133	600985	淮北矿业	6,700	112,158.00	0.18
134	600763	通策医疗	2,000	108,100.00	0.17
135	000050	深天马 A	14,700	107,016.00	0.17
136	688220	翱捷科技	2,850	106,761.00	0.17
137	601933	永辉超市	42,800	106,144.00	0.17
138	600764	中国海防	5,400	106,002.00	0.17
139	603826	坤彩科技	3,640	105,450.80	0.17
140	002203	海亮股份	13,000	103,740.00	0.16
141	600390	五矿资本	25,500	103,275.00	0.16
142	600528	中铁工业	14,000	102,480.00	0.16
143	002065	东华软件	22,600	102,152.00	0.16
144	603658	安图生物	2,200	101,354.00	0.16
145	601216	君正集团	27,300	100,737.00	0.16
146	002607	中公教育	65,400	100,062.00	0.16
147	600998	九州通	20,484	99,961.92	0.16
148	600325	华发股份	15,300	99,450.00	0.16
149	002608	江苏国信	12,800	99,200.00	0.16
150	002414	高德红外	16,800	98,952.00	0.16
151	300676	华大基因	2,800	98,028.00	0.16
152	603786	科博达	1,500	96,225.00	0.15
153	000967	盈峰环境	22,600	95,598.00	0.15
154	600316	洪都航空	5,700	94,791.00	0.15
155	600928	西安银行	28,900	94,503.00	0.15
156	001203	大中矿业	9,800	94,178.00	0.15
157	300146	汤臣倍健	6,900	93,495.00	0.15
158	600848	上海临港	10,200	92,922.00	0.15
159	002945	华林证券	9,200	91,816.00	0.15
160	603338	浙江鼎力	1,500	90,630.00	0.14
161	601000	唐山港	18,600	87,420.00	0.14
162	600521	华海药业	4,700	80,135.00	0.13
163	603087	甘李药业	1,700	78,744.00	0.13

164	688536	思瑞浦	800	78,248.00	0.12
165	688772	珠海冠宇	5,233	77,971.70	0.12
166	600497	驰宏锌锗	14,600	77,964.00	0.12
167	002294	信立泰	2,900	77,227.00	0.12
168	002472	双环传动	3,500	77,070.00	0.12
169	000598	兴蓉环境	10,100	75,952.00	0.12
170	002373	千方科技	8,300	75,281.00	0.12
171	600369	西南证券	20,700	74,106.00	0.12
172	002653	海思科	2,400	73,680.00	0.12
173	002429	兆驰股份	15,300	73,593.00	0.12
174	300024	机器人	7,500	73,050.00	0.12
175	601866	中远海发	28,300	73,014.00	0.12
176	002195	岩山科技	29,000	72,790.00	0.12
177	600637	东方明珠	11,800	71,744.00	0.11
178	601966	玲珑轮胎	3,900	71,643.00	0.11
179	600004	白云机场	7,500	71,100.00	0.11
180	600170	上海建工	33,000	70,950.00	0.11
181	002508	老板电器	3,200	70,720.00	0.11
182	600008	首创环保	26,300	70,484.00	0.11
183	600909	华安证券	16,700	70,307.00	0.11
184	688538	和辉光电	35,411	70,113.78	0.11
185	600166	福田汽车	31,100	69,975.00	0.11
186	000778	新兴铸管	20,100	69,948.00	0.11
187	300296	利亚德	15,500	69,750.00	0.11
188	603858	步长制药	4,600	69,690.00	0.11
189	002044	美年健康	18,400	69,552.00	0.11
189	601098	中南传媒	5,600	69,552.00	0.11
190	002019	亿帆医药	5,600	69,216.00	0.11
191	603650	彤程新材	2,300	67,965.00	0.11
192	603707	健友股份	5,700	67,716.00	0.11
193	600755	厦门国贸	9,400	67,398.00	0.11
194	300390	天华新能	3,910	67,173.80	0.11
195	603885	吉祥航空	6,100	67,039.00	0.11
196	300487	蓝晓科技	1,600	66,816.00	0.11
197	600499	科达制造	7,900	66,597.00	0.11
198	600339	中油工程	21,300	66,456.00	0.11
199	600435	北方导航	7,700	66,374.00	0.11
200	600959	江苏有线	25,100	66,264.00	0.11
201	688425	铁建重工	18,000	66,240.00	0.11
202	300070	碧水源	15,800	66,202.00	0.11
203	600673	东阳光	9,300	65,472.00	0.10
204	601212	白银有色	23,500	65,330.00	0.10
205	601106	中国一重	28,000	64,680.00	0.10

