

华宝量化对冲策略混合型发起式证券投资
基金
2023 年第 2 季度报告

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：中国银行股份有限公司

报告送出日期：2023 年 7 月 21 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 2023 年 07 月 19 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 2023 年 04 月 01 日起至 06 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 | 191,612,518.14 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 |
| 下属分级基金的交易代码 | 000753 | 000754 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 35, 192, 079. 90 份 | 156, 420, 438. 24 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（2023 年 4 月 1 日-2023 年 6 月 30 日） | |
|-----------------|-------------------------------------|-------------------|
| | 华宝量化对冲混合 A | 华宝量化对冲混合 C |
| 1. 本期已实现收益 | 250, 693. 99 | 884, 557. 55 |
| 2. 本期利润 | 409, 953. 96 | 1, 616, 421. 80 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0. 0113 | 0. 0097 |
| 4. 期末基金资产净值 | 39, 338, 975. 34 | 170, 522, 653. 03 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1. 1178 | 1. 0902 |

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 |
|----|--------|-----------|------------|---------------|-----|-----|
|----|--------|-----------|------------|---------------|-----|-----|

| | | | | ④ | | |
|----------------|--------|-------|--------|-------|--------|-------|
| 过去三个月 | 1.03% | 0.19% | 0.37% | 0.00% | 0.66% | 0.19% |
| 过去六个月 | 1.77% | 0.19% | 0.74% | 0.01% | 1.03% | 0.18% |
| 过去一年 | -2.93% | 0.21% | 1.50% | 0.00% | -4.43% | 0.21% |
| 过去三年 | -1.85% | 0.25% | 4.50% | 0.00% | -6.35% | 0.25% |
| 过去五年 | 9.89% | 0.26% | 7.50% | 0.00% | 2.39% | 0.26% |
| 自基金合同 生效起至今 | 37.34% | 0.27% | 14.21% | 0.01% | 23.13% | 0.26% |

华宝量化对冲混合 C

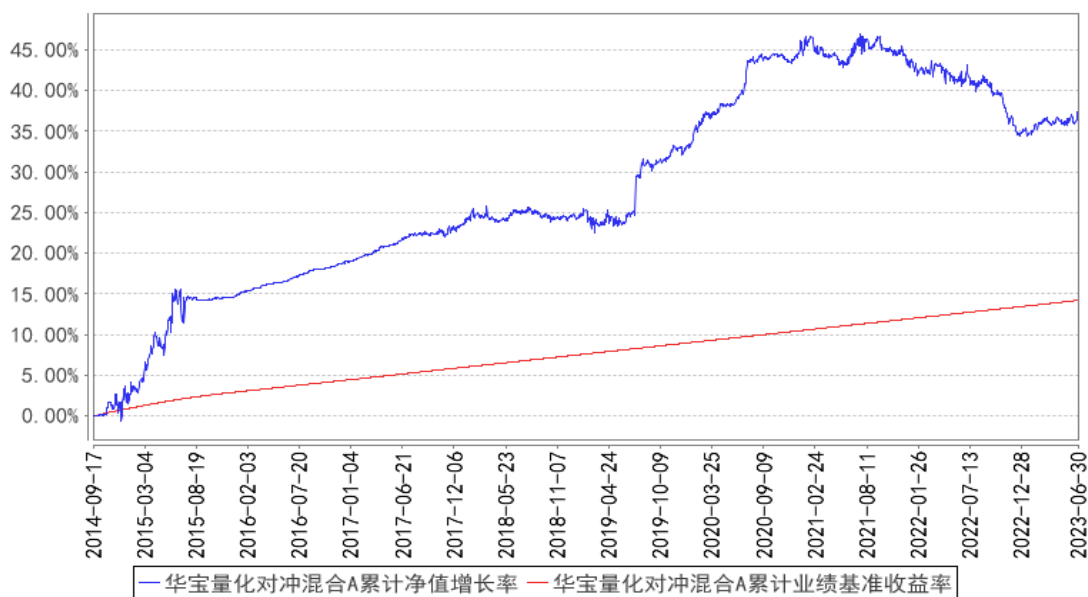
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准 差② | 业绩比较基准 收益率③ | 业绩比较基准 收益率标准差 ④ | ①-③ | ②-④ |
|----------------|--------|---------------|----------------|-----------------------|--------|-------|
| 过去三个月 | 0.94% | 0.19% | 0.37% | 0.00% | 0.57% | 0.19% |
| 过去六个月 | 1.57% | 0.19% | 0.74% | 0.01% | 0.83% | 0.18% |
| 过去一年 | -3.31% | 0.21% | 1.50% | 0.00% | -4.81% | 0.21% |
| 过去三年 | -3.02% | 0.25% | 4.50% | 0.00% | -7.52% | 0.25% |
| 过去五年 | 7.71% | 0.26% | 7.50% | 0.00% | 0.21% | 0.26% |
| 自基金合同 生效起至今 | 33.99% | 0.27% | 14.21% | 0.01% | 19.78% | 0.26% |

