

华宝量化对冲策略混合型发起式证券投资
基金
2023 年中期报告

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

送出日期：2023 年 8 月 31 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 08 月 29 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 2023 年 01 月 01 日起至 2023 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遵规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	13
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	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	19
§ 7 投资组合报告	46
7.1 期末基金资产组合情况	46
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	46
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	47
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	59
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	60
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	60
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	60
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	60

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	61
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	61
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	61
7.12 市场中性策略执行情况	61
7.13 投资组合报告附注	61
§ 8 基金份额持有人信息	63
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	63
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	63
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	63
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	64
§ 9 开放式基金份额变动	64
§ 10 重大事件揭示	65
10.1 基金份额持有人大会决议	65
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	65
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	65
10.4 基金投资策略的改变	65
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	65
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	65
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	65
10.8 其他重大事件	70
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	71
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	71
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	71
§ 12 备查文件目录	71
12.1 备查文件目录	71
12.2 存放地点	71
12.3 查阅方式	71

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华宝量化对冲策略混合型发起式证券投资基金	
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	
基金合同生效日	2014 年 9 月 17 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	
报告期末基金份 额总额	191,612,518.14 份	
基金合同存续期	不定期	
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

2.2 基金产品说明

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。

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	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	周雷	许俊
	联系电话	021-38505888	010-66596688
	电子邮箱	xxpl@fsfund.com	fxjd_hq@bank-of-china.com
客户服务电话		400-700-5588、400-820-5050	95566
传真		021-38505777	010-66594942

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 1 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 1 号
邮政编码	200120	100818
法定代表人	黄孔威	葛海蛟

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
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住所。

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(2023 年 1 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
本期已实现收益	-98,187.28	-684,498.99
本期利润	720,920.36	2,827,818.25
加权平均基金份额本期利润	0.0183	0.0163
本期加权平均净值利润率	1.65%	1.51%
本期基金份额净值增长率	1.77%	1.57%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)	
	期末可供分配利润	14,102,214.79
	期末可供分配基	0.0902

金份额利润		
期末基金资产净值	39,338,975.34	170,522,653.03
期末基金份额净值	1.1178	1.0902
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	37.34%	33.99%

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

华宝量化对冲混合 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	0.80%	0.21%	0.12%	0.00%	0.68%	0.21%
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%
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	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	0.78%	0.21%	0.12%	0.00%	0.66%	0.21%

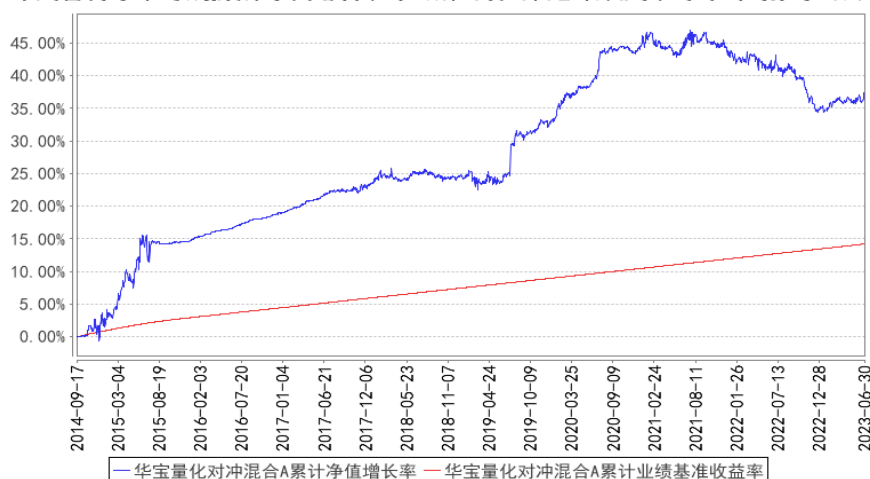
过去三个月	0.94%	0.19%	0.37%	0.00%	0.57%	0.19%
过去六个月	1.57%	0.19%	0.74%	0.01%	0.83%	0.18%
过去一年	-3.31%	0.21%	1.50%	0.00%	-4.81%	0.21%
过去三年	-3.02%	0.25%	4.50%	0.00%	-7.52%	0.25%
自基金合同生效起 至今	33.99%	0.27%	14.21%	0.01%	19.78%	0.26%

注：（1）基金业绩基准：一年期银行定期存款利率（税后）；

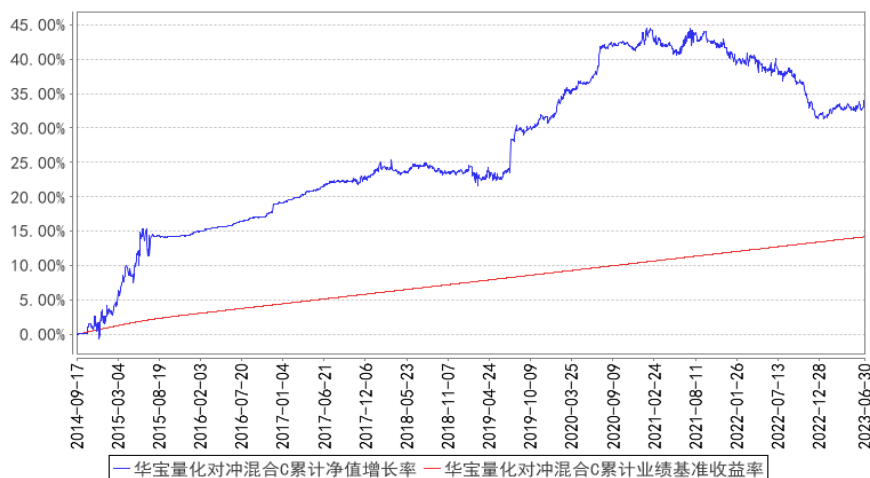
（2）净值以及比较基准相关数据计算中涉及天数的，包括所有交易日以及季末最后一自然日（如非交易日）。

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，在香港设有子公司——华宝资产管理(香港)有限公司。截至本报告期末（2023 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 139 只。

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		
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	-	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。
唐雪倩	本基金的基金经理助理	2018-01-23	2023-04-21	8 年	2015 年 7 月加入华宝基金管理有限公司，先后担任分析师、基金经理助理等职务。2018 年 1 月至 2018 年 6 月任华宝新动力一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理，2018 年 1 月至 2018 年 7 月任华宝新回报一年定期开放混合型证券投资基金基金经理助理，2018 年 1 月至 2018 年 8 月任华宝新优选一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理，2019 年 2 月至 2022 年 8 月起任华宝科技先锋混合型证券投资基金基金经理助理，2021 年 8 月至 2021 年 10 月任华宝安享混合型证券投资基金基金经理助理，2021 年 9 月至 2021 年 10 月任华宝安益混合型证券投资基金基金经理助理，2018 年 1 月至 2023 年 4 月任华宝量化对冲策略混合型发起式证券投资基金、华宝新机遇灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)、华宝沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金基金经理助理，2018 年 1 月起任华宝新价值灵活配置混合型证券投资基金、华宝新起点灵活配置混合型证券投资基金、华宝新飞跃灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理，2019 年 7 月起任华宝新活力灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理。2021 年 10 月至 2022 年 6 月任华宝安益混合型证券投资基金基金经理，2021 年 10 月起任华宝安享混合型证券投资基金基金经理，2022 年 6 月起任华宝红利精选混合型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 4 月起任华宝新机遇灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) 基金经理，2023 年 4 月起任华宝未来主导产业灵活配置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。

4.1.3 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 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

本基金管理人旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，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% 的交易共有 1 次，均为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。

本报告期内，本基金没有发现异常交易行为。

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

上半年海外仍处于美联储的持续加息进程中，中美关系、地缘冲突、高利率环境下金融领域

风险等黑天鹅事件，一定程度上制约了市场的风险偏好，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、促消费、托底地产等财政产业政策为主，未有强力的货币政策刺激。

股票市场方面，上半年整体处于震荡状态，一二季度上演了强预期弱现实的上行回落走势，整体来看，创业板及大盘蓝筹指数表现弱于中小盘指数及红利指数，报告期沪深 300 指数微跌 0.75%，创业板指数下跌 5.61%，国证 2000 指数上涨 7.08%，红利指数上涨 5.03%。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、建筑装饰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，上半年沪深 300 内的因子仍有明显分化，BP、EP、股息率等价值类因子持续强势，而成长、盈利、分析师等因子仍然偏弱，整体来说，市场延续估值修复均值回归的思路，价值是上半年的关键词。

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，股指期货基差目前维持高位，对冲环境较为友好。

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 1.77%，本报告期基金份额 C 类净值增长率为 1.57%；同期业绩比较基准收益率为 0.74%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，国内的经济处于磨底筑底阶段，经济最困难的时期已经过去，复苏存在诸多有利条件，稳增长成为宏观政策的主基调，政策表态更为积极，各领域政策推出更加精准密集，有助于市场情绪的修复和提振。但复苏仍可能面临一定的挑战，一是国际局势动荡，俄乌冲突、中美关系存在一定的不确定性；二是内需的释放和产业的升级仍需更大政策力度的推动；三是随着美联储加息逐渐步入尾声，全球滞胀格局下国内通胀压力上升的可能性。

