

华宝标普沪港深中国增强价值指数证券投资
资基金（LOF）
2022 年第 3 季度报告

2022 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：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：2022 年 10 月 26 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 10 月 24 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 2022 年 07 月 01 日起至 09 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	华宝标普沪港深中国增强价值指数
场内简称	价值基金 LOF
基金主代码	501310
基金运作方式	上市契约型开放式（LOF）
基金合同生效日	2018 年 10 月 25 日
报告期末基金份额总额	115,153,570.67 份
投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。正常情况下，本基金力争控制净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 5%。
投资策略	本基金主要采取完全复制法，即按照标的指数成份股及其权重构建基金的股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动对股票投资组合进行相应地调整。 对于出现市场流动性不足、因法律法规原因个别成份股被限制投资等情况，导致本基金无法获得足够数量的股票时，基金管理人将通过投资成份股、非成份股、成份

	股个股衍生品等进行替代。	
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为标普沪港深中国增强价值指数收益率×95%+人民币银行活期存款利率（税后）×5%	
风险收益特征	本基金为股票型基金，其长期平均风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。本基金为指数型基金，具有与标的指数相似的风险收益特征。本基金将通过港股通投资香港证券市场，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括港股市场股价波动较大的风险、汇率风险、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险等。	
基金管理人	华宝基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	华宝标普沪港深中国增强价值指数	华宝价值基金 C
下属分级基金的场内简称	价值基金 LOF	-
下属分级基金的交易代码	501310	007397
报告期末下属分级基金的份额总额	109,276,552.58 份	5,877,018.09 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（2022 年 7 月 1 日-2022 年 9 月 30 日）	
	华宝标普沪港深中国增强价值指数	华宝价值基金 C
1. 本期已实现收益	-1,489,765.01	-90,246.39
2. 本期利润	-11,865,680.22	-622,799.26
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.1083	-0.1036
4. 期末基金资产净值	88,724,116.35	4,709,228.14
5. 期末基金份额净值	0.8119	0.8013

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

华宝标普沪港深中国增强价值指数

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	-11.79%	0.96%	-13.58%	0.93%	1.79%	0.03%
过去六个月	-11.47%	1.10%	-15.27%	1.04%	3.80%	0.06%
过去一年	-14.15%	1.22%	-16.80%	1.22%	2.65%	0.00%
过去三年	-15.14%	1.18%	-23.60%	1.16%	8.46%	0.02%
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	-18.81%	1.13%	-25.04%	1.11%	6.23%	0.02%

华宝价值基金 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	-11.87%	0.97%	-13.58%	0.93%	1.71%	0.04%
过去六个月	-11.64%	1.10%	-15.27%	1.04%	3.63%	0.06%
过去一年	-14.49%	1.22%	-16.80%	1.22%	2.31%	0.00%
过去三年	-16.14%	1.18%	-23.60%	1.16%	7.46%	0.02%
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	-18.59%	1.14%	-27.32%	1.12%	8.73%	0.02%

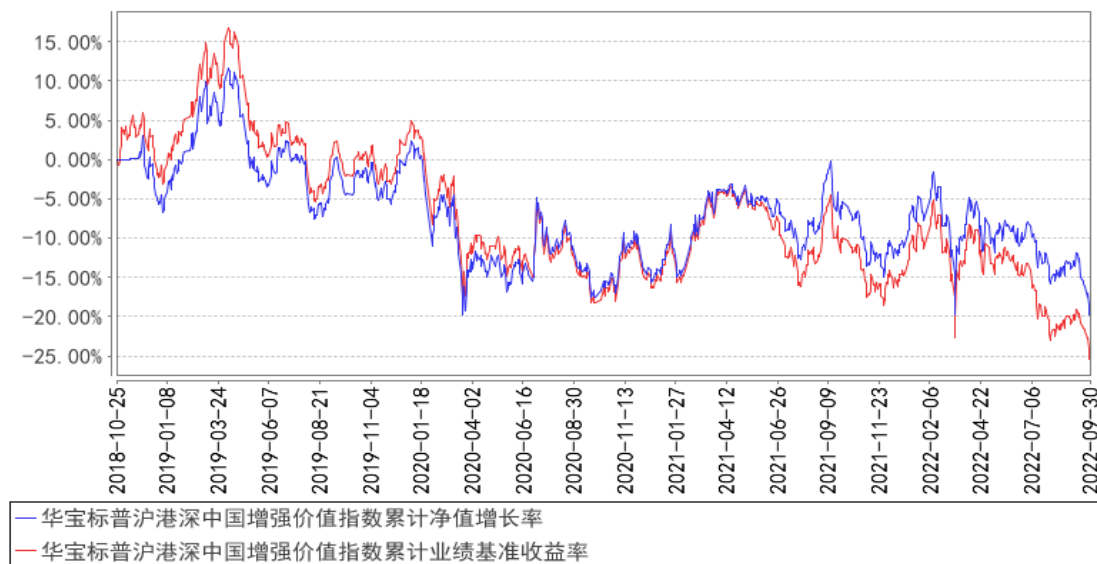
注：（1）基金业绩基准：本基金的业绩比较基准为标普沪港深中国增强价值指数收益率×95%+人民币银行活期存款利率（税后）×5%；