206	002506	协鑫集成	33,300	64,602.00	0.10
207	000898	鞍钢股份	30,400	64,448.00	0.10
208	601228	广州港	20,900	63,745.00	0.10
209	002266	浙富控股	22,800	63,612.00	0.10
210	601928	凤凰传媒	5,800	63,568.00	0.10
211	688387	信科移动	12,600	63,504.00	0.10
212	000987	越秀资本	12,800	63,488.00	0.10
213	600500	中化国际	18,100	63,169.00	0.10
214	002299	圣农发展	4,600	62,744.00	0.10
215	600348	华阳股份	6,100	60,756.00	0.10
216	002153	石基信息	10,600	60,738.00	0.10
217	300888	稳健医疗	2,400	60,720.00	0.10
218	002568	百润股份	3,600	60,588.00	0.10
219	600258	首旅酒店	4,900	60,515.00	0.10
220	000785	居然之家	24,900	60,507.00	0.10
221	688248	南网科技	2,000	59,260.00	0.09
222	601158	重庆水务	12,200	58,560.00	0.09
223	603517	绝味食品	3,800	58,520.00	0.09
224	300017	网宿科技	7,400	58,460.00	0.09
225	002156	通富微电	2,600	58,214.00	0.09
226	301267	华夏眼科	2,800	58,016.00	0.09
227	600927	永安期货	4,800	53,520.00	0.08
228	603228	景旺电子	1,400	44,520.00	0.07
229	000933	神火股份	2,200	44,506.00	0.07
230	600873	梅花生物	4,000	40,080.00	0.06
231	603589	口子窖	1,000	39,190.00	0.06
232	300373	扬杰科技	1,000	38,900.00	0.06
233	600820	隧道股份	5,800	37,874.00	0.06
234	601611	中国核建	4,600	37,214.00	0.06
235	600582	天地科技	5,400	37,206.00	0.06
236	600177	雅戈尔	5,200	37,024.00	0.06
237	001286	陕西能源	3,200	36,896.00	0.06
238	001227	兰州银行	15,500	36,890.00	0.06
238	601997	贵阳银行	7,000	36,890.00	0.06
239	000623	吉林敖东	2,700	36,180.00	0.06
240	603444	吉比特	200	35,602.00	0.06
241	600704	物产中大	8,200	35,588.00	0.06
242	688349	三一重能	1,400	34,776.00	0.06
243	000155	川能动力	3,200	34,464.00	0.05
244	600511	国药股份	1,100	33,869.00	0.05
245	002056	横店东磁	2,700	33,669.00	0.05
246	600871	石化油服	19,300	33,582.00	0.05
247	688002	睿创微纳	1,200	33,564.00	0.05

248	600062	华润双鹤	1,700	33,286.00	0.05
249	000709	河钢股份	17,000	32,980.00	0.05
250	603456	九洲药业	2,400	32,928.00	0.05
251	002244	滨江集团	4,500	32,670.00	0.05
252	600967	内蒙一机	4,500	32,400.00	0.05
253	000878	云南铜业	2,600	32,396.00	0.05
254	603077	和邦生物	19,200	31,680.00	0.05
255	600517	国网英大	7,300	31,609.00	0.05
256	600563	法拉电子	400	30,472.00	0.05
257	600580	卧龙电驱	2,500	30,375.00	0.05
258	601577	长沙银行	3,700	30,266.00	0.05
259	000937	冀中能源	4,500	30,150.00	0.05
260	300861	美畅股份	1,500	29,025.00	0.05
261	002384	东山精密	1,400	28,980.00	0.05
262	603317	天味食品	2,500	28,525.00	0.05
263	601992	金隅集团	20,800	28,496.00	0.05
264	603486	科沃斯	600	28,308.00	0.04
265	603233	大参林	1,800	25,740.00	0.04
266	002025	航天电器	500	23,190.00	0.04
267	688281	华秦科技	246	20,496.72	0.03
268	600352	浙江龙盛	2,100	18,039.00	0.03
269	002936	郑州银行	9,730	16,832.90	0.03
270	600970	中材国际	1,300	15,678.00	0.02
271	002518	科士达	800	14,160.00	0.02
272	300765	新诺威	500	12,615.00	0.02
273	600373	中文传媒	600	8,904.00	0.01
274	300136	信维通信	400	7,832.00	0.01
275	601399	国机重装	2,800	7,224.00	0.01
276	688099	晶晨股份	42	2,491.44	0.00
277	688819	天能股份	100	2,386.00	0.00
278	603737	三棵树	40	1,450.80	0.00
279	689009	九号公司	22	809.82	0.00
280	301029	怡合达	40	786.40	0.00
281	688006	杭可科技	43	750.35	0.00
282	600486	扬农化工	10	564.50	0.00
283	002407	多氟多	40	489.20	0.00
284	688779	长远锂科	8	37.04	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	300783	三只松鼠	30,000	656,100.00	1.04
2	002533	金杯电工	47,500	472,625.00	0.75
3	688159	有方科技	12,200	461,892.00	0.73