尽管下半年仍然存在一定的扰动因素，但 A 股经过前期较为充分的风险释放，估值已回归到相对有吸引力的水平。从长周期来看，在不确定的环境下，估值有安全边际、经营稳健、基本面优质、有核心竞争力的公司仍有较高的配置价值，有望取得长期稳定的相对收益。基金将继续关注符合常识和逻辑的因子，在投资过程中注重对个股基本面质地的考察，利用量化模型甄选出具备良好经营能力、估值与成长匹配的优质公司，同时基金仍将坚持市场中性投资策略，利用股指

期货对股票组合进行对冲，剥离系统性风险，为投资者提供较为稳健的收益。

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其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

本基金本报告期末未进行利润分配，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，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在华宝量化对冲策略混合型发起式证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议

的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、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：华宝量化对冲策略混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	1,985,458.15	1,271,889.61
结算备付金		20,839,421.54	25,156,810.11
存出保证金		18,459,719.72	24,414,909.14
交易性金融资产	6.4.7.2	169,032,043.36	208,967,717.03
其中：股票投资		156,362,285.14	194,141,187.58
基金投资		-	-
债券投资		12,669,758.22	14,826,529.45
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	-534.25	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		1,887,863.95	2,920,109.43
应收股利		-	-
应收申购款		19,856.81	9,044.40
递延所得税资产		-	-

其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		212,223,829.28	262,740,479.72
负债和净资产	附注号	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022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		376,489.82	1,908,553.94
应付赎回款		580,675.43	436,417.23
应付管理人报酬		175,373.05	222,563.43
应付托管费		35,074.63	44,512.71
应付销售服务费		57,173.92	69,695.70
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	6.4.7.9	1,137,414.06	2,799,935.36
负债合计		2,362,200.91	5,481,678.37
净资产:			
实收基金	6.4.7.10	191,612,518.14	238,482,917.67
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	18,249,110.23	18,775,883.68
净资产合计		209,861,628.37	257,258,801.35
负债和净资产总计		212,223,829.28	262,740,479.72

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额总额 191,612,518.14 份，其中华宝量化对冲混合 A 基金份额总额 35,192,079.90 份，基金份额净值 1.1178 元；华宝量化对冲混合 C 基金份额总额 156,420,438.24 份，基金份额净值 1.0902 元。

6.2 利润表

会计主体：华宝量化对冲策略混合型发起式证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		5,407,266.14	-8,008,505.25
1. 利息收入		246,347.48	1,380,889.26
其中：存款利息收入	6.4.7.13	230,936.57	912,814.69
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		15,410.91	468,074.57
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		709,020.28	4,263,688.19
其中：股票投资收益	6.4.7.14	3,544,832.13	-77,226,152.42
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	40,028.90	753,088.76
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-4,866,690.92	75,098,514.83
股利收益	6.4.7.19	1,990,850.17	5,638,237.02
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	4,331,424.88	-13,963,001.57
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	120,473.50	309,918.87
减：二、营业总支出		1,858,527.53	5,619,881.97
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,148,239.31	3,631,525.30
2. 托管费	6.4.10.2.2	229,647.87	726,305.13
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	372,199.74	871,416.53
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	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	270,519.65
8. 其他费用	6.4.7.23	108,440.61	120,115.36
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		3,548,738.61	-13,628,387.22
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		3,548,738.61	-13,628,387.22
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		3,548,738.61	-13,628,387.22

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：华宝量化对冲策略混合型发起式证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 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（基金净值）	238,482,917.67	-	18,775,883.68	257,258,801.35
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	238,482,917.67	-	18,775,883.68	257,258,801.35
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-46,870,399.53	-	-526,773.45	-47,397,172.98
（一）、综合收益总额	-	-	3,548,738.61	3,548,738.61
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-46,870,399.53	-	-4,075,512.06	-50,945,911.59
其中：1. 基金申购款	23,735,287.84	-	1,989,751.33	25,725,039.17
2. 基金赎回款	-70,605,687.37	-	-6,065,263.39	-76,670,950.76
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	191,612,518.14	-	18,249,110.23	209,861,628.37
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 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(基金净值)	837,675,246.94	-	131,710,717.53	969,385,964.47
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	837,675,246.94	-	131,710,717.53	969,385,964.47
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-356,003,707.04	-	-65,607,795.68	-421,611,502.72
(一)、综合收益总额	-	-	-13,628,387.22	-13,628,387.22
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-356,003,707.04	-	-51,979,408.46	-407,983,115.50
其中：1. 基金申购款	8,663,426.25	-	1,217,716.73	9,881,142.98
2. 基金赎回款	-364,667,133.29	-	-53,197,125.19	-417,864,258.48
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	481,671,539.90	-	66,102,921.85	547,774,461.75

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

华宝量化对冲策略混合型发起式证券投资基金(原名为华宝兴业量化对冲策略混合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[2014]第 737 号《关于核准华宝兴业量化对冲策略混合型发起式证券投资基金募集的批复》核准,由华宝基金管理有限公司(原华宝兴业基金管理有限公司,已于 2017 年 10 月 17 日办理完成工商变更登记)依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华宝兴业量化对冲策略混合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,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 606,936,516.77 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2014)第 536 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华宝兴业量化对冲策略混合型发起式证券投资基金基金合同》于 2014 年 9 月 17 日生效,基金合同生效日的基金份额总额为 607,038,069.95 份基金份额(A 类基金份额 539,601,058.43 份,C 类基金份额 67,437,011.52 份),其中认购资金利息折合 101,553.18 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,基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据经批准的《华宝兴业量化对冲策略混合型发起式证券投资基金基金合同》和《华宝兴业量化对冲策略混合型发起式证券投资基金招募说明书》的规定,本基金根据认购费、申购费、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别,即 A 类基金份额和 C 类基金份额。A 类基金份额在投资者认购/申购时收取认购/申购费,但不收取销售服务费;C 类基金份额不收取认购/申购费,而从本类别基金资产中计提销售服务费。A 类基金份额和 C 类基金份额分别设置代码,分别计算和公告基金份额净值和基金份额累计净值。

根据《华宝基金管理有限公司关于旗下基金更名事宜的公告》,华宝兴业量化对冲策略混合型发起式证券投资基金于 2017 年 12 月 30 日起更名为华宝量化对冲策略混合型发起式证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华宝量化对冲策略混合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、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货、存托凭证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)。本基金权益类空头头寸的价值占本基金权益类多头头寸的比例范围在 80%-120%之间。其中:权益类空头头寸的价值是指融券卖出的股票市值、卖出股指期货的合约价值及持有的其他可投资的权益类空头工具价值的合计值;权益类多头头寸的价值

是指买入持有的股票市值、买入股指期货的合约价值及持有的其他可投资的权益类多头工具价值的合计值。每个交易日日终，持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%。其中：有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等。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%。本基金的业绩比较基准为：一年期银行定期存款利率（税后）。

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 2023 年 8 月 29 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》、《华宝量化对冲策略混合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 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及 2023 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。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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2018年1月1日起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。

(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 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	1,985,458.15
等于：本金	1,985,270.15
加：应计利息	188.00
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	1,985,458.15

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	158,175,217.30	-	156,362,285.14	-1,812,932.16	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	12,460,215.00	179,008.22	12,669,758.22	30,535.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	12,460,215.00	179,008.22	12,669,758.22	30,535.00
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	170,635,432.30	179,008.22	169,032,043.36	-1,782,397.16	

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	-155,323,038.92	-	-	
其中：股指期货投资	-155,323,038.92	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	-155,323,038.92	-	-	

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IC2307	IC2307	-24.00	-28,755,840.00	-69,880.00
IC2309	IC2309	-38.00	-45,372,000.00	698,080.00
IF2307	IF2307	-19.00	-21,833,280.00	-155,321.08
IF2309	IF2309	-50.00	-57,585,000.00	1,304,040.00
合计				1,776,918.92
减：可抵销期货暂收款				1,776,918.92
净额				0.00

注：（1）买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

（2）衍生金融资产项下的利率/权益/其他衍生工具为国债/股指/商品期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指/商品/国债期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指/商品/国债期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为 0。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

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

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购

交易所市场	-534.25	-
银行间市场	-	-
合计	-534.25	-

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 2023年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	24.65
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	1,003,086.85
其中：交易所市场	1,003,086.85
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	134,302.56
合计	1,137,414.06

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

华宝量化对冲混合 A

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	51,026,888.27	51,026,888.27
本期申购	1,780,793.59	1,780,793.59
本期赎回（以“-”号填列）	-17,615,601.96	-17,615,601.96
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	35,192,079.90	35,192,079.90

华宝量化对冲混合 C

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	187,456,029.40	187,456,029.40
本期申购	21,954,494.25	21,954,494.25

本期赎回（以“-”号填列）	-52,990,085.41	-52,990,085.41
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	156,420,438.24	156,420,438.24

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 其他综合收益

6.4.7.9 未分配利润

单位：人民币元

华宝量化对冲混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	10,957,556.80	-5,934,929.48	5,022,627.32
本期利润	-98,187.28	819,107.64	720,920.36
本期基金份额交易产生的变动数	-3,307,425.80	1,710,773.56	-1,596,652.24
其中：基金申购款	368,084.85	-179,854.97	188,229.88
基金赎回款	-3,675,510.65	1,890,628.53	-1,784,882.12
本期已分配利润	-	-	-
本期末	7,551,943.72	-3,405,048.28	4,146,895.44

华宝量化对冲混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	35,349,070.42	-21,595,814.06	13,753,256.36
本期利润	-684,498.99	3,512,317.24	2,827,818.25
本期基金份额交易产生的变动数	-5,529,367.61	3,050,507.79	-2,478,859.82
其中：基金申购款	4,061,741.98	-2,260,220.53	1,801,521.45
基金赎回款	-9,591,109.59	5,310,728.32	-4,280,381.27
本期已分配利润	-	-	-
本期末	29,135,203.82	-15,032,989.03	14,102,214.79