注：（1）基金业绩基准：一年期银行定期存款利率（税后）；

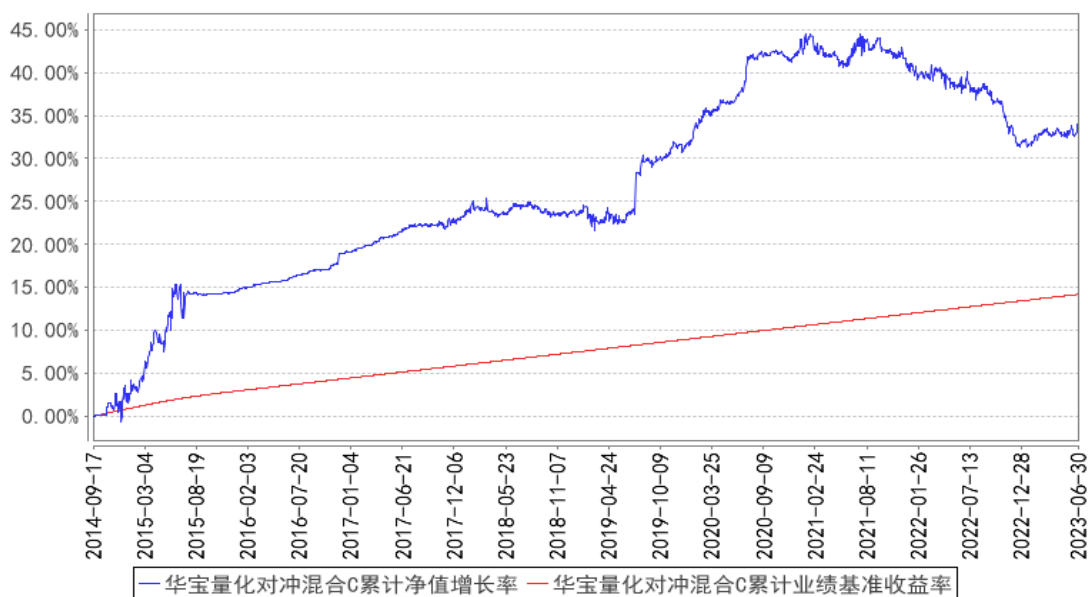
（2）净值以及比较基准相关数据计算中涉及天数的，包括所有交易日以及季末最后一自然日（如非交易日）。

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



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 | 2014-09-17 | - | 21 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 |

| | | | | | |
|----|-------------|------------|---|------|--|
| | 总监、量化投资部总经理 | | | | 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 | - | 11 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 月起任华宝沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金、华宝量化对冲策略混合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 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

二季度海外加息进程未有缓解，受强劲的经济就业数据以及通胀韧性的影响，美联储的加息预期仍未看到转折迹象，另外海外地缘冲突频发、高利率环境下金融领域风险等黑天鹅事件仍严重制约市场的风险偏好，国际局势仍然面临不小的不确定性和风险点。国内来看，在一季度积压需求释放后，二季度经济内生增长减弱，复苏斜率放缓，居民消费意愿和能力不强，企业处于主动去库存阶段，融资扩产的动力不足，地产销售也较为平淡。在复杂的内外局势下，宏观政策定力较强，主要以稳就业、扩内需、托底地产等财政产业政策为主，强力的货币政策刺激预期不高。

