

华宝量化对冲策略混合型发起式证券投资
基金
2024 年第 3 季度报告

2024 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：中国银行股份有限公司

报告送出日期：2024 年 10 月 25 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 10 月 23 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 2024 年 07 月 01 日起至 09 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华宝量化对冲混合
基金主代码	000753
基金运作方式	契约型开放式、发起式
基金合同生效日	2014 年 9 月 17 日
报告期末基金份额总额	952,971,364.98 份
投资目标	在有效控制风险的基础上，运用股指期货等衍生工具对冲市场系统风险，追求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	在资产配置方面，本基金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。股票方面，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。
业绩比较基准	一年期银行定期存款利率（税后）

风险收益特征	本基金为特殊类型的混合型基金, 主要采用追求绝对收益的市场中性策略, 与股票市场表现的相关性较低。相对股票型基金和一般的混合型基金, 其预期风险较小。本基金实际的收益和风险主要取决于基金投资策略的有效性, 因此收益不一定能超越业绩比较基准。		
基金管理人	华宝基金管理有限公司		
基金托管人	中国银行股份有限公司		
下属分级基金的基金简称	华宝量化对冲混合 A	华宝量化对冲混合 C	华宝量化对冲混合 D
下属分级基金的交易代码	000753	000754	021381
报告期末下属分级基金的份额总额	332, 991, 080. 17 份	257, 909, 547. 48 份	362, 070, 737. 33 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 (2024 年 7 月 1 日-2024 年 9 月 30 日)		
	华宝量化对冲混合 A	华宝量化对冲混合 C	华宝量化对冲混合 D
1. 本期已实现收益	2, 187, 430. 02	1, 161, 372. 01	1, 656, 054. 69
2. 本期利润	-12, 663, 232. 68	-9, 017, 864. 64	-12, 059, 950. 51
3. 加权平均基金份额本期利润	-0. 0450	-0. 0422	-0. 0762
4. 期末基金资产净值	378, 827, 640. 75	284, 713, 842. 35	411, 655, 675. 12
5. 期末基金份额净值	1. 1377	1. 1039	1. 1369

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。

3.2 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

华宝量化对冲混合 A

阶段	净值增长率①	净值增长率②	业绩比较基准③	业绩比较基准④	①-③	②-④
----	--------	--------	---------	---------	-----	-----

		准差②	收益率③	收益率标准差 ④		
过去三个月	-3.03%	0.29%	0.38%	0.00%	-3.41%	0.29%
过去六个月	-1.90%	0.27%	0.75%	0.00%	-2.65%	0.27%
过去一年	1.06%	0.26%	1.50%	0.00%	-0.44%	0.26%
过去三年	-3.77%	0.24%	4.50%	0.00%	-8.27%	0.24%
过去五年	6.66%	0.24%	7.50%	0.00%	-0.84%	0.24%
自基金合同 生效起至今	39.79%	0.27%	16.09%	0.01%	23.70%	0.26%

华宝量化对冲混合 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	-3.14%	0.29%	0.38%	0.00%	-3.52%	0.29%
过去六个月	-2.10%	0.27%	0.75%	0.00%	-2.85%	0.27%
过去一年	0.65%	0.26%	1.50%	0.00%	-0.85%	0.26%
过去三年	-4.93%	0.24%	4.50%	0.00%	-9.43%	0.24%
过去五年	4.54%	0.24%	7.50%	0.00%	-2.96%	0.24%
自基金合同 生效起至今	35.68%	0.27%	16.09%	0.01%	19.59%	0.26%

华宝量化对冲混合 D

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	-3.09%	0.29%	0.38%	0.00%	-3.47%	0.29%
过去六个月	-	-	-	-	-	-
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-