6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
活期存款利息收入	5,745.39
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	224,573.65
其他	617.53
合计	230,936.57

6.4.7.11 股票投资收益

6.4.7.11.1 股票投资收益项目构成

6.4.7.11.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
卖出股票成交总额	507,370,722.94
减：卖出股票成本总额	502,350,440.62
减：交易费用	1,475,450.19
买卖股票差价收入	3,544,832.13

6.4.7.11.3 股票投资收益——证券出借差价收入

6.4.7.12 债券投资收益

6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	136,838.90
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-96,810.00
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	40,028.90

6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	12,350,410.41
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	12,095,450.00
减：应计利息总额	351,770.41
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	-96,810.00

6.4.7.12.3 债券投资收益——赎回差价收入

6.4.7.12.4 债券投资收益——申购差价收入

6.4.7.13 资产支持证券投资收益

6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益项目构成

6.4.7.13.2 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。

6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

6.4.7.13.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

6.4.7.14.2 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。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	-4,866,690.92

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,990,850.17
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	1,990,850.17

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	3,615,272.72
股票投资	3,497,262.72

债券投资	118,010.00
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	716,152.16
权证投资	-
期货投资	716,152.16
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	4,331,424.88

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
基金赎回费收入	120,468.11
基金转换费收入	5.39
合计	120,473.50

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 50%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 50%归入转出基金的基金资产。

6.4.7.19 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
审计费用	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	5,538.05
账户维护费	18,000.00
上清所 CFCA 证书服务费	600.00
合计	108,440.61

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
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	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 Asset Management. L.P.)	基金管理人的股东
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

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例(%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例(%)
华宝证券	693,647.13	0.07	-	-

6.4.10.1.2 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例(%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例(%)
华宝证券	639.02	0.07	639.02	0.06
关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日			

	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
-	-	-	-	-

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,148,239.31	3,631,525.30
其中：支付销售机构的客户维护费	530,172.54	1,201,216.32

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	229,647.87	726,305.13

注：支付基金托管人中国银行股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值 0.20%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 × 0.20% / 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方名称	本期 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		
	华宝量化对冲混合 A	华宝量化对冲混合 C	合计
华宝基金	-	2,284.83	2,284.83
华宝证券	-	37.40	37.40

中国银行	-	156,709.85	156,709.85
合计	-	159,032.08	159,032.08
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华宝量化对冲混合 A	华宝量化对冲混合 C	合计
华宝基金	-	21,735.31	21,735.31
华宝证券	-	0.31	0.31
中国银行	-	440,005.81	440,005.81
合计	-	461,741.43	461,741.43

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

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

本报告期内及上年度可比期间基金管理人未运用自有资金投资本基金。

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 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022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
中国银行	1,985,458.15	5,745.39	2,023,822.61	26,433.00

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，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（2023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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001282	三联锻造	2023年5月15日	6个月	新股锁定	27.93	33.03	74	2,066.82	2,444.22	-
001286	陕西能源	2023年3月31日	6个月	新股锁定	9.60	9.41	3,767	36,163.20	35,447.47	-
001287	中电港	2023年3月30日	6个月	新股锁定	11.88	21.02	346	4,110.48	7,272.92	-
001324	长青科技	2023年5月12日	6个月	新股锁定	18.88	19.60	98	1,850.24	1,920.80	-
001328	登康口腔	2023年3月29日	6个月	新股锁定	20.68	25.49	101	2,088.68	2,574.49	-
001360	南矿集团	2023年3月31日	6个月	新股锁定	15.38	14.87	140	2,153.20	2,081.80	-
001367	海森药业	2023年3月30日	6个月	新股锁定	44.48	39.48	52	2,312.96	2,052.96	-
001380	华纬科技	2023年5月9日	6个月	新股锁定	28.84	30.78	127	3,662.68	3,909.06	-
300804	广康生化	2023年6月15日	6个月	新股锁定	42.45	32.97	173	7,343.85	5,703.81	-

		日									
301141	中科磁业	2023年3月27日	6个月	新股锁定	41.20	42.69	190	7,828.00	8,111.10		-
301157	华塑科技	2023年3月1日	6个月	新股锁定	56.50	52.93	114	6,441.00	6,034.02		-
301170	锡南科技	2023年6月16日	6个月	新股锁定	34.00	34.93	150	5,100.00	5,239.50		-
301202	朗威股份	2023年6月28日	6个月	新股锁定	25.82	25.82	195	5,034.90	5,034.90		-
301202	朗威股份	2023年6月28日	1个月内(含)	新股流通受限	25.82	25.82	1,748	45,133.36	45,133.36		-
301203	国泰环保	2023年3月28日	6个月	新股锁定	46.13	34.40	165	7,611.45	5,676.00		-
301225	恒勃股份	2023年6月8日	6个月	新股锁定	35.66	33.26	226	8,059.16	7,516.76		-
301232	飞沃科技	2023年6月8日	6个月	新股锁定	72.50	58.42	107	7,757.50	6,250.94		-
301246	宏源药业	2023年3月10日	6个月	新股锁定	50.00	30.71	273	13,650.00	8,383.83		-
301260	格力博	2023年1月20日	6个月	新股锁定	30.85	23.63	498	15,363.30	11,767.74		-
301261	恒工精密	2023年6月29日	1个月内(含)	新股流通受限	36.90	36.90	1,192	43,984.80	43,984.80		-
301261	恒工精密	2023年6月29日	6个月	新股锁定	36.90	36.90	133	4,907.70	4,907.70		-
301262	海看股份	2023年6月13日	6个月	新股锁定	30.22	25.50	305	9,217.10	7,777.50		-
301281	科源制药	2023年3月28日	6个月	新股锁定	44.18	25.10	166	7,333.88	4,166.60		-
301281	科源	2023年	4个月	新股锁	-	25.10	67	-	1,681.70		-

	制药	5月26日		定-送股							
301291	明阳电气	2023年6月21日	6个月	新股锁定	38.13	31.03	260	9,913.80	8,067.80		-
301292	海科新源	2023年6月29日	6个月	新股锁定	19.99	19.99	369	7,376.31	7,376.31		-
301292	海科新源	2023年6月29日	1个月内(含)	新股流通受限	19.99	19.99	3,319	66,346.81	66,346.81		-
301303	真兰仪表	2023年2月13日	6个月	新股锁定	26.80	22.32	413	11,068.40	9,218.16		-
301305	朗坤环境	2023年5月15日	6个月	新股锁定	25.25	19.69	301	7,600.25	5,926.69		-
301307	美利信	2023年4月14日	6个月	新股锁定	32.34	31.86	302	9,766.68	9,621.72		-
301310	鑫宏业	2023年5月26日	6个月	新股锁定	67.28	65.43	179	12,043.12	11,711.97		-
301315	威士顿	2023年6月13日	6个月	新股锁定	32.29	51.12	186	6,005.94	9,508.32		-
301317	鑫磊股份	2023年1月12日	6个月	新股锁定	20.67	26.17	561	11,595.87	14,681.37		-
301322	绿通科技	2023年2月27日	6个月	新股锁定	131.11	53.24	72	9,439.92	3,833.28		-
301322	绿通科技	2023年5月25日	3个月	新股锁定-送股	-	53.24	36	-	1,916.64		-
301323	新莱福	2023年5月29日	6个月	新股锁定	39.06	39.36	131	5,116.86	5,156.16		-
301325	曼恩斯特	2023年5月4日	6个月	新股锁定	76.80	107.95	119	9,139.20	12,846.05		-
301332	德尔玛	2023年5月9日	6个月	新股锁定	14.81	13.73	488	7,227.28	6,700.24		-

301345	涛涛车业	2023年3月10日	6个月	新股锁定	73.45	46.64	83	6,096.35	3,871.12	-
301355	南王科技	2023年6月2日	6个月	新股锁定	17.55	16.75	382	6,704.10	6,398.50	-
301357	北方长龙	2023年4月11日	6个月	新股锁定	50.00	48.39	127	6,350.00	6,145.53	-
301358	湖南裕能	2023年2月1日	6个月	新股锁定	23.77	42.89	332	7,891.64	14,239.48	-
301360	荣旗科技	2023年4月17日	6个月	新股锁定	71.88	92.60	91	6,541.08	8,426.60	-
301373	凌玮科技	2023年1月20日	6个月	新股锁定	33.73	31.85	225	7,589.25	7,166.25	-
301376	致欧科技	2023年6月14日	6个月	新股锁定	24.66	22.51	269	6,633.54	6,055.19	-
301382	蜂助手	2023年5月9日	6个月	新股锁定	23.80	32.84	242	5,759.60	7,947.28	-
301383	天键股份	2023年5月31日	6个月	新股锁定	46.16	35.72	215	9,924.40	7,679.80	-
301386	未来电器	2023年3月21日	6个月	新股锁定	29.99	23.79	237	7,107.63	5,638.23	-
301387	光大同创	2023年4月10日	6个月	新股锁定	58.32	45.36	187	10,905.84	8,482.32	-
301419	阿莱德	2023年2月2日	6个月	新股锁定	24.80	43.85	330	8,184.00	14,470.50	-
301428	世纪恒通	2023年5月10日	6个月	新股锁定	26.35	30.60	186	4,901.10	5,691.60	-
301429	森泰股份	2023年4月10日	6个月	新股锁定	28.75	21.02	377	10,838.75	7,924.54	-
301439	泓淋电力	2023年3月10日	6个月	新股锁定	19.99	16.90	294	5,877.06	4,968.60	-