市场方面，与一季度相反，二季度各主要指数均出现不同程度的下跌，沪深 300 指数下跌 5.15%，创业板指下跌 7.69%，相对抗跌的是红利类指数和小微盘指数，中证红利和国证 2000 分别下跌 2%和 2.56%。行业层面，受 AI 产业景气度上升预期的推动，通信传媒等 TMT 行业表现较为亮眼，公用事业、银行等低估值稳定行业表现平稳，而景气度不乐观的地产板块和消费板块跌幅

较大。因子层面，二季度因子表现延续一季度的趋势，BP、EP、股息率等价值类因子继续走强，而成长、盈利、分析师等因子仍然偏弱，整体来说，市场延续防御思路，价值仍是二季度的关键词。

选股方面沿用此前的量化 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。期间基金仓位保持相对稳定，股指期货基差二季度维持高位，对冲环境较为友好。

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 1.03%，本报告期基金份额 C 类净值增长率为 0.94%；同期业绩比较基准收益率为 0.37%。

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 | 156,362,285.14 | 73.68 |
| | 其中：股票 | 156,362,285.14 | 73.68 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 12,669,758.22 | 5.97 |
| | 其中：债券 | 12,669,758.22 | 5.97 |
| | 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 | -534.25 | -0.00 |
| | 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 | 22,824,879.69 | 10.76 |
| 8 | 其他资产 | 20,367,440.48 | 9.60 |
| 9 | 合计 | 212,223,829.28 | 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 | 1,095,437.00 | 0.52 |
| B | 采矿业 | 7,178,796.00 | 3.42 |
| C | 制造业 | 93,013,124.20 | 44.32 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 7,629,213.17 | 3.64 |
| E | 建筑业 | 4,923,541.07 | 2.35 |
| F | 批发和零售业 | 4,770,286.59 | 2.27 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 2,752,723.00 | 1.31 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 4,374,982.85 | 2.08 |
| J | 金融业 | 20,138,215.40 | 9.60 |
| K | 房地产业 | 3,323,753.00 | 1.58 |
| L | 租赁和商务服务业 | 2,034,161.00 | 0.97 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 1,077,013.37 | 0.51 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 2,600,192.49 | 1.24 |
| 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 | 1,450,846.00 | 0.69 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 156,362,285.14 | 74.51 |

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 | 2,804 | 4,741,564.00 | 2.26 |
| 2 | 601318 | 中国平安 | 77,300 | 3,586,720.00 | 1.71 |
| 3 | 300750 | 宁德时代 | 13,060 | 2,987,997.40 | 1.42 |
| 4 | 600919 | 江苏银行 | 397,000 | 2,917,950.00 | 1.39 |
| 5 | 600036 | 招商银行 | 68,900 | 2,257,164.00 | 1.08 |
| 6 | 600900 | 长江电力 | 91,900 | 2,027,314.00 | 0.97 |
| 7 | 000333 | 美的集团 | 32,098 | 1,891,214.16 | 0.90 |
| 8 | 002236 | 大华股份 | 80,700 | 1,593,825.00 | 0.76 |

| | | | | | |
|----|--------|------|---------|--------------|------|
| 9 | 600048 | 保利发展 | 120,200 | 1,566,206.00 | 0.75 |
| 10 | 600323 | 瀚蓝环境 | 78,700 | 1,489,791.00 | 0.71 |

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 | 2,544,947.26 | 1.21 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 10,124,810.96 | 4.82 |
| | 其中：政策性金融债 | 10,124,810.96 | 4.82 |
| 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 | 12,669,758.22 | 6.04 |

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 | 018065 | 进出 2201 | 100,000 | 10,124,810.96 | 4.82 |
| 2 | 019679 | 22 国债 14 | 25,000 | 2,544,947.26 | 1.21 |