（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

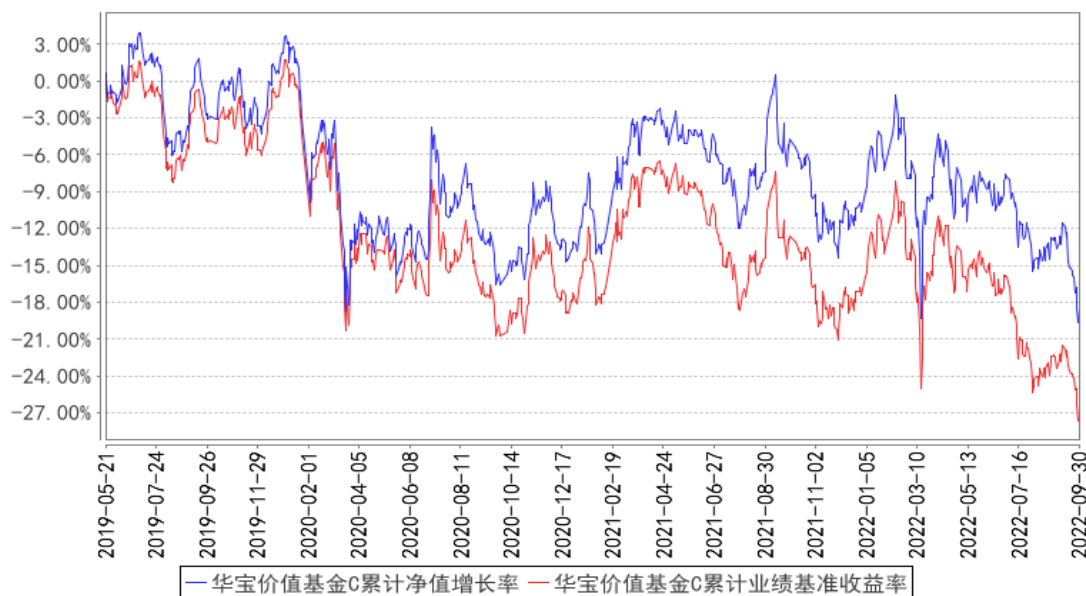
非交易日)。

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

华宝标普沪港深中国增强价值指数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



华宝价值基金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 2019 年 04 月 25 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		
周晶	本基金基金经理、公司总经理助理、国际业务部总经理	2018-10-25	-	18 年	博士。先后在德亚投资(美国)、华宝基金、汇丰证券(美国)从事风控、投资分析等工作。2011 年 6 月再次加入华宝基金管理有限公司,先后担任策略部总经理、首席策略分析师、海外投资部总经理等职务,现任公司总经理助理兼国际业务部总经理。2013 年 6 月至 2015 年 11 月任华宝兴业成熟市场动量优选证券投资基金基金经理,2014 年 9 月起任华宝标普石油天然气上游股票指数证券投资基金(LOF)基金经理,2015 年 9 月至 2017 年 8 月任华宝兴业中国互联网股票型证券投资基金基金经理,2016 年 3 月起任华宝标普美国品质消费股票指数证券投资基金(LOF)基金经理,2016 年 6 月起任华宝标普香港上市中国中小盘指数证券投资基金(LOF)基金经理,2017 年 4 月起任华宝港股通恒生中国(香港上市)25 指数证券投资基金(LOF)基金经理,2018 年 3 月起任华宝港股通恒生香港 35 指数证券投资基金(LOF)基金经理,2018 年 10 月起任华宝标普沪港深中国增强价值指数证券投资基金(LOF)基金经理,2019 年 11 月起任华宝致远混合型证券投资基金(QDII)基金经理,2020 年 11 月起任华宝英国富时 100 指数发起式证券投资基金基金经理,2022 年 2 月起任华宝中证港股通互联网交易型开放式指数证券投资基金基金经理,2022 年 9 月起任华宝海外中国成长混合型证券投资基金基金经理。
杨洋	本基金基金经理	2021-05-11	-	12 年	硕士。曾在法兴银行、东北证券从事证券交易、研究、投资管理工作。2014 年 6 月加入华宝基金管理有限公司,先后担任高级分析师、投资经理等职务。2021 年 5 月起任华宝英国富时 100 指数发起式证券投资基金、华宝港股通恒生中国(香港上市)25 指数证券投资基金(LOF)、华宝标普美国品质消费股票指数证券投资基金(LOF)、华宝标普沪港深中国增强价值指数证券投资基金(LOF)、华宝标普香港上市中国中小盘指数证券投资基金(LOF)、华宝标普石油天然气上游股票指数证券投资基金(LOF)、华宝港股通恒生香港 35

					指数证券投资基金 (LOF) 基金经理，2022 年 1 月起任华宝致远混合型证券投资基金 (QDII) 基金经理，2022 年 9 月起任华宝海外中国成长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》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》及其各项实施细则、《华宝标普沪港深中国增强价值指数证券投资基金 (LOF) 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