		日									
301486	致尚科技	2023年6月30日	6个月	新股锁定	57.66	57.66	149	8,591.34	8,591.34	-	
301486	致尚科技	2023年6月30日	1个月内(含)	新股流通受限	57.66	57.66	1,341	77,322.06	77,322.06	-	
601061	中信金属	2023年3月30日	6个月	新股锁定	6.58	7.58	776	5,106.08	5,882.08	-	
601065	江盐集团	2023年3月31日	6个月	新股锁定	10.36	11.84	272	2,817.92	3,220.48	-	
601133	柏诚股份	2023年3月31日	6个月	新股锁定	11.66	12.26	236	2,751.76	2,893.36	-	
603125	常青科技	2023年3月30日	6个月	新股锁定	25.98	24.53	82	2,130.36	2,011.46	-	
603135	中重科技	2023年3月29日	6个月	新股锁定	17.80	17.89	256	4,556.80	4,579.84	-	
603137	恒尚节能	2023年4月10日	6个月	新股锁定	15.90	17.09	139	2,210.10	2,375.51	-	
603172	万丰股份	2023年4月28日	6个月	新股锁定	14.58	16.13	122	1,778.76	1,967.86	-	
688146	中船特气	2023年4月13日	6个月	新股锁定	36.15	38.13	219	7,916.85	8,350.47	-	
688334	西高院	2023年6月9日	6个月	新股锁定	14.16	16.21	476	6,740.16	7,715.96	-	
688352	颀中科技	2023年4月11日	6个月	新股锁定	12.10	12.07	697	8,433.70	8,412.79	-	
688361	中科飞测	2023年5月12日	6个月	新股锁定	23.60	64.67	220	5,192.00	14,227.40	-	
688429	时创能源	2023年6月20日	6个月	新股锁定	19.20	25.53	235	4,512.00	5,999.55	-	
688469	中芯	2023年	6个月	新股锁	5.69	5.41	2,526	14,372.94	13,665.66	-	

	集成	4月28日		定							
688472	阿特斯	2023年6月2日	6个月	新股锁定	11.10	17.04	856	9,501.60	14,586.24		-
688478	晶升股份	2023年4月13日	6个月	新股锁定	32.52	42.37	269	8,747.88	11,397.53		-
688479	友车科技	2023年5月4日	6个月	新股锁定	33.99	29.49	150	5,098.50	4,423.50		-
688484	南芯科技	2023年3月28日	6个月	新股锁定	39.99	36.71	234	9,357.66	8,590.14		-
688485	九州一轨	2023年1月11日	6个月	新股锁定	17.47	15.17	3,580	62,542.60	54,308.60		-
688502	茂莱光学	2023年2月28日	6个月	新股锁定	69.72	178.59	960	66,931.20	171,446.40		-
688512	慧智微	2023年5月8日	6个月	新股锁定	20.92	19.16	307	6,422.44	5,882.12		-
688523	航天环宇	2023年5月26日	6个月	新股锁定	21.86	23.85	308	6,732.88	7,345.80		-
688531	日联科技	2023年3月24日	6个月	新股锁定	152.38	135.97	75	11,428.50	10,197.75		-
688535	华海诚科	2023年3月28日	6个月	新股锁定	35.00	51.23	137	4,795.00	7,018.51		-
688543	国科军工	2023年6月14日	6个月	新股锁定	43.67	53.05	157	6,856.19	8,328.85		-
688552	航天南湖	2023年5月8日	6个月	新股锁定	21.17	23.50	308	6,520.36	7,238.00		-
688562	航天软件	2023年5月15日	6个月	新股锁定	12.68	22.31	410	5,198.80	9,147.10		-
688570	天玛智控	2023年5月29日	6个月	新股锁定	30.26	25.33	239	7,232.14	6,053.87		-

688581	安杰思	2023年5月12日	6个月	新股锁定	125.80	118.03	54	6,793.20	6,373.62	-
688582	芯动联科	2023年6月21日	6个月	新股锁定	26.74	40.68	242	6,471.08	9,844.56	-
688593	新相微	2023年5月25日	6个月	新股锁定	11.18	14.59	499	5,578.82	7,280.41	-
688603	天承科技	2023年6月30日	1个月内(含)	新股流通受限	55.00	55.00	970	53,350.00	53,350.00	-
688603	天承科技	2023年6月30日	6个月	新股锁定	55.00	55.00	108	5,940.00	5,940.00	-
688620	安凯微	2023年6月15日	6个月	新股锁定	10.68	12.34	666	7,112.88	8,218.44	-
688623	双元科技	2023年5月31日	6个月	新股锁定	125.88	86.79	56	7,049.28	4,860.24	-
688629	华丰科技	2023年6月16日	6个月	新股锁定	9.26	18.59	636	5,889.36	11,823.24	-
688631	莱斯信息	2023年6月19日	6个月	新股锁定	25.28	29.87	173	4,373.44	5,167.51	-

注：1. 根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起6个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后6个月内不得转让。

2. 根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于6个月的限售期。

3. 基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000561	烽火电子	2023年6月30日	重大事项停牌	11.57	2023年7月14日	12.73	4,300	40,213.60	49,751.00	-

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经营管理及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。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国银行，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以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业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资产净值的比例较低（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，除附注中列示的卖出回购金融资产款将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，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》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，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)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，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。本基金所持大部分证券在证券交易所上市或银行间同业市场交易，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，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未来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银行存款、结算备付金、存出保证金、债券投资及买入返售金融资产等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,985,458.15	-	-	-	1,985,458.15
结算备付金	20,839,421.54	-	-	-	20,839,421.54
存出保证金	34,185.32	-	-	18,425,534.40	18,459,719.72
交易性金融资产	12,669,758.22	-	-	-156,362,285.14	169,032,043.36
买入返售金融资产	-534.25	-	-	-	-534.25
应收申购款	-	-	-	19,856.81	19,856.81
应收清算款	-	-	-	1,887,863.95	1,887,863.95
资产总计	35,528,288.98	-	-	-176,695,540.30	212,223,829.28
负债					
应付赎回款	-	-	-	580,675.43	580,675.43
应付管理人报酬	-	-	-	175,373.05	175,373.05
应付托管费	-	-	-	35,074.63	35,074.63
应付清算款	-	-	-	376,489.82	376,489.82
应付销售服务费	-	-	-	57,173.92	57,173.92
其他负债	-	-	-	1,137,414.06	1,137,414.06
负债总计	-	-	-	2,362,200.91	2,362,200.91
利率敏感度缺口	35,528,288.98	-	-	-174,333,339.39	209,861,628.37
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

资产					
银行存款	1,271,889.61	-	-	-	1,271,889.61
结算备付金	25,156,810.11	-	-	-	25,156,810.11
存出保证金	182,102.74	-	-	24,232,806.40	24,414,909.14
交易性金融资产	14,826,529.45	-	-	194,141,187.58	208,967,717.03
应收申购款	-	-	-	9,044.40	9,044.40
应收清算款	-	-	-	2,920,109.43	2,920,109.43
资产总计	41,437,331.91	-	-	221,303,147.81	262,740,479.72
负债					
应付赎回款	-	-	-	436,417.23	436,417.23
应付管理人报酬	-	-	-	222,563.43	222,563.43
应付托管费	-	-	-	44,512.71	44,512.71
应付清算款	-	-	-	1,908,553.94	1,908,553.94
应付销售服务费	-	-	-	69,695.70	69,695.70
其他负债	-	-	-	2,799,935.36	2,799,935.36
负债总计	-	-	-	5,481,678.37	5,481,678.37
利率敏感度缺口	41,437,331.91	-	-	-215,821,469.44	257,258,801.35

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，本基金持有交易性债券投资比例较低(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或银行间同业市场交易的股票和债券，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：本基金权益类空头头寸的价值占本基金权益类多头头寸的价值的比例范围在 80%-120%之间。每个交易日日终，持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%。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%。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 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 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	156,362,285.14	74.51	194,141,187.58	75.47
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	156,362,285.14	74.51	194,141,187.58	75.47

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（2023 年 6 月 30 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	1. 业绩比较基准上升 5%	267,888.09	531,131.44
2. 业绩比较基准下降 5%	-267,888.09	-531,131.44	

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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	155,183,404.85	193,433,422.86
第二层次	13,037,496.50	14,826,529.45
第三层次	811,142.01	707,764.72
合计	169,032,043.36	208,967,717.03

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	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	其他各项资产	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）。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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

7.2.2 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。

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

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	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
11	600073	上海梅林	201,600	1,471,680.00	0.70
12	000651	格力电器	39,400	1,438,494.00	0.69
13	002415	海康威视	42,100	1,393,931.00	0.66
14	601398	工商银行	287,000	1,383,340.00	0.66
15	002216	三全食品	88,000	1,371,040.00	0.65
16	002027	分众传媒	198,800	1,353,828.00	0.65
17	300866	安克创新	15,300	1,338,750.00	0.64
18	601857	中国石油	178,100	1,330,407.00	0.63
19	688012	中微公司	7,980	1,248,471.00	0.59
20	000858	五粮液	7,600	1,243,132.00	0.59
21	002475	立讯精密	38,100	1,236,345.00	0.59
22	002697	红旗连锁	208,900	1,219,976.00	0.58
23	000725	京东方 A	288,000	1,177,920.00	0.56
24	002563	森马服饰	188,500	1,172,470.00	0.56
25	601618	中国中冶	294,500	1,169,165.00	0.56
26	000063	中兴通讯	25,500	1,161,270.00	0.55
27	601668	中国建筑	187,980	1,079,005.20	0.51
28	000338	潍柴动力	85,200	1,061,592.00	0.51