4	300115	长盈精密	37,000	443,630.00	0.70
5	300218	安利股份	27,300	411,684.00	0.65
6	000551	创元科技	46,000	401,580.00	0.64
7	600861	北京人力	21,100	344,352.00	0.55
8	603501	韦尔股份	3,300	327,921.00	0.52
9	300254	仟源医药	37,200	292,392.00	0.46
10	601886	江河集团	58,800	286,944.00	0.46
11	600966	博汇纸业	60,000	286,800.00	0.46
12	300241	瑞丰光电	55,000	225,500.00	0.36
13	300879	大叶股份	16,300	218,094.00	0.35
14	300562	乐心医疗	24,300	216,513.00	0.34
15	600697	欧亚集团	21,200	213,060.00	0.34
16	603967	中创物流	22,800	212,040.00	0.34
17	603236	移远通信	4,500	210,285.00	0.33
18	002839	张家港行	52,200	209,844.00	0.33
19	300441	鲍斯股份	35,300	209,329.00	0.33
20	603089	正裕工业	24,800	207,328.00	0.33
21	601113	华鼎股份	63,100	206,968.00	0.33
22	002697	红旗连锁	44,700	206,961.00	0.33
23	603096	新经典	12,200	206,180.00	0.33
24	300628	亿联网络	5,600	205,912.00	0.33
25	600128	苏豪弘业	32,200	205,114.00	0.33
26	300119	瑞普生物	14,800	201,576.00	0.32
27	600176	中国巨石	18,200	201,110.00	0.32
28	688369	致远互联	12,600	198,198.00	0.31
29	605208	永茂泰	31,600	196,868.00	0.31
30	600300	维维股份	81,800	196,320.00	0.31
31	002701	奥瑞金	46,400	193,024.00	0.31
32	002630	华西能源	89,500	189,740.00	0.30
33	600711	盛屯矿业	51,700	189,739.00	0.30
34	600327	大东方	59,200	189,440.00	0.30
35	300842	帝科股份	4,700	182,360.00	0.29
36	603368	柳药集团	10,300	180,250.00	0.29
37	002602	世纪华通	52,100	178,703.00	0.28
38	600729	重庆百货	7,800	174,408.00	0.28
39	688226	威腾电气	9,894	172,947.12	0.27
40	688016	心脉医疗	1,718	168,449.90	0.27
41	605258	协和电子	500	15,680.00	0.02
42	603605	珀莱雅	40	4,439.60	0.01
43	688503	聚和材料	139	3,905.90	0.01
44	300750	宁德时代	20	3,600.60	0.01
45	688237	超卓航科	139	2,786.95	0.00
46	688105	诺唯赞	82	1,640.82	0.00

47	000028	国药一致	50	1,611.50	0.00
48	688208	道通科技	53	1,279.42	0.00
49	688004	博汇科技	92	1,007.40	0.00
50	300785	值得买	50	845.50	0.00
51	603052	可川科技	28	788.20	0.00
52	603505	金石资源	24	670.32	0.00
53	688299	长阳科技	45	575.55	0.00
54	688508	芯朋微	1	36.37	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	002422	科伦药业	1,087,567.00	1.27
2	300677	英科医疗	1,052,745.00	1.23
3	002958	青农商行	1,012,087.00	1.18
4	300144	宋城演艺	958,473.00	1.12
5	300502	新易盛	835,585.00	0.98
6	300783	三只松鼠	835,142.00	0.98
7	000400	许继电气	822,917.00	0.96
8	002444	巨星科技	802,342.00	0.94
9	002532	天山铝业	783,957.00	0.92
10	300251	光线传媒	770,256.00	0.90
11	688208	道通科技	762,979.45	0.89
12	002533	金杯电工	758,552.00	0.89
13	300395	菲利华	754,131.00	0.88
14	601615	明阳智能	750,270.00	0.88
15	601058	赛轮轮胎	743,199.00	0.87
16	300207	欣旺达	726,430.00	0.85
17	600861	北京人力	714,523.00	0.84
18	300724	捷佳伟创	712,021.00	0.83
19	002008	大族激光	702,983.00	0.82
20	600863	内蒙华电	688,236.00	0.81