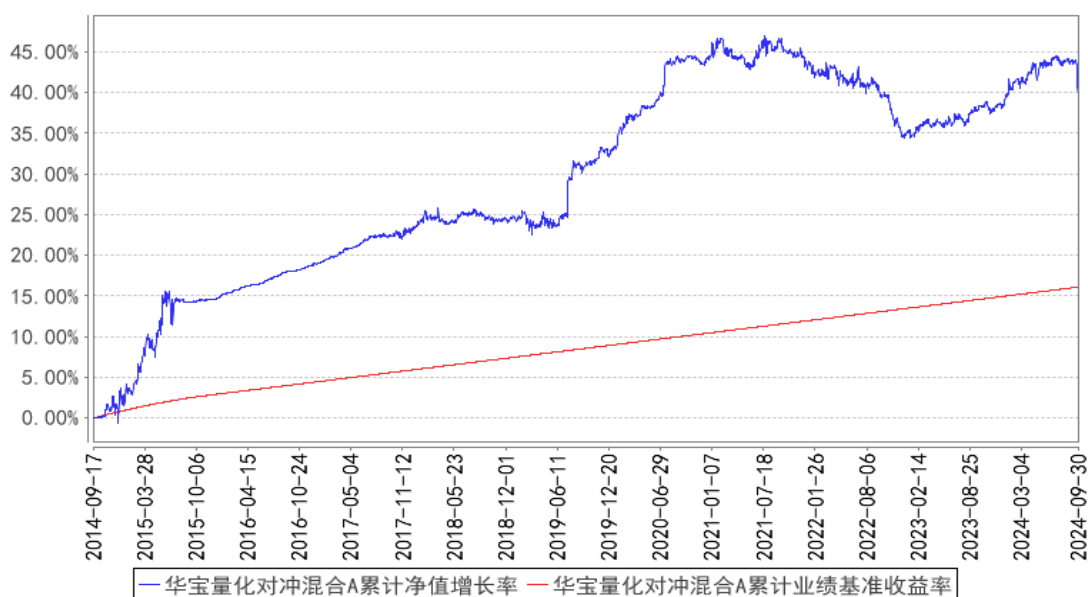
自基金合同 生效起至今	-1.92%	0.27%	0.65%	0.00%	-2.57%	0.27%
----------------	--------	-------	-------	-------	--------	-------

注：（1）基金业绩基准：一年期银行定期存款利率（税后）；

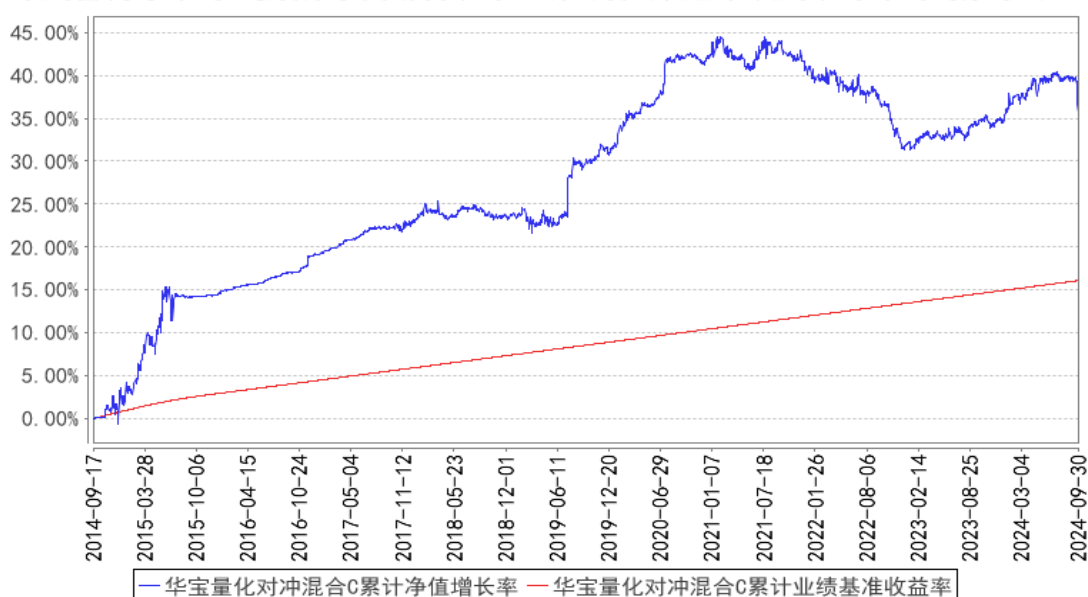
（2）净值以及比较基准相关数据计算中涉及天数的，包括所有交易日以及季末最后一自然日（如非交易日）。

