

华宝沪深 300 指数增强型发起式证券投资  
基金  
2021 年第 3 季度报告

2021 年 9 月 30 日

基金管理人：华宝基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：2021 年 10 月 27 日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 10 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 07 月 01 日起至 09 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	华宝沪深 300 增强
基金主代码	003876
基金运作方式	契约型开放式、发起式
基金合同生效日	2016 年 12 月 9 日
报告期末基金份额总额	325,949,017.37 份
投资目标	本基金为沪深 300 指数增强型基金，在实现对沪深 300 指数有效跟踪的基础上，通过数量化的方法进行积极的组合配置和管理，力争实现稳定的优于标的指数的投资收益，追求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金主要投资于沪深 300 指数成分股及备选股票。同时，基于流动性管理及策略性投资的需要，本基金也会在控制风险前提下适度投资于债券、股指期货、货币市场工具及其他金融工具。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。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×95%+1.5%（指年收益率，评价时

	按期间折算)	
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。	
基金管理人	华宝基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	华宝沪深 300 增强	华宝沪深 300 增强 C
下属分级基金的交易代码	003876	007404
报告期末下属分级基金的份额总额	282,428,543.32 份	43,520,474.05 份

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2021 年 7 月 1 日-2021 年 9 月 30 日）	
	华宝沪深 300 增强	华宝沪深 300 增强 C
1. 本期已实现收益	18,362,843.57	2,763,926.00
2. 本期利润	-30,841,107.33	-4,482,713.24
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.1158	-0.1080
4. 期末基金资产净值	588,926,512.51	89,935,328.22
5. 期末基金份额净值	2.0852	2.0665

注：1. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华宝沪深 300 增强

阶段	净值增长率①	净值增长率标准 差②	业绩比较基准 收益率③	业绩比较基准 收益率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	-5.30%	1.27%	-6.14%	1.14%	0.84%	0.13%

过去六个月	0.97%	1.13%	-2.67%	1.04%	3.64%	0.09%
过去一年	11.74%	1.22%	7.44%	1.15%	4.30%	0.07%
过去三年	82.29%	1.33%	45.90%	1.29%	36.39%	0.04%
自基金合同 生效起至今	108.52%	1.20%	48.74%	1.15%	59.78%	0.05%

华宝沪深 300 增强 C

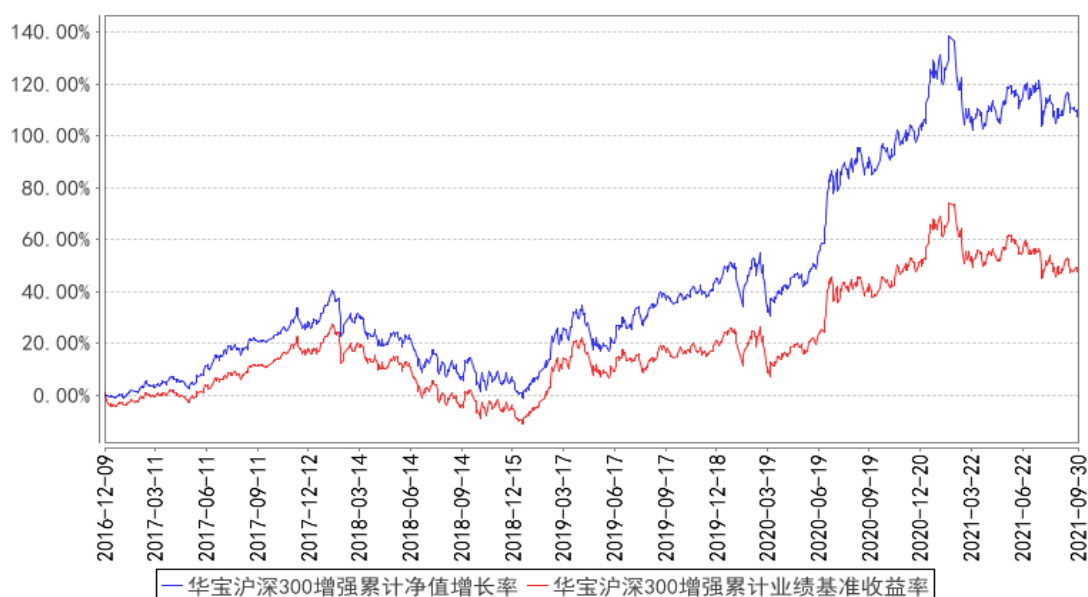
阶段	净值增长率①	净值增长率标准 差②	业绩比较基准 收益率③	业绩比较基准 收益率标准差 ④	①—③	②—④
过去三个月	-5.39%	1.26%	-6.14%	1.14%	0.75%	0.12%
过去六个月	0.77%	1.13%	-2.67%	1.04%	3.44%	0.09%
过去一年	11.29%	1.22%	7.44%	1.15%	3.85%	0.07%
自基金合同 生效起至今	75.71%	1.24%	38.43%	1.20%	37.28%	0.04%