29	002967	广电计量	52,500	1,054,725.00	0.50
30	601688	华泰证券	75,300	1,036,881.00	0.49
31	002299	圣农发展	53,700	1,028,355.00	0.49
32	600011	华能国际	110,000	1,018,600.00	0.49
33	002179	中航光电	21,840	990,444.00	0.47
34	300146	汤臣倍健	38,600	925,628.00	0.44
35	600031	三一重工	55,600	924,628.00	0.44
36	600438	通威股份	26,800	919,508.00	0.44
37	600674	川投能源	60,500	910,525.00	0.43
38	601006	大秦铁路	120,400	894,572.00	0.43
39	600580	卧龙电驱	61,200	894,132.00	0.43
40	002371	北方华创	2,800	889,420.00	0.42
41	600863	内蒙华电	210,100	871,915.00	0.42
42	600085	同仁堂	15,100	869,156.00	0.41
43	601998	中信银行	145,200	868,296.00	0.41
44	000938	紫光股份	27,000	859,950.00	0.41
45	600728	佳都科技	123,600	856,548.00	0.41
46	600028	中国石化	134,000	852,240.00	0.41
47	600887	伊利股份	29,600	838,272.00	0.40
48	603301	振德医疗	28,300	838,246.00	0.40
49	601818	光大银行	271,400	833,198.00	0.40
50	600570	恒生电子	18,600	823,794.00	0.39
51	000568	泸州老窖	3,900	817,323.00	0.39
52	002223	鱼跃医疗	22,700	816,973.00	0.39
53	000625	长安汽车	63,000	814,590.00	0.39
54	002233	塔牌集团	105,000	810,600.00	0.39
55	603197	保隆科技	14,800	802,900.00	0.38
56	601128	常熟银行	117,600	802,032.00	0.38
57	000860	顺鑫农业	23,500	791,715.00	0.38
58	600958	东方证券	81,600	791,520.00	0.38
59	600741	华域汽车	42,600	786,396.00	0.37
60	300122	智飞生物	17,718	783,135.60	0.37
61	601319	中国人保	131,000	765,040.00	0.36
62	003816	中国广核	243,700	757,907.00	0.36
63	603027	千禾味业	35,200	743,424.00	0.35
64	300856	科思股份	9,400	740,438.00	0.35
65	600332	白云山	23,200	739,616.00	0.35
66	601872	招商轮船	126,900	734,751.00	0.35
67	002727	一心堂	27,700	731,280.00	0.35
68	300316	晶盛机电	10,300	730,270.00	0.35
69	601211	国泰君安	51,800	724,682.00	0.35
70	601966	玲珑轮胎	32,600	724,372.00	0.35
71	601899	紫金矿业	63,500	721,995.00	0.34

72	000538	云南白药	13,700	718,976.00	0.34
73	002311	海大集团	15,300	716,652.00	0.34
74	000425	徐工机械	105,700	715,589.00	0.34
75	002078	太阳纸业	66,700	713,023.00	0.34
76	600297	广汇汽车	342,100	711,568.00	0.34
77	600699	均胜电子	40,300	710,892.00	0.34
78	000789	万年青	91,300	707,575.00	0.34
79	600985	淮北矿业	61,200	705,024.00	0.34
80	002202	金风科技	65,600	696,672.00	0.33
81	002422	科伦药业	23,400	694,512.00	0.33
82	601877	正泰电器	25,100	694,015.00	0.33
83	600284	浦东建设	110,700	677,484.00	0.32
84	002459	晶澳科技	15,844	660,694.80	0.31
85	002821	凯莱英	5,600	660,016.00	0.31
86	002237	恒邦股份	60,600	659,934.00	0.31
87	002938	鹏鼎控股	26,900	653,401.00	0.31
88	601699	潞安环能	40,000	652,800.00	0.31
89	600183	生益科技	45,900	651,780.00	0.31
90	000408	藏格矿业	28,800	650,016.00	0.31
91	600233	圆通速递	44,400	646,464.00	0.31
92	300285	国瓷材料	23,400	641,160.00	0.31
93	603916	苏博特	48,200	638,168.00	0.30
94	002129	TCL 中环	19,200	637,440.00	0.30
95	601216	君正集团	153,600	629,760.00	0.30
96	300358	楚天科技	41,900	625,567.00	0.30
97	002004	华邦健康	124,800	624,000.00	0.30
98	000733	振华科技	6,400	613,440.00	0.29
99	601377	兴业证券	99,500	608,940.00	0.29
100	600583	海油工程	103,900	607,815.00	0.29
101	002839	张家港行	143,300	606,159.00	0.29
102	600690	海尔智家	25,600	601,088.00	0.29
103	600309	万华化学	6,800	597,312.00	0.28
104	002466	天齐锂业	8,400	587,244.00	0.28
105	600061	国投资本	82,200	585,264.00	0.28
106	001979	招商蛇口	44,900	585,047.00	0.28
107	688599	天合光能	13,440	572,678.40	0.27
108	600050	中国联通	117,400	563,520.00	0.27
109	600585	海螺水泥	23,300	553,142.00	0.26
110	600918	中泰证券	80,000	552,800.00	0.26
111	002304	洋河股份	4,000	525,400.00	0.25
112	600809	山西汾酒	2,800	518,196.00	0.25
113	601669	中国电建	90,100	517,174.00	0.25
114	600362	江西铜业	26,600	504,868.00	0.24

115	002756	永兴材料	8,000	500,880.00	0.24
116	603899	晨光股份	11,200	499,968.00	0.24
117	000708	中信特钢	30,400	481,536.00	0.23
118	600572	康恩贝	70,000	479,500.00	0.23
119	601168	西部矿业	45,400	477,154.00	0.23
120	002373	千方科技	34,200	466,488.00	0.22
121	600597	光明乳业	44,500	462,800.00	0.22
122	000983	山西焦煤	50,400	458,640.00	0.22
123	600276	恒瑞医药	9,500	455,050.00	0.22
124	000060	中金岭南	94,900	450,775.00	0.21
125	603613	国联股份	11,890	439,097.70	0.21
126	002832	比音勒芬	12,400	439,084.00	0.21
127	300872	天阳科技	28,000	435,120.00	0.21
128	300226	上海钢联	13,220	428,328.00	0.20
129	000988	华工科技	11,200	425,712.00	0.20
130	600999	招商证券	31,200	423,384.00	0.20
131	002572	索菲亚	24,200	421,564.00	0.20
132	002484	江海股份	19,600	417,284.00	0.20
133	600639	浦东金桥	33,400	414,494.00	0.20
134	002402	和而泰	23,900	405,822.00	0.19
135	000650	仁和药业	65,800	404,012.00	0.19
136	002409	雅克科技	5,500	400,840.00	0.19
137	000875	吉电股份	74,100	399,399.00	0.19
138	688556	高测股份	7,382	392,279.48	0.19
139	002064	华峰化学	56,900	390,334.00	0.19
140	688006	杭可科技	12,794	389,833.18	0.19
141	000560	我爱我家	147,100	389,815.00	0.19
142	601600	中国铝业	71,000	389,790.00	0.19
143	002739	万达电影	30,900	387,486.00	0.18
144	002745	木林森	42,100	387,320.00	0.18
145	000786	北新建材	15,700	384,807.00	0.18
146	002815	崇达技术	30,800	383,460.00	0.18
147	000630	铜陵有色	132,500	382,925.00	0.18
148	002056	横店东磁	21,000	382,410.00	0.18
149	601717	郑煤机	30,600	380,970.00	0.18
150	603719	良品铺子	15,200	380,152.00	0.18
151	300131	英唐智控	72,400	380,100.00	0.18
152	002139	拓邦股份	29,100	379,755.00	0.18
153	601098	中南传媒	32,700	379,320.00	0.18
154	300144	宋城演艺	30,200	374,480.00	0.18
155	300319	麦捷科技	43,700	374,072.00	0.18
156	600803	新奥股份	19,700	373,906.00	0.18
157	600557	康缘药业	13,600	373,456.00	0.18