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

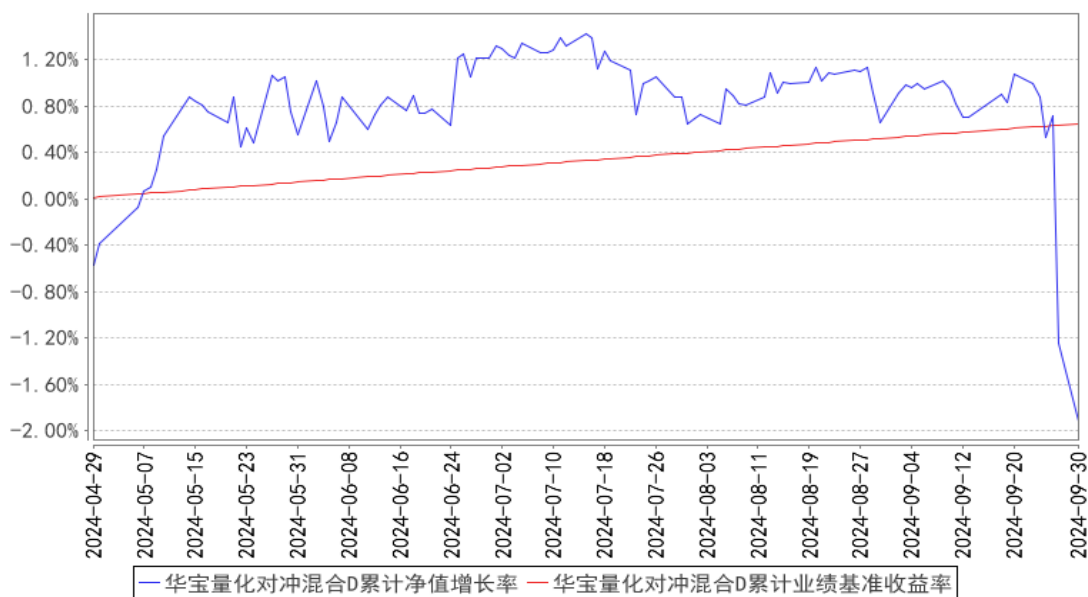
华宝量化对冲混合A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



华宝量化对冲混合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



华宝量化对冲混合D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 2015 年 03 月 17 日，本基金已达到合同规定的资产配置比例。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
徐林明	本基金基金经理、量化投资总监、量化投资部总经理	2014-09-17	-	22 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、金融工程部副总经理等职务，现任量化投资总监、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 月起任华宝量化对冲策略混合型发起式证券投资基金基金经理，2015 年 4 月至 2020 年 2 月任华宝事件驱动混合型证券投资基金基金经理，2016 年 12 月起任华宝沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金基金经理，2019 年 2 月至 2022 年 10 月任华宝科技先锋混合型证券投资基金基金经理，2021 年 12

					月至 2023 年 11 月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 月至 2023 年 11 月任华宝高端装备股票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。
王正	本基金基金经理	2020-01-02	-	12 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 月至 2022 年 7 月任华宝中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金经理，2021 年 1 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 1 月至 2024 年 7 月任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 6 月至 2023 年 3 月任华宝安盈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《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。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期内，本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，基金管理人通过严格执行投资决策委员会议事规则、公司股票库管理制度、中央交易室制度、防火墙机制、系统中的公平交易程序、每日交易日结报告、定期基金投资绩效评价等机制，确保所管理的所有投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投

资产管理活动和环节得到公平对待。同时，基金管理人严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定和公司内部制度要求，分析了本公司旗下所有投资组合之间的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异以及连续四个季度期间内、不同时间窗下同向交易的交易价差；分析结果未发现异常情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

本报告期内，本基金未发现异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

三季度全球宏观及地缘风险依然没有改善的迹象，美国经济不确定性持续，美股市场围绕经济数据波动加大，主要资产价格多表现为震荡，9 月美联储本轮加息以来首次降息 50 基点，俄乌和中东冲突局势未明。国内方面，三季度经济数据继续承压，9 月下旬一系列提振经济和资本市场的货币和财政政策逐步推出，政治局会议表态超预期，政策底基本确立。

股票市场方面，三季度市场主要受到政策驱动以 9 月 24 日为分水岭呈现前低后高的走势。区间累计来看，三季度科技成长类指数以及非银金融指数涨幅较高，红利价值类指数涨幅靠后，报告期沪深 300 指数上涨 16.07%，中证红利指数上涨 6.43%，中证 2000 指数上涨 17.67%，创业板指数上涨 29.21%。行业层面，证券、保险、房地产、计算机、半导体等较为强势，而煤炭、石油石化、公用事业等走势较弱。因子层面，行业中性视角下，三季度沪深 300 内长期符合逻辑的基本面因子多数表现正常，价值、成长、盈利质量等因子累计录得正超额，但技术面因子中低波、低换手因子跑输，市场呈现高波、高换手风格（9 月底的短期暴涨行情中因子表现较为异常）。