注：（1）基金业绩基准：沪深 300 指数收益率×95%+1.5%（指年收益率，评价时按期间折算）；

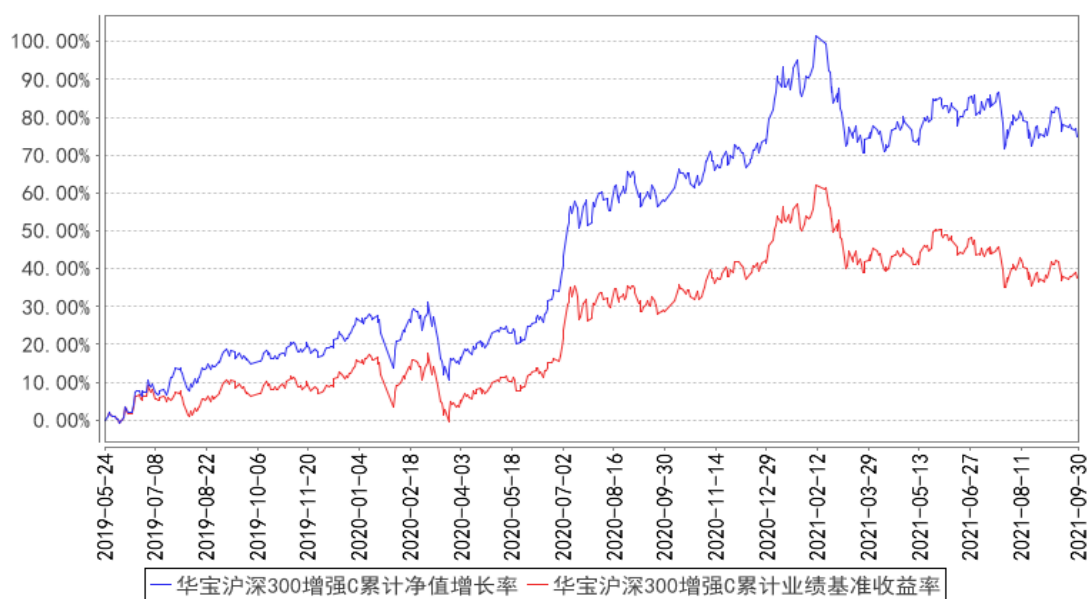
（2）净值以及比较基准相关数据计算中涉及天数的，包括所有交易日以及季末最后一自然日（如非交易日）。

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

华宝沪深300增强累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



华宝沪深300增强C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、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六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 2017 年 06 月 09 日，本基金已达到合同规定的资产配置比例。  
2、本基金 C 份额成立于 2019 年 5 月 24 日。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王正	本基金基金经理	2020-01-02	-	9 年	硕士。2012 年 7 月加入华宝基金管理有限公司，先后担任助理量化分析师、分析师、基金经理助理等职务。2020 年 1 月起任华宝量化对冲策略混合型发起式证券投资基金、华宝沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金基金经理，2021 年 1 月起任华宝第三产业灵活配置混合型证券投资基金、华宝中证 500 指数增强型发起式证券投资基金和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 6 月起任华宝安盈混合型证券投资基金基金经理。
徐林明	本基金基金经理、量化投资总监	2016-12-09	-	19 年	硕士。曾在兴业证券、凯龙财经（上海）有限公司、中原证券从事金融工程研究工作。2005 年 8 月加入华宝基金管理有限公司，先后担任金融工程部数量分析师、

	(MD)、量化投资部总经理			金融工程部副总经理等职务, 现任量化投资总监 (MD)、量化投资部总经理。2009 年 9 月至 2015 年 11 月任华宝中证 100 指数证券投资基金基金经理, 2010 年 4 月至 2015 年 11 月任上证 180 价值交易型开放式指数证券投资基金、华宝上证 180 价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理, 2014 年 9 月至 2020 年 2 月任华宝量化对冲策略混合型发起式证券投资基金基金经理, 2015 年 4 月起任华宝事件驱动混合型证券投资基金基金经理, 2016 年 12 月起任华宝沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金基金经理, 2019 年 2 月起任华宝科技先锋混合型证券投资基金基金经理。
--	---------------	--	--	---

注：1、任职日期以及离任日期均以基金公告为准。

2、证券从业含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《华宝沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋取最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 公平交易专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，基金管理人未发生所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%。