本基金采用全复制方法跟踪标普沪港深中国增强价值指数。该指数在沪港深三地上市的股票中采用量化的方法精选估值偏低的股票。整个基金通过 A 股和港股通进行交易。该基金于 2018/10/25 成立。以下为对影响标的指数表现的市场因素分析。

2022 年三季度，港股市场震荡下行。三季度，国内经济开始逐渐企稳，制造业 PMI 在九月份重新站回荣枯线上方。这与今年二季度以来，党中央对于提振经济实施的积极有效的政策密不可分。然而，受外部因素影响，港股市场在二季度依然发生了较大回调。美国的货币政策从二季度以来一直保持紧缩的趋势。市场对于美联储由鹰转鸽的预期多次遇挫。美联储维持货币政策鹰派态度的原因在于：三季度美国公布的通胀数据，依然处于高位，虽然同比数据从 6 月开始有所回落，但环比来看，依然没有明显回落的趋势。以对抗通胀上升为核心目标的美联储主席鲍威尔在九月份的 FOMC 会议上再次决定加息 75 个基点，并且预期在未来的会议上依然保持鹰派。美联储连续鹰派地大幅加息，引发了市场对于美联储货币政策超预期紧缩从而导致经济发生衰退的担忧。这对于市场情绪是一次很大的打击。港股作为全球流动性的蓄水池在今年三季度遭遇较大回撤。价值板块在 19、20 两年较大跑输成长板块。21 年价值跑赢成长，该风格有望在 22 年继续保持。

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-11.79%，本报告期基金份额 C 净值增长率为-11.87%；同期业绩比较基准收益率为-13.58%。

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	87,357,617.79	92.54
	其中：股票	87,357,617.79	92.54
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	6,498,560.48	6.88
8	其他资产	548,589.31	0.58
9	合计	94,404,767.58	100.00

注：1、通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 59,716,891.79 元，占基金资产净值的比例为 63.91%。

2、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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	7,731,021.20	8.27
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	6,120,764.00	6.55
F	批发和零售业	1,929,221.00	2.06
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	-	-
J	金融业	7,472,234.80	8.00
K	房地产业	3,743,020.04	4.01
L	租赁和商务服务业	361,122.00	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	-	-
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	27,357,383.04	29.28