选股方面通过量化 Alpha 多因子选股模型，在期指对应的指数成分股及备选股中精选估值和业绩相匹配、基本面优质、经营稳健、具有核心竞争力的标的。本报告期，基金仍然坚持稳健的市场中性投资策略，利用股指期货对股票组合进行对冲，剥离系统性风险。报告期内各期指升贴水情况跟市场情绪高度相关，前期市场低迷时各合约贴水加深，后期市场情绪提振期指迅速转为大幅升水且幅度一度达到 14-15 年的极端值，对净值造成一定的波动和回撤。在大幅波动的市场环境中基金始终保持中性操作，仓位头寸管理得当，未出现追保不及时被强平的风险。后续随着市场情绪降温，预计基差和 alpha 均会得到修复，同时期指回归升水意味着中长期的对冲成本降低，对未来的对冲运作较为友好。

4.5 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-3.03%，本报告期基金份额 C 类净值增长率为-3.14%，本报告期基金份额 D 类净值增长率为-3.09%；同期业绩比较基准收益率为 0.38%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	877,155,563.75	74.03
	其中：股票	877,155,563.75	74.03
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	63,405,510.50	5.35
	其中：债券	63,405,510.50	5.35
	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	68,306,149.43	5.76
8	其他资产	176,014,552.28	14.86
9	合计	1,184,881,775.96	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）。

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	3,439,112.00	0.32
B	采矿业	41,109,352.00	3.82
C	制造业	480,896,949.45	44.73
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	34,579,404.00	3.22
E	建筑业	17,675,883.40	1.64

F	批发和零售业	9,275,062.60	0.86
G	交通运输、仓储和邮政业	30,250,212.80	2.81
H	住宿和餐饮业	218,195.00	0.02
I	信息传输、软件和信息技术服务业	37,574,819.13	3.49
J	金融业	194,183,132.70	18.06
K	房地产业	8,558,484.00	0.80
L	租赁和商务服务业	6,960,882.00	0.65
M	科学研究和技术服务业	8,187,544.67	0.76
N	水利、环境和公共设施管理业	909,888.00	0.08
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	2,607,649.00	0.24
R	文化、体育和娱乐业	728,993.00	0.07
S	综合	-	-
	合计	877,155,563.75	81.58

5.2.2 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	25,504	44,580,992.00	4.15
2	300750	宁德时代	111,460	28,075,659.40	2.61
3	601318	中国平安	473,400	27,026,406.00	2.51
4	600036	招商银行	444,800	16,728,928.00	1.56
5	000333	美的集团	219,898	16,725,441.88	1.56
6	601166	兴业银行	775,600	14,945,812.00	1.39
7	600900	长江电力	457,400	13,744,870.00	1.28
8	000651	格力电器	262,000	12,560,280.00	1.17
9	600030	中信证券	426,436	11,599,059.20	1.08
10	002475	立讯精密	262,300	11,399,558.00	1.06

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	63,405,510.50	5.90
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）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	63,405,510.50	5.90

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	019727	23 国债 24	194,000	19,828,500.82	1.84
2	019698	23 国债 05	155,000	15,763,139.04	1.47
3	019740	24 国债 09	75,000	7,558,697.26	0.70
4	019733	24 国债 02	74,000	7,511,525.10	0.70
5	019631	20 国债 05	50,000	5,056,705.48	0.47

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
IC2410	IC2410	-24	-28,290,240.00	-7,113,240.00	-
IC2411	IC2411	-2	-2,353,840.00	-455,840.00	-
IC2412	IC2412	-52	-61,231,040.00	-13,506,280.00	-
IF2410	IF2410	-96	-118,736,640.00	-26,861,136.21	-
IF2411	IF2411	-4	-4,962,720.00	-838,920.00	-
IF2412	IF2412	-540	-669,967,200.00	-127,097,460.00	-
IF2503	IF2503	-10	-12,403,800.00	-2,134,440.00	-
公允价值变动总额合计（元）					-178,007,316.21
股指期货投资本期收益（元）					6,908,195.95
股指期货投资本期公允价值变动（元）					-183,337,536.21

注：持仓量和合约市值的负数代表产品投资的期货为空头。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金主要运用股指期货合约进行套期保值操作，规避市场系统性风险。在完全套保的理念下，本基金根据股票多头组合的市值计算股指期货合约卖单量，并根据市场变化对股指期货合约卖单量进行动态跟踪并适时调整。同时，综合考虑定价关系、套利机会、流动性以及保证金要求等因素，在不同股指期货合约之间进行动态配置，并适时进行合约展期操作，以求提高组合收益和套期保值的效果。

本基金投资于股指期货，为特殊类型的混合型基金，主要采用追求绝对收益的市场中性策略，与股票市场表现的相关性较低。相对股票型基金和一般的混合型基金，其预期风险较小。本基金的投资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 市场中性策略执行情况