158	300232	洲明科技	40,300	368,342.00	0.18
159	601137	博威合金	23,500	365,660.00	0.17
160	603369	今世缘	6,900	364,320.00	0.17
161	603920	世运电路	18,600	363,258.00	0.17
162	002851	麦格米特	9,900	361,053.00	0.17
163	603185	弘元绿能	4,800	357,840.00	0.17
164	600502	安徽建工	67,000	353,760.00	0.17
165	688148	芳源股份	28,780	351,116.00	0.17
166	300003	乐普医疗	15,400	348,194.00	0.17
167	300999	金龙鱼	8,700	347,913.00	0.17
168	300842	帝科股份	3,800	347,472.00	0.17
169	603883	老百姓	11,600	346,260.00	0.16
170	000923	河钢资源	25,400	342,900.00	0.16
171	600057	厦门象屿	39,300	341,910.00	0.16
172	603596	伯特利	4,300	340,818.00	0.16
173	301031	中熔电气	2,500	339,275.00	0.16
174	002048	宁波华翔	25,300	339,020.00	0.16
175	002108	沧州明珠	74,800	338,844.00	0.16
176	300274	阳光电源	2,900	338,227.00	0.16
177	002913	奥士康	8,800	335,984.00	0.16
178	600210	紫江企业	62,600	333,032.00	0.16
179	002690	美亚光电	12,900	332,175.00	0.16
180	601888	中国中免	3,000	331,590.00	0.16
181	002539	云图控股	36,900	331,362.00	0.16
182	688516	奥特维	1,735	326,874.00	0.16
183	600339	中油工程	80,300	326,821.00	0.16
184	001914	招商积余	21,700	326,585.00	0.16
185	002206	海利得	60,600	324,816.00	0.15
186	603979	金诚信	10,400	323,440.00	0.15
187	002171	楚江新材	45,300	322,536.00	0.15
188	301029	怡合达	7,200	321,696.00	0.15
189	600577	精达股份	76,100	321,142.00	0.15
190	603588	高能环境	34,200	320,454.00	0.15
191	000966	长源电力	57,200	319,176.00	0.15
192	601607	上海医药	14,100	315,981.00	0.15
193	600109	国金证券	36,300	314,721.00	0.15
194	000935	四川双马	18,600	313,224.00	0.15
195	600496	精工钢构	83,500	311,455.00	0.15
196	603228	景旺电子	12,100	310,365.00	0.15
197	002594	比亚迪	1,200	309,924.00	0.15
198	601619	嘉泽新能	68,100	309,855.00	0.15
199	600908	无锡银行	57,800	309,808.00	0.15
200	300487	蓝晓科技	4,950	308,979.00	0.15

201	300815	玉禾田	20,640	307,123.20	0.15
202	000739	普洛药业	17,300	306,902.00	0.15
203	600267	海正药业	25,900	294,742.00	0.14
204	002807	江阴银行	79,800	294,462.00	0.14
205	300973	立高食品	4,300	294,206.00	0.14
206	000498	山东路桥	45,600	292,752.00	0.14
207	603323	苏农银行	69,500	292,595.00	0.14
208	002034	旺能环境	18,500	292,485.00	0.14
209	600129	太极集团	4,700	279,603.00	0.13
210	600329	达仁堂	6,100	273,829.00	0.13
211	300896	爱美客	600	266,970.00	0.13
212	603605	珀莱雅	2,300	258,520.00	0.12
213	603187	海容冷链	12,120	242,278.80	0.12
214	002180	纳思达	6,400	219,200.00	0.10
215	000513	丽珠集团	5,300	206,223.00	0.10
216	000963	华东医药	4,300	186,491.00	0.09
217	601138	工业富联	7,100	178,920.00	0.09
218	601985	中国核电	25,100	176,955.00	0.08
219	688502	茂莱光学	960	171,446.40	0.08
220	002368	太极股份	4,100	168,797.00	0.08
221	601390	中国中铁	22,000	166,760.00	0.08
222	601766	中国中车	25,000	162,500.00	0.08
223	601186	中国铁建	15,600	153,660.00	0.07
224	601816	京沪高铁	28,700	150,962.00	0.07
225	600271	航天信息	10,800	147,852.00	0.07
226	002152	广电运通	12,600	147,672.00	0.07
227	300033	同花顺	700	122,696.00	0.06
228	601117	中国化学	14,200	117,576.00	0.06
229	600161	天坛生物	3,500	95,025.00	0.05
230	000933	神火股份	6,800	88,400.00	0.04
231	301486	致尚科技	1,490	85,913.40	0.04
232	000932	华菱钢铁	17,600	83,952.00	0.04
233	600096	云天化	4,700	80,229.00	0.04
234	000591	太阳能	11,800	80,004.00	0.04
235	000878	云南铜业	6,900	76,245.00	0.04
236	600039	四川路桥	7,700	75,537.00	0.04
237	600153	建发股份	6,900	75,279.00	0.04
238	301292	海科新源	3,688	73,723.12	0.04
239	600141	兴发集团	3,300	73,326.00	0.03
240	000951	中国重汽	4,200	70,770.00	0.03
241	600170	上海建工	26,000	69,940.00	0.03
242	600704	物产中大	14,100	69,654.00	0.03
243	002080	中材科技	3,300	67,716.00	0.03

244	000400	许继电气	2,900	66,845.00	0.03
245	600529	山东药玻	2,400	65,328.00	0.03
246	300088	长信科技	10,800	65,124.00	0.03
247	600820	隧道股份	10,800	64,908.00	0.03
248	600642	申能股份	9,200	64,308.00	0.03
249	600008	首创环保	22,100	63,648.00	0.03
250	600582	天地科技	10,600	61,798.00	0.03
251	601975	招商南油	21,100	60,346.00	0.03
252	300760	迈瑞医疗	200	59,960.00	0.03
253	601000	唐山港	16,800	59,304.00	0.03
254	688603	天承科技	1,078	59,290.00	0.03
255	000830	鲁西化工	5,600	59,136.00	0.03
256	600598	北大荒	4,400	58,652.00	0.03
257	600528	中铁工业	5,900	58,292.00	0.03
258	000778	新兴铸管	14,200	57,936.00	0.03
259	600761	安徽合力	2,900	57,797.00	0.03
260	000528	柳 工	7,200	56,880.00	0.03
261	002128	电投能源	4,300	56,846.00	0.03
262	600967	内蒙一机	5,400	54,540.00	0.03
263	600511	国药股份	1,400	54,390.00	0.03
264	688485	九州一轨	3,580	54,308.60	0.03
265	002061	浙江交科	12,100	53,966.00	0.03
266	002038	双鹭药业	5,200	52,468.00	0.03
267	600328	中盐化工	5,750	51,750.00	0.02
268	601860	紫金银行	20,600	51,706.00	0.02
269	600929	雪天盐业	6,500	51,610.00	0.02
270	600710	苏美达	6,000	51,360.00	0.02
271	002091	江苏国泰	6,800	51,272.00	0.02
272	300457	赢合科技	2,900	51,214.00	0.02
273	600062	华润双鹤	2,900	50,518.00	0.02
274	000598	兴蓉环境	9,290	50,444.70	0.02
275	002258	利尔化学	3,900	50,349.00	0.02
276	301202	朗威股份	1,943	50,168.26	0.02
277	601918	新集能源	11,800	50,150.00	0.02
278	000561	烽火电子	4,300	49,751.00	0.02
279	601001	晋控煤业	5,300	49,608.00	0.02
280	601928	凤凰传媒	4,300	49,020.00	0.02
281	301261	恒工精密	1,325	48,892.50	0.02
282	600720	祁连山	4,300	48,891.00	0.02
283	600420	国药现代	4,300	48,547.00	0.02
284	601369	陕鼓动力	5,300	48,283.00	0.02
285	600125	铁龙物流	7,800	47,112.00	0.02
286	002060	粤 水 电	7,100	46,718.00	0.02

287	600531	豫光金铅	7,400	46,620.00	0.02
288	000589	贵州轮胎	8,300	46,480.00	0.02
289	600968	海油发展	15,100	46,357.00	0.02
290	601801	皖新传媒	4,900	46,011.00	0.02
291	000915	华特达因	1,300	45,877.00	0.02
292	000049	德赛电池	1,300	45,864.00	0.02
293	300770	新媒股份	1,000	45,860.00	0.02
294	000719	中原传媒	3,900	45,630.00	0.02
295	601200	上海环境	4,800	45,552.00	0.02
296	601789	宁波建工	9,400	44,462.00	0.02
297	002449	国星光电	5,000	44,450.00	0.02
298	000822	山东海化	6,500	44,265.00	0.02
299	002106	莱宝高科	5,200	44,200.00	0.02
300	600373	中文传媒	3,300	43,956.00	0.02
301	000912	泸天化	9,400	43,052.00	0.02
302	600623	华谊集团	6,900	42,987.00	0.02
303	600866	星湖科技	7,800	42,900.00	0.02
304	600742	一汽富维	5,200	42,588.00	0.02
305	600508	上海能源	2,900	42,572.00	0.02
306	000501	武商集团	4,300	42,527.00	0.02
307	300772	运达股份	3,300	42,504.00	0.02
308	601139	深圳燃气	5,800	42,282.00	0.02
309	600757	长江传媒	4,900	42,140.00	0.02
310	603299	苏盐井神	4,200	41,916.00	0.02
311	603327	福蓉科技	3,500	41,580.00	0.02
312	002226	江南化工	8,200	41,574.00	0.02
313	000900	现代投资	10,300	41,509.00	0.02
314	600510	黑牡丹	6,800	41,276.00	0.02
315	000026	飞亚达	3,400	41,004.00	0.02
316	000823	超声电子	4,300	40,764.00	0.02
317	600997	开滦股份	6,800	40,596.00	0.02
318	600300	维维股份	13,300	40,432.00	0.02
319	000582	北部湾港	5,300	40,280.00	0.02
320	000968	蓝焰控股	5,300	40,068.00	0.02
321	600035	楚天高速	9,800	39,984.00	0.02
322	600874	创业环保	6,800	39,848.00	0.02
323	603328	依顿电子	4,800	39,744.00	0.02
324	002573	清新环境	7,200	39,672.00	0.02
325	601101	昊华能源	6,800	39,576.00	0.02
326	600750	江中药业	1,800	39,474.00	0.02
327	601019	山东出版	4,300	39,431.00	0.02
328	000737	北方铜业	7,300	39,347.00	0.02
329	600475	华光环能	3,300	39,204.00	0.02