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	600153	建发股份	1,657,384.00	1.94
2	002422	科伦药业	1,092,104.00	1.28
3	688169	石头科技	1,035,338.41	1.21
4	600258	首旅酒店	998,986.00	1.17

5	603228	景旺电子	960,421.00	1.12
6	688208	道通科技	901,542.30	1.06
7	000539	粤电力 A	893,829.00	1.05
8	300144	宋城演艺	873,784.00	1.02
9	002739	万达电影	848,166.00	0.99
10	000975	银泰黄金	843,085.00	0.99
11	300253	卫宁健康	842,832.00	0.99
12	600970	中材国际	823,922.00	0.96
13	600707	彩虹股份	806,767.00	0.94
14	601058	赛轮轮胎	774,296.00	0.91
15	601933	永辉超市	766,269.00	0.90
16	601717	郑煤机	762,992.00	0.89
17	002463	沪电股份	761,706.00	0.89
18	002867	周大生	746,955.00	0.87
19	600066	宇通客车	737,849.00	0.86
20	600737	中粮糖业	735,957.00	0.86

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	148,922,823.85
卖出股票收入（成交）总额	167,209,974.82

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

华宝中证 500 增强截止 2024 年 06 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中，青岛农村商业银行股份有限公司因监管标准化（EAST）数据错报漏报；于 2024 年 01 月 02 日收到国家金融监督管理总局青岛监管局罚款的处罚措施。

华宝中证 500 增强截止 2024 年 06 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中，许继电气股份有限公司因未履行信披义务，重大事项信息披露不及时或违规，内部制度不完善；于 2024 年 04 月 29 日收到河南证监局责令改正，记入诚信档案的处罚措施。

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。

7.12.2 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	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	58,870.46
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	58,870.46

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	3,285	7,295.72	10,095,201.35	42.12	13,871,233.16	57.88
华宝中证 500 增强 C	2,819	14,339.63	465,904.46	1.15	39,957,501.66	98.85
合计	6,104	10,548.79	10,561,105.81	16.40	53,828,734.82	83.60

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	170,066.45	0.7096
	华宝中证 500 增强 C	42,847.80	0.1060
	合计	212,914.25	0.3307

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	15.53	10,000,450.05	15.53	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	15.53	10,000,450.05	15.53	-

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	26,697,284.10	56,964,136.92
本报告期基金总申购 份额	1,398,872.49	11,496,252.12
减：本报告期基金总 赎回份额	4,129,722.08	28,036,982.92
本报告期基金拆分变 动份额	-	-

本报告期末基金份额总额	23,966,434.51	40,423,406.12
-------------	---------------	---------------

§ 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管理人、基金财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：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 (%)	

上海证券	4	316,132,798.67	100.00	268,783.18	100.00	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-

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： 资质雄厚，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情况稳定；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，并能为本基金提供全面的信息服；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. 本期交易单元未发生变化。

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	华宝基金关于华宝中证 500 指数增强型发起式证券投资基金新增上海大智慧基金销售有限公司为代销机构的通知	基金管理人网站	2024-01-17
2	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	2024-01-19
3	华宝中证 500 指数增强型发起式证券投资基金 2023 年第 4 季度报告	基金管理人网站	2024-01-19
4	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	2024-03-27
5	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	2024-03-29
6	华宝中证 500 指数增强型发起式证券投资基金 2023 年年度报告	基金管理人网站	2024-03-29
7	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	2024-04-19
8	华宝基金关于旗下部分基金新增华西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	2024-05-09

		券时报, 中国证券报	
9	华宝基金关于旗下部分基金新增国信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	2024-05-21
10	华宝基金关于旗下部分基金新增湘财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	2024-06-21
11	华宝中证 500 指数增强型发起式证券投资基金 (A 类份额) 基金产品资料概要 (更新)	基金管理人网站	2024-06-28
12	华宝中证 500 指数增强型发起式证券投资基金 (C 类份额) 基金产品资料概要 (更新)	基金管理人网站	2024-06-28

§ 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

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

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

2024 年 8 月 30 日