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
----	------	---------	--------------

A	农、林、牧、渔业		
B	采矿业		
C	制造业		
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业		
E	建筑业		
F	批发和零售业		
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		
J	金融业		
K	房地产业	283,342.96	0.30
L	租赁和商务服务业		
M	科学研究和技术服务业		
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		
S	综合		
	合计	283,342.96	0.30

5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
能源	6,887,907.53	7.37
原材料	4,195,082.14	4.49
工业	7,465,264.02	7.99
非日常生活消费品	657,699.72	0.70
日常消费品	-	-
医疗保健	1,446,252.02	1.55
金融	28,095,158.77	30.07
信息技术	622,435.61	0.67
通信服务	2,052,391.43	2.20
公用事业	2,315,172.85	2.48
房地产	5,979,527.70	6.40
合计	59,716,891.79	63.91

注：本基金对以上行业分类采用全球行业分类标准。

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	00939	建设银行	1,153,000	4,734,399.71	5.07
2	03988	中国银行	1,923,000	4,469,841.97	4.78
3	01398	工商银行	1,289,000	4,290,229.23	4.59
4	601668	中国建筑	821,400	4,230,210.00	4.53
5	600000	浦发银行	515,700	3,630,528.00	3.89
6	00386	中国石油化工股份	1,166,000	3,553,924.62	3.80
7	03328	交通银行	749,000	2,804,541.82	3.00
8	00857	中国石油股份	948,000	2,760,857.37	2.95
9	601169	北京银行	590,580	2,427,283.80	2.60
10	01288	农业银行	1,119,000	2,378,360.65	2.55

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	00813	世茂集团	103,000	81,978.44	0.09
2	01918	融创中国	242,000	201,364.52	0.22

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券投资。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金未投资股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金未投资股指期货。

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 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

华宝标普沪港深中国增强价值指数截止 2022 年 09 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中,上海浦东发展银行股份有限公司因银行卡境外交易信息报送错误,于 2021 年 11 月 15 日收到国家外汇管理局上海市分局责令改正,给予警告、处 6 万元人民币的罚款的行政处罚措施。

华宝标普沪港深中国增强价值指数截止 2022 年 09 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中,中国农业银行股份有限公司因存在以下违规行为:一、农业银行制定文件要求企业对公账户必须开通属于该行收费项目的动账短信通知服务,侵害客户自主选择权;二、农业银行河南分行和新疆分行转发并执行总行强制企业对公账户开通动账短信通知服务要求,违法行为情节较为严重;于 2021 年 12 月 8 日收到中国银行保险监督管理委员会罚款 150 万元的行政处罚。

华宝标普沪港深中国增强价值指数截止 2022 年 09 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中,中国建设银行股份有限公司因存在以下违规行为:一、贸易融资业务 EAST 数据存在偏差;二、贷款核销业务 EAST 数据存在偏差;三、漏报抵押物价值 EAST 数据;四、漏报债券投资业务 EAST 数据;五、未报送权益类投资业务 EAST 数据;六、漏报公募基金投资业务 EAST 数据;七、未报送投资资产管理产品业务 EAST 数据;八、未报送跟单信用证业务 EAST 数据;九、漏报保函业务 EAST 数据;十、未报送其他担保类业务 EAST 数据;十一、漏报委托贷款业务 EAST 数据;十二、EAST 系统理财产品底层持仓余额数据存在偏差;十三、EAST 系统理财产品非标投向行业余额数据存在偏

差；十四、EAST 系统《表外授信业务》表错报；十五、EAST 系统《对公信贷业务借据》表错报；十六、EAST 系统《关联关系》表漏报；十七、2018 年行政处罚问题依然存在；于 2022 年 3 月 21 日收到中国银行保险监督管理委员会罚款 470 万元的行政处罚。