本报告期内，本基金没有发现异常交易行为。

#### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

宏观环境来看，在疫情仍有局部扰动、能耗双控与限电、地产调控政策持续的背景下，三季度国内经济增速放缓，各主要经济指标继续走弱，同时以动力煤为代表的大宗商品价格持续强势上涨。从货币政策来看，央行继 7 月超预期降准后，亦始终保持稳健灵活的公开市场操作，国内流动性整体相对宽松。市场方面，三季度波动性较二季度有所增加，期间沪深 300 指数累计下跌 6.85%，创业板指下跌 6.69%，而中证 500 指数上涨 4.34%。从中微观来看，市场行业和细分板块的分化仍普遍存在，结构性行情继续延续。行业层面，受大宗商品价格上涨的带动，以采掘、有色、钢铁、化工为代表的周期板块表现亮眼，而金融及消费普遍较弱，医药生物、休闲服务、食品饮料等跌幅居前，但在季度末的时候出现反转的迹象。因子层面，三季度整体风格偏小盘价值，盈利及成长表现一般。当前市场分化较为极致，景气度及业绩的变化趋势、成长的持续性和确定性仍是市场非常看重的要素，同时更加关注估值层面的约束，合理估值下的盈利能力和成长性仍然是判断股票投资价值的重要方向。

沪深 300 增强基金运用量化 Alpha 多因子选股模型和行业配置模型进行股票筛选和权重配置，在沪深 300 成分股及备选股内精选业绩和估值相匹配、基本面优质的股票，在有限的跟踪误差下力争实现稳定的超越指数的表现。三季度各因子波动较大，超额较难获取，整体略跑赢基准。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金份额 A 净值增长率为-5.30%，本报告期基金份额 C 净值增长率为-5.39%；同期业绩比较基准收益率为-6.14%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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

## § 5 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	579,995,107.15	83.63
	其中：股票	579,995,107.15	83.63
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	825,130.48	0.12
	其中：债券	825,130.48	0.12

	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	103,453,005.39	14.92
8	其他资产	9,262,772.96	1.34
9	合计	693,536,015.98	100.00

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	4,226,687.00	0.62
B	采矿业	15,044,021.00	2.22
C	制造业	251,035,082.39	36.98
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,059,126.00	1.19
E	建筑业	11,165,075.00	1.64
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	14,643,049.00	2.16
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,636,135.42	1.71
J	金融业	132,544,997.72	19.52
K	房地产业	19,419,962.00	2.86
L	租赁和商务服务业	12,234,160.00	1.80
M	科学研究和技术服务业	20,165,576.00	2.97
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	5,738,380.00	0.85
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	505,912,251.53	74.52

### 5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	18,116.82	0.00
B	采矿业	-	-
C	制造业	57,462,012.70	8.46
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,770,814.00	0.85



E	建筑业	20,183.39	0.00
F	批发和零售业	77,729.83	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	5,805,224.00	0.86
H	住宿和餐饮业	3,345.12	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,626,887.92	0.24
J	金融业	-	-
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	32,194.84	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	38,613.78	0.01
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	3,227,733.22	0.48
S	综合	-	-
	合计	74,082,855.62	10.91

### 5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

### 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

#### 5.3.1 报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	16,100	29,463,000.00	4.34
2	600036	招商银行	435,601	21,976,070.45	3.24
3	000858	五粮液	74,561	16,357,937.79	2.41
4	603259	药明康德	95,420	14,580,176.00	2.15
5	600887	伊利股份	292,600	11,031,020.00	1.62
6	300059	东方财富	304,299	10,458,756.63	1.54
7	601012	隆基股份	119,100	9,823,368.00	1.45
8	600030	中信证券	368,200	9,308,096.00	1.37
9	000333	美的集团	131,100	9,124,560.00	1.34
10	600809	山西汾酒	26,880	8,480,640.00	1.25

#### 5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	000739	普洛药业	149,400	5,704,092.00	0.84

2	600702	舍得酒业	26,800	5,531,520.00	0.81
3	000999	华润三九	132,400	3,744,272.00	0.55
4	300373	扬杰科技	77,800	3,466,768.00	0.51
5	600110	诺德股份	155,600	3,331,396.00	0.49

### 5.3.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的全国中小企业股份转让系统挂牌股票投资明细

本基金本报告期末未持有全国中小企业股份转让系统挂牌股票。

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	6,004.80	0.00
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	819,125.68	0.12
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	825,130.48	0.12

### 5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	123111	东财转 3	5,284	819,125.68	0.12
2	019649	21 国债 01	60	6,004.80	0.00

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

### 5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

### 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量 (买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动 (元)	风险说明
IF2110	IF2110	30	43,795,800.00	-90,000.00	-
IF2111	IF2111	3	4,366,440.00	-18,900.00	-
IF2112	IF2112	8	11,609,760.00	75,780.00	-
公允价值变动总额合计 (元)					-33,120.00
股指期货投资本期收益 (元)					-1,966,825.32
股指期货投资本期公允价值变动 (元)					162,145.32

### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

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

## 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金未投资国债期货。

### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金未投资国债期货。

### 5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

## 5.11 投资组合报告附注

### 5.11.1

沪深 300 增强基金截至 2021 年 9 月 30 日持仓前十名证券中的招商银行（600036）的发行人招商银行股份有限公司于 2021 年 5 月 21 日公告，因公司存在以下违规行为：一、为同业投资提供第三方信用担保、为非保本理财产品出具保本承诺，部分未按规定计提风险加权资产；二、违规协助无衍生产品交易业务资格的银行发行结构性衍生产品；三、理财产品之间风险隔离不到位；四、理财资金投资非标准化债权资产认定不准确，实际余额超监管标准；五、同业投资接受第三

方金融机构信用担保；六、理财资金池化运作；七、利用理财产品准备金调节收益；八、高净值客户认定不审慎；九、并表管理不到位，通过关联非银机构的内部交易，违规变相降低理财产品销售门槛；十、投资集合资金信托计划的理财产品未执行合格投资者标准；十一、投资集合资金信托计划人数超限；十二、面向不合格个人投资者销售投资高风险资产或权益性资产的理财产品；十三、信贷资产非真实转让；十四、全权委托业务不规范；十五、未按要求向监管机构报告理财投资合作机构，被监管否决后仍未及时停办业务；十六、通过关联机构引入非合格投资者，受让以本行信用卡债权设立的信托次级受益权；十七、“智能投资受托计划业务”通过其他方式规避整改，扩大业务规模，且业务数据和材料缺失；十八、票据转贴现假卖断屡查屡犯；十九、贷款、理财或同业投资资金违规投向土地储备项目；二十、理财资金违规提供棚改项目资本金融资，向地方政府提供融资并要求地方政府提供担保；二十一、同业投资、理财资金等违规投向地价款或四证不全的房地产项目；二十二、理财资金认购商业银行增发的股票；二十三、违规为企业发行短期融资券提供搭桥融资，并用理财产品投资本行主承债券以承接表内类信贷资产；二十四、为定制公募基金提供投资顾问；二十五、为本行承销债券兑付提供资金支持；二十六、协助发行人以非市场化的价格发行债券；二十七、瞒报案件信息；于 2021 年 5 月 17 日收到中国银行保险监督管理委员会罚款 7170 万元的处罚。

沪深 300 增强基金截至 2021 年 9 月 30 日持仓前十名证券中的中信证券（600030）的发行人中信证券股份有限公司存在：一、私募基金托管业务内部控制不够完善，个别项目履职不谨慎；二、个别首次公开发行保荐项目执业质量不高，存在对发行人现金交易等情况关注和披露不充分、不准确，对发行人收入确认依据、补贴可回收性等情况核查不充分等问题；三、公司个别资管产品未按《证券公司定向资产管理业务实施细则》（证监会公告〔2012〕30 号）第二十九条第二款规定，根据合同约定的时间和方式向客户提供对账单，说明报告期内客户委托资产的配置状况、净值变动、交易记录等情况；于 2021 年 2 月 10 日收到深圳证监局采取责令改正的监督管理措施。

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八名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

## 5.11.2

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	7,284,430.76
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	22,143.82
5	应收申购款	1,956,198.38
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,262,772.96

### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

### 5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，合计数可能不等于分项之和。

## §6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华宝沪深 300 增强	华宝沪深 300 增强 C
报告期期初基金份额总额	264,764,075.59	28,593,723.52
报告期期间基金总申购份额	56,157,434.19	28,551,591.55
减：报告期期间基金总赎回份额	38,492,966.46	13,624,841.02
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	282,428,543.32	43,520,474.05

## §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

项目	华宝沪深 300 增强	华宝沪深 300 增强 C
报告期期初管理人持有的本基金份额	478,795.12	-
报告期期间买入/申购总份额	-	-
报告期期间卖出/赎回总份额	478,795.12	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	-	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例 (%)	0.00	-

## 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率(%)
1	赎回	20210823	478,795.12	979,806.33	-
合计			478,795.12	979,806.33	

注：交易日期为确认日期，交易金额为确认金额。

## § 8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例(%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例(%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	-	-	10,000,450.05	3.07	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	3.07	-

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

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

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

## § 9 影响投资者决策的其他重要信息

### 9.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

## 9.2 影响投资者决策的其他重要信息

2021 年 8 月 25 日，基金管理人发布高级管理人员变更公告，李慧勇不再担任公司副总经理。

## § 10 备查文件目录

### 10.1 备查文件目录

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

### 10.2 存放地点

以上文件存于基金管理人及基金托管人办公场所备投资者查阅。

### 10.3 查阅方式

投资者可以通过基金管理人网站，查阅或下载基金合同、招募说明书、托管协议及基金的各种定期和临时公告。

华宝基金管理有限公司

2021 年 10 月 27 日