330	600618	氯碱化工	4,300	38,571.00	0.02
331	600971	恒源煤电	4,900	38,171.00	0.02
332	002267	陕天然气	4,800	38,016.00	0.02
333	600941	中国移动	400	37,320.00	0.02
334	002911	佛燃能源	2,900	37,294.00	0.02
335	002238	天威视讯	5,300	36,729.00	0.02
336	600229	城市传媒	4,300	36,636.00	0.02
337	600012	皖通高速	3,400	35,632.00	0.02
338	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.02
339	000411	英特集团	2,900	35,003.00	0.02
340	000505	京粮控股	4,700	34,968.00	0.02
341	002140	东华科技	3,800	34,314.00	0.02
342	600479	千金药业	3,000	33,840.00	0.02
343	600814	杭州解百	3,800	32,490.00	0.02
344	603213	镇洋发展	2,400	28,632.00	0.01
345	301087	可孚医疗	400	19,720.00	0.01
346	301317	鑫磊股份	561	14,681.37	0.01
347	688472	阿特斯	856	14,586.24	0.01
348	301419	阿莱德	330	14,470.50	0.01
349	301358	湖南裕能	332	14,239.48	0.01
350	688361	中科飞测	220	14,227.40	0.01
351	603195	公牛集团	148	14,216.88	0.01
352	688469	中芯集成	2,526	13,665.66	0.01
353	301325	曼恩斯特	119	12,846.05	0.01
354	600729	重庆百货	400	12,576.00	0.01
355	002709	天赐材料	300	12,357.00	0.01
356	603757	大元泵业	400	11,936.00	0.01
357	688629	华丰科技	636	11,823.24	0.01
358	301260	格力博	498	11,767.74	0.01
359	301310	鑫宏业	179	11,711.97	0.01
360	300900	广联航空	400	11,524.00	0.01
361	688478	晶升股份	269	11,397.53	0.01
362	002007	华兰生物	500	11,205.00	0.01
363	002384	东山精密	400	10,360.00	0.00
364	688531	日联科技	75	10,197.75	0.00
365	688582	芯动联科	242	9,844.56	0.00
366	301307	美利信	302	9,621.72	0.00
367	301315	威士顿	186	9,508.32	0.00
368	301303	真兰仪表	413	9,218.16	0.00
369	688562	航天软件	410	9,147.10	0.00
370	688484	南芯科技	234	8,590.14	0.00
371	301387	光大同创	187	8,482.32	0.00
372	002714	牧原股份	200	8,430.00	0.00

373	301360	荣旗科技	91	8,426.60	0.00
374	688352	硕中科技	697	8,412.79	0.00
375	301246	宏源药业	273	8,383.83	0.00
376	688146	中船特气	219	8,350.47	0.00
377	688543	国科军工	157	8,328.85	0.00
378	688620	安凯微	666	8,218.44	0.00
379	301141	中科磁业	190	8,111.10	0.00
380	301291	明阳电气	260	8,067.80	0.00
381	301382	蜂助手	242	7,947.28	0.00
382	301429	森泰股份	377	7,924.54	0.00
383	301262	海看股份	305	7,777.50	0.00
384	688334	西高院	476	7,715.96	0.00
385	301383	天键股份	215	7,679.80	0.00
386	300759	康龙化成	200	7,656.00	0.00
387	301225	恒勃股份	226	7,516.76	0.00
388	300031	宝通科技	300	7,416.00	0.00
389	688523	航天环宇	308	7,345.80	0.00
390	688593	新相微	499	7,280.41	0.00
391	001287	中电港	346	7,272.92	0.00
392	600938	中国海油	400	7,248.00	0.00
393	688552	航天南湖	308	7,238.00	0.00
394	301373	凌玮科技	225	7,166.25	0.00
395	603298	杭叉集团	300	7,065.00	0.00
396	688535	华海诚科	137	7,018.51	0.00
397	002555	三七互娱	200	6,976.00	0.00
398	603259	药明康德	111	6,916.41	0.00
399	603103	横店影视	400	6,736.00	0.00
400	603233	大参林	240	6,722.40	0.00
401	301332	德尔玛	488	6,700.24	0.00
402	301355	南王科技	382	6,398.50	0.00
403	688581	安杰思	54	6,373.62	0.00
404	301232	飞沃科技	107	6,250.94	0.00
405	301357	北方长龙	127	6,145.53	0.00
406	301376	致欧科技	269	6,055.19	0.00
407	688570	天玛智控	239	6,053.87	0.00
408	301157	华塑科技	114	6,034.02	0.00
409	688429	时创能源	235	5,999.55	0.00
410	301305	朗坤环境	301	5,926.69	0.00
411	600066	宇通客车	400	5,896.00	0.00
412	688512	慧智微	307	5,882.12	0.00
413	601061	中信金属	776	5,882.08	0.00
414	301281	科源制药	233	5,848.30	0.00
415	301322	绿通科技	108	5,749.92	0.00

416	300804	广康生化	173	5,703.81	0.00
417	301428	世纪恒通	186	5,691.60	0.00
418	301203	国泰环保	165	5,676.00	0.00
419	301386	未来电器	237	5,638.23	0.00
420	300638	广和通	240	5,443.20	0.00
421	301170	锡南科技	150	5,239.50	0.00
422	688631	莱斯信息	173	5,167.51	0.00
423	301323	新莱福	131	5,156.16	0.00
424	600835	上海机电	300	5,154.00	0.00
425	603071	物产环能	300	4,977.00	0.00
426	301439	泓淋电力	294	4,968.60	0.00
427	688623	双元科技	56	4,860.24	0.00
428	600876	凯盛新能	300	4,788.00	0.00
429	603135	中重科技	256	4,579.84	0.00
430	688479	友车科技	150	4,423.50	0.00
431	600104	上汽集团	300	4,251.00	0.00
432	605222	起帆电缆	200	4,132.00	0.00
433	603118	共进股份	300	3,987.00	0.00
434	001380	华纬科技	127	3,909.06	0.00
435	000048	京基智农	200	3,904.00	0.00
436	301345	涛涛车业	83	3,871.12	0.00
437	600886	国投电力	300	3,795.00	0.00
438	603960	克来机电	200	3,730.00	0.00
439	601869	长飞光纤	100	3,701.00	0.00
440	601225	陕西煤业	200	3,638.00	0.00
441	600903	贵州燃气	400	3,460.00	0.00
442	003006	百亚股份	200	3,456.00	0.00
443	002130	沃尔核材	400	3,248.00	0.00
444	601065	江盐集团	272	3,220.48	0.00
445	002782	可立克	200	3,058.00	0.00
446	002648	卫星化学	200	2,992.00	0.00
447	300058	蓝色光标	300	2,901.00	0.00
448	601133	柏诚股份	236	2,893.36	0.00
449	600406	国电南瑞	120	2,772.00	0.00
450	002271	东方雨虹	100	2,726.00	0.00
451	600197	伊力特	100	2,717.00	0.00
452	603599	广信股份	100	2,708.00	0.00
453	000027	深圳能源	400	2,636.00	0.00
454	601609	金田股份	400	2,596.00	0.00
455	001328	登康口腔	101	2,574.49	0.00
456	000895	双汇发展	100	2,449.00	0.00
457	001282	三联锻造	74	2,444.22	0.00
458	600391	航发科技	100	2,411.00	0.00

459	603137	恒尚节能	139	2,375.51	0.00
460	600547	山东黄金	100	2,348.00	0.00
461	600637	东方明珠	300	2,346.00	0.00
462	000975	银泰黄金	200	2,340.00	0.00
463	000783	长江证券	400	2,320.00	0.00
464	601728	中国电信	400	2,252.00	0.00
465	001360	南矿集团	140	2,081.80	0.00
466	002600	领益智造	300	2,073.00	0.00
467	001367	海森药业	52	2,052.96	0.00
468	603125	常青科技	82	2,011.46	0.00
469	603172	万丰股份	122	1,967.86	0.00
470	002925	盈趣科技	100	1,940.00	0.00
471	001324	长青科技	98	1,920.80	0.00
472	603218	日月股份	100	1,899.00	0.00
473	300674	宇信科技	100	1,768.00	0.00
474	600415	小商品城	200	1,706.00	0.00
475	601615	明阳智能	100	1,688.00	0.00
476	600682	南京新百	200	1,602.00	0.00
477	002010	传化智联	300	1,596.00	0.00
478	601077	渝农商行	400	1,436.00	0.00
479	000166	申万宏源	300	1,386.00	0.00
480	002135	东南网架	200	1,292.00	0.00
481	600789	鲁抗医药	200	1,284.00	0.00
482	600312	平高电气	100	1,239.00	0.00
483	600901	江苏金租	280	1,156.40	0.00
484	600795	国电电力	300	1,149.00	0.00
485	002641	公元股份	200	1,128.00	0.00
486	601800	中国交建	100	1,091.00	0.00
487	600390	五矿资本	200	1,076.00	0.00
488	600717	天津港	200	886.00	0.00
489	002926	华西证券	100	831.00	0.00
490	600888	新疆众和	100	792.00	0.00
491	000157	中联重科	100	675.00	0.00
492	600027	华电国际	100	669.00	0.00
493	000543	皖能电力	100	660.00	0.00
494	000728	国元证券	100	652.00	0.00
495	000937	冀中能源	100	638.00	0.00
496	000727	冠捷科技	300	636.00	0.00
497	000415	渤海租赁	300	630.00	0.00
498	600018	上港集团	100	525.00	0.00
499	000652	泰达股份	100	412.00	0.00
500	601333	广深铁路	100	396.00	0.00
501	002314	南山控股	100	330.00	0.00