华宝标普沪港深中国增强价值指数截止 2022 年 09 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中, 交通银行股份有限公司因存在以下违法违规行为：一、漏报不良贷款余额 EAST 数据；二、贸易融资业务 EAST 数据存在偏差；三、漏报贷款核销业务 EAST 数据；四、漏报抵押物价值 EAST 数据；五、未报送权益类投资业务 EAST 数据；六、未报送其他担保类业务 EAST 数据；七、EAST 系统理财产品销售端与产品端数据核对不一致；八、EAST 系统理财产品非标投向行业余额数据存在偏差；九、EAST 系统分户账与总账比对不一致；十、EAST 系统《表外授信业务》表错报；十一、EAST 系统《个人信贷业务借据》表错报；十二、EAST 系统《对公信贷业务借据》表错报；十三、EAST 系统《关联关系》表漏报；十四、理财产品登记不规范；十五、2018 年行政处罚问题依然存在；于 2022 年 3 月 21 日收到中国银行保险监督管理委员会罚款 420 万元的行政处罚。

华宝标普沪港深中国增强价值指数截止 2022 年 09 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中, 中国工商银行股份有限公司因监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在以下违法违规行为：一、抵押物价值 EAST 数据存在偏差；二、漏报信贷资产转让业务 EAST 数据；三、未报送公募基金投资业务 EAST 数据；四、漏报跟单信用证业务 EAST 数据；五、漏报保函业务 EAST 数据；六、EAST 系统理财产品销售端与产品端数据核对不一致；七、EAST 系统理财产品底层持仓余额数据存在偏差；八、EAST 系统《表外授信业务》表错报；九、EAST 系统《对公信贷业务借据》表错报；十、EAST 系统《对公信贷分户账》表漏报；十一、理财产品登记不规范；十二、2018 年行政处罚问题依然存在。于 2022 年 3 月 21 日收到中国银行保险监督管理委员会罚款 360 万的处罚。

华宝标普沪港深中国增强价值指数截止 2022 年 09 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中, 中国银行股份有限公司因监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在以下违法违规行为：一、不良贷款余额 EAST 数据存在偏差；二、逾期 90 天以上贷款余额 EAST 数据存在偏差；三、漏报贷款核销业务 EAST 数据；四、漏报抵押物价值 EAST 数据；五、漏报债券投资业务 EAST 数据；六、未报送权益类投资业务 EAST 数据；七、漏报公募基金投资业务 EAST 数据；八、未报送投资资产管理产品业务 EAST 数据；九、漏报其他担保类业务 EAST 数据；十、EAST 系统理财产品底层持仓余额数据存在偏差；十一、EAST 系统理财产品非标投向行业余额数据存在偏差；十二、EAST 系统《表外授信业务》表错报；十三、EAST 系统《个人信贷业务借据》表错报；十四、EAST 系统《对公信贷业务借据》表错报；十五、EAST 系统《关联关系》表错报；十六、EAST 系统《对公信贷分户账》表错报；十七、理财产品登记不规范；十八、2018 年行政处罚问题依然存在。于 2022

年 3 月 21 日收到中国银行保险监督管理委员会罚款 480 万元的行政处罚决定。

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

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	4,291.80
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	544,297.45
4	应收利息	-
5	应收申购款	0.06
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	548,589.31

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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	00813	世茂集团	81,978.44	0.09	重大事项停牌
2	01918	融创中国	201,364.52	0.22	重大事项停牌

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	华宝标普沪港深中国增强价值指数	华宝价值基金 C
报告期期初基金份额总额	110,251,520.80	5,974,235.90
报告期期间基金总申购份额	3,165,599.65	1,594,996.01
减:报告期期间基金总赎回份额	4,140,567.87	1,692,213.82
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	109,276,552.58	5,877,018.09

§ 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 影响投资者决策的其他重要信息

2022 年 7 月 2 日,基金管理人发布董事长变更公告,黄孔威担任公司董事长,朱永红不再担任公司董事长。

2022 年 10 月 15 日,基金管理人发布高级管理人员变更公告,聘任向辉为公司总经理。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

中国证监会批准基金设立的文件;
 华宝标普沪港深中国增强价值指数证券投资基金(LOF)基金合同;
 华宝标普沪港深中国增强价值指数证券投资基金(LOF)招募说明书;
 华宝标普沪港深中国增强价值指数证券投资基金(LOF)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。

9.2 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。

9.3 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

2022 年 10 月 26 日