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 |
|---------------|--------|----------|----------------|--------------|--------------|
| IC2307 | IC2307 | -24 | -28,755,840.00 | -69,880.00 | - |
| IC2309 | IC2309 | -38 | -45,372,000.00 | 698,080.00 | - |
| IF2307 | IF2307 | -19 | -21,833,280.00 | -155,321.08 | - |
| IF2309 | IF2309 | -50 | -57,585,000.00 | 1,304,040.00 | - |
| 公允价值变动总额合计（元） | | | | | 1,776,918.92 |

| | |
|-------------------|--------------|
| 股指期货投资本期收益（元） | 3,426,445.27 |
| 股指期货投资本期公允价值变动（元） | 3,510,218.81 |

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 156,362,285.14 元，占基金资产净值的比例为 74.51%；运用股指期货进行对冲的空头合约市值-153,546,120.00 元，占基金资产净值的比例为-73.17%，空头合约市值占股票资产的比例为-98.20%。

本报告期内，本基金执行市场中性策略的投资收益为-132,751.33 元，公允价值变动损益为 867,379.22 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 2023 年 06 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中,中国平安保险(集团)股份有限公司因未按照规定进行国际收支统计申报于 2022 年 8 月 22 日收到国家外汇管理局深圳分局责令改正、给予警告并处罚款人民币 30 万元的处罚决定。

华宝量化对冲混合截止 2023 年 06 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信贷业务违规,违反审慎经营规则,内部管理与控制制度不健全或执行监督不力,内控管理未形成有效风险控制;于 2022 年 09 月 09 日收到银保监会罚款的处罚措施。

华宝量化对冲混合截止 2023 年 06 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中,江苏银行股份有限公司因基金销售业务存在以下问题:一、零售业务部和网络金融部均负责基金销售业务,但未对基金销售产品实行集中统一准入管理,违反了《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》(证监会令第 175 号)第二十七条的规定。二、部分基金销售业务人员未取得基金从业资格,违反了《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》(证监会令第 175 号)第三十条的规定。三、向普通投资者主动推介风险等级高于其风险承受能力的产品或服务的情况,违反了《证券期货投资者适当性管理办法》(证监会令第 177 号)第二十二条的规定。于 2022 年 12 月 05 日收到江苏证监局责令改正的处罚措施。

华宝量化对冲混合截止 2023 年 06 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:一是多期债务融资工具未按照发行文件约定开展余额包销,个别债务融资工具挤占了其他投资人的正常投标,违背了公平公正原则,并影响了发行利率。二是低价包销多期债务融资工具,影响了市场正常秩序。三是债务融资工具承销协议的签订不规范。四是多期债务融资工具的簿记建档利率区间未在充分询价基础上形成,发行工作程序执行不到位、工作开展不规范;于 2023 年 01 月 18 日收到中国银行间市场交易商协会警告,责令改正的处罚措施。

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。

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 | 18,459,719.72 |
| 2 | 应收证券清算款 | 1,887,863.95 |

| | | |
|---|-------|---------------|
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 19,856.81 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 20,367,440.48 |

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 |
|---------------------------|---------------|----------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 37,878,857.49 | 174,022,895.94 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 602,647.62 | 1,050,042.08 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 3,289,425.21 | 18,652,499.78 |
| 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 | 35,192,079.90 | 156,420,438.24 |

§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 | 5.11 | 不少于 3 年 |

| | | | | | |
|-------------|------------|------|---------------|------|---------|
| 基金管理人高级管理人员 | 117,860.68 | 0.06 | 100,000.00 | 0.05 | 不少于 3 年 |
| 基金经理等人员 | - | - | 100,000.00 | 0.05 | 不少于 3 年 |
| 基金管理人股东 | - | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - | - |
| 合计 | 117,860.68 | 0.06 | 10,000,000.00 | 5.22 | - |

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种定期和临时公告。

华宝基金管理有限公司

2023 年 7 月 21 日