截至本报告期末，本基金持有股票资产 877,155,563.75 元，占基金资产净值的比例为 81.58%；运用股指期货进行对冲的空头合约市值 -897,945,480.00 元，占基金资产净值的比例为 -83.51%，空头合约市值占股票资产的比例为 -102.37%。

本报告期内，本基金执行市场中性策略的投资收益为 1,322,130.92 元，公允价值变动损益为 -38,681,626.05 元。

5.12 投资组合报告附注

5.12.1 本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

华宝量化对冲混合截止 2024 年 09 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中，招商银行股份有限公司因违规经营，涉嫌违反法律法规，违反结汇、售汇及付汇管理规定；于 2023 年 11 月 27 日收到国家外汇管理局深圳市分局警告，罚款，没收违法所得的处罚措施。

华宝量化对冲混合截止 2024 年 09 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中, 招商银行股份有限公司因办理经常项目资金收付, 未对交易单证的真实性及其与外汇收支的一致性进行合理审查行为、违反规定办理结汇、售汇业务行为、违反规定办理资本项目资金收付行为; 于 2023 年 11 月 27 日收到国家外汇管理局深圳市分局警告, 罚款, 没收违法所得的处罚措施。

华宝量化对冲混合截止 2024 年 09 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中, 招商银行股份有限公司因招商银行理财业务存在以下违法违规行为: 一、未能有效穿透识别底层资产二、信息披露不规范; 于 2024 年 06 月 24 日收到国家金融监督管理总局罚款的处罚措施。

华宝量化对冲混合截止 2024 年 09 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中, 兴业银行股份有限公司因一、未严格按照公布的收费价目名录收费; 二、向小微企业贷款客户转嫁抵押评估费; 三、企业划型管理不到位; 于 2024 年 07 月 17 日收到国家金融监督管理总局福建监管局罚款的处罚措施。

本基金管理人通过对上述上市公司进行进一步了解和分析, 认为上述处分不会对公司的投资价值构成实质性影响, 因此本基金管理人对上述证券的投资判断未发生改变。报告期内, 本基金投资的前十名证券的其余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。

5.12.2 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。

5.12.3 其他资产构成

序号	名称	金额 (元)
1	存出保证金	107,947,984.40
2	应收证券清算款	32,496,899.65
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	35,569,668.23
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	176,014,552.28

5.12.4 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。

5.12.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.12.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华宝量化对冲混 合 A	华宝量化对冲混 合 C	华宝量化对冲混 合 D
报告期期初基金份额总额	77,197,209.93	155,451,556.91	87,919,166.63
报告期期间基金总申购份额	418,218,977.92	162,191,732.11	362,163,551.19
减：报告期期间基金总赎回份额	162,425,107.68	59,733,741.54	88,011,980.49
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	332,991,080.17	257,909,547.48	362,070,737.33

§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

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总 份额比例(%)	发起份额总数	发起份额占基金总 份额比例(%)	发起份额承诺 持有期限
基金管理人固有资金	-	-	9,800,000.00	1.03	不少于 3 年
基金管理人高级管理人员	117,860.68	0.01	100,000.00	0.01	不少于 3 年
基金经理等人员	-	-	100,000.00	0.01	不少于 3 年
基金管理人股	-	-	-	-	-

东					
其他	-	-	-	-	-
合计	117,860.68	0.01	10,000,000.00	1.05	-

注：1、本基金募集期间，本基金管理人运用自有资金、基金管理人高级管理人员及基金经理等人员使用自有资金作为发起资金总计 1,000 万元认购了本基金。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、本基金管理人运用自有资金于 2014 年 9 月 12 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；本基金管理人高级管理人员使用自有资金认购本基金作为发起资金的认购费率为 0.3%；本基金基金经理等人员使用自有资金认购本基金作为发起资金的认购费率为 0.6%。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 2021 年四季度赎回本基金全部发起式份额。

§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

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。

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

§ 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；
 华宝量化对冲策略混合型发起式证券投资基金基金合同；
 华宝量化对冲策略混合型发起式证券投资基金招募说明书；
 华宝量化对冲策略混合型发起式证券投资基金托管协议；
 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
 基金管理人报告期内在指定报刊上披露的各种公告；
 基金托管人业务资格批件和营业执照。

10.2 存放地点

以上文件存于基金管理人及基金托管人住所备投资者查阅。

10.3 查阅方式

投资者可以通过基金管理人网站，查阅或下载基金合同、招募说明书、托管协议及基金的各项

种定期和临时公告。

华宝基金管理有限公司

2024 年 10 月 25 日