502	603013	亚普股份	20	313.60	0.00
503	688777	中控技术	3	188.34	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	600048	保利发展	4,494,469.00	1.75
2	600900	长江电力	3,790,076.00	1.47
3	601318	中国平安	2,783,240.00	1.08
4	601618	中国中冶	2,761,873.00	1.07
5	600919	江苏银行	2,737,352.00	1.06
6	600958	东方证券	2,423,319.11	0.94
7	000333	美的集团	2,391,824.00	0.93
8	601319	中国人保	2,377,240.00	0.92
9	002415	海康威视	2,322,222.00	0.90
10	601857	中国石油	2,205,823.00	0.86
11	600057	厦门象屿	2,170,372.00	0.84
12	600028	中国石化	2,037,595.00	0.79
13	002236	大华股份	2,035,610.00	0.79
14	600742	一汽富维	1,964,563.00	0.76
15	600938	中国海油	1,902,153.00	0.74
16	000651	格力电器	1,875,500.00	0.73
17	002271	东方雨虹	1,855,427.00	0.72
18	601166	兴业银行	1,853,728.00	0.72
19	000725	京东方 A	1,756,870.00	0.68
20	002459	晶澳科技	1,751,406.00	0.68

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	601166	兴业银行	3,920,078.00	1.52
2	600030	中信证券	2,903,023.55	1.13
3	600742	一汽富维	2,653,311.78	1.03
4	600900	长江电力	2,639,348.00	1.03
5	300596	利安隆	2,590,823.00	1.01
6	002459	晶澳科技	2,575,653.00	1.00
7	600028	中国石化	2,537,547.00	0.99
8	603259	药明康德	2,506,777.00	0.97
9	600057	厦门象屿	2,484,135.00	0.97
10	601318	中国平安	2,438,926.00	0.95

11	300750	宁德时代	2,432,179.00	0.95
12	600048	保利发展	2,390,673.14	0.93
13	000333	美的集团	2,387,172.00	0.93
14	600519	贵州茅台	2,348,495.00	0.91
15	002415	海康威视	2,208,614.00	0.86
16	002594	比亚迪	2,197,907.00	0.85
17	601319	中国人保	2,163,432.00	0.84
18	600710	苏美达	2,162,505.00	0.84
19	600150	中国船舶	2,149,217.00	0.84
20	603882	金域医学	2,138,649.00	0.83

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	461,074,275.46
卖出股票收入（成交）总额	507,370,722.94

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	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

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	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

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。

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 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-1,321,858.79 元，公允价值变动损益为 4,213,414.88 元。

7.13 投资组合报告附注

7.13.1 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市分局责令改正、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。

7.13.2 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。

7.13.3 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	18,459,719.72
2	应收清算款	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	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	20,367,440.48

7.13.4 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。

7.13.5 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。

7.13.6 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 (%)
华宝量化对冲混合 A	18,096	1,944.74	372,549.83	1.06	34,819,530.07	98.94
华宝量化对冲混合 C	67,138	2,329.83	13,342,314.91	8.53	143,078,123.33	91.47
合计	85,234	2,248.08	13,714,864.74	7.16	177,897,653.40	92.84

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	华宝量化对冲混合 A	122,379.04	0.3477
	华宝量化对冲混合 C	1,377.88	0.0009
	合计	123,756.92	0.0646

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	华宝量化对冲混合 A	10~50
	华宝量化对冲混合 C	0~10
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	华宝量化对冲混合 A	0
	华宝量化对冲混合 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	-	-	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，本基金管理人运用固有资金、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、本基金管理人运用固有资金于 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 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
基金合同生效日 (2014 年 9 月 17 日) 基金份额总额	539,601,058.43	67,437,011.52
本报告期期初基金份额总额	51,026,888.27	187,456,029.40
本报告期基金总申购份额	1,780,793.59	21,954,494.25
减：本报告期基金总赎回份额	17,615,601.96	52,990,085.41
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份	35,192,079.90	156,420,438.24

额总额		
-----	--	--

§ 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，无涉及本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

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：本基金合同生效之日起至本报告期末。

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，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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 (%)	
浙商证券	2	136,506,640.53	14.20	125,764.24	14.12	-
广发证券	2	100,401,532.	10.44	92,500.64	10.39	-

		08				
第一创业	1	86,315,745.31	8.98	80,386.68	9.03	-
中金国际	2	86,280,125.16	8.97	79,490.05	8.92	-
上海证券	2	79,619,436.54	8.28	74,150.46	8.33	-
东海证券	2	76,099,497.16	7.91	70,870.88	7.96	-
中信建投	2	72,203,810.33	7.51	67,234.17	7.55	-
方正证券	1	62,465,850.87	6.50	57,550.17	6.46	-
东吴证券	2	59,321,065.96	6.17	54,652.60	6.14	-
开源证券	2	46,018,958.70	4.79	42,847.14	4.81	-
东方财富	2	31,085,329.29	3.23	28,701.45	3.22	-
海通证券	2	28,612,879.33	2.98	26,645.37	2.99	-
东亚前海证券	1	28,184,404.83	2.93	26,248.16	2.95	-
国泰君安	1	20,810,632.16	2.16	19,381.74	2.18	-
财通证券	3	15,334,797.71	1.59	14,268.94	1.60	-
天风证券	3	8,300,667.68	0.86	7,730.63	0.87	-
华金证券	1	7,278,682.18	0.76	6,778.01	0.76	-
国元证券	2	4,000,154.65	0.42	3,685.33	0.41	-
申万宏源	3	3,401,340.04	0.35	3,133.69	0.35	-
江海证券	2	3,144,600.00	0.33	2,897.17	0.33	-
国联证券	3	2,882,084.32	0.30	2,684.16	0.30	-
华泰证券	2	1,459,490.35	0.15	1,353.74	0.15	-
东方证券	1	982,721.53	0.10	905.39	0.10	-
华宝证券	1	693,647.13	0.07	639.02	0.07	-
德邦证券	1	120,441.80	0.01	110.97	0.01	-
光大证券	2	91,288.80	0.01	85.02	0.01	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
长城证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
诚通证券	2	-	-	-	-	-
大和证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-

国海证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
宏信证券	2	-	-	-	-	-
华安证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
麦高证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	2	-	-	-	-	-
申港证券	1	-	-	-	-	-
五矿证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
英大证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	3	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-
中邮证券	1	-	-	-	-	-

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状况稳定；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 要，并能为本基金提供全面的信息服 务；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、本报告期租用的证券公司交易单元新增的有：财通证券、华泰证券、麦高证券、中信证券、中邮证券。

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

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
浙商证券	-	-	-	-	-	-

广发证券	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	11,801,000.00	7.41	-	-
中金国际	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	5,586,000.00	3.51	-	-
中信建投	10,542,616.99	87.43	33,100,000.00	20.77	-	-
方正证券	1,515,393.70	12.57	39,739,000.00	24.94	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	19,900,000.00	12.49	-	-
东方财富	-	-	5,909,000.00	3.71	-	-
海通证券	-	-	1,500,000.00	0.94	-	-
东亚前海证券	-	-	10,514,000.00	6.60	-	-
国泰君安	-	-	20,814,000.00	13.06	-	-
财通证券	-	-	9,678,000.00	6.07	-	-
天风证券	-	-	800,000.00	0.50	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-

华宝证 券	-	-	-	-	-	-
德邦证 券	-	-	-	-	-	-
光大证 券	-	-	-	-	-	-
安信证 券	-	-	-	-	-	-
长城证 券	-	-	-	-	-	-
长江证 券	-	-	-	-	-	-
诚通证 券	-	-	-	-	-	-
大和证 券	-	-	-	-	-	-
东北证 券	-	-	-	-	-	-
国海证 券	-	-	-	-	-	-
国金证 券	-	-	-	-	-	-
国信证 券	-	-	-	-	-	-
宏信证 券	-	-	-	-	-	-
华安证 券	-	-	-	-	-	-
华创证 券	-	-	-	-	-	-
麦高证 券	-	-	-	-	-	-
民生证 券	-	-	-	-	-	-
申港证 券	-	-	-	-	-	-
五矿证 券	-	-	-	-	-	-
信达证 券	-	-	-	-	-	-
兴业证 券	-	-	-	-	-	-
英大证 券	-	-	-	-	-	-

招商证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
中邮证券	-	-	-	-	-	-

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	华宝量化对冲策略混合型发起式证券投资基金 2022 年第 4 季度报告	基金管理人网站	2023-01-19
2	华宝量化对冲策略混合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	2023-03-24
3	华宝量化对冲策略混合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	2023-03-24
4	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（更新）	基金管理人网站	2023-03-24
5	华宝量化对冲策略混合型发起式证券投资基金 2022 年年度报告	基金管理人网站	2023-03-31
6	华宝基金关于旗下部分基金新增中邮证券有限责任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	2023-04-17
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	2023-04-22
8	华宝量化对冲策略混合型发起式证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	基金管理人网站	2023-04-23
9	华宝基金关于旗下部分基金新增兴业银行股份有限公司（银银平台）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	2023-04-26
10	华宝基金关于旗下部分基金新增麦高证券有限责任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	2023-05-08
11	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, 证券时报, 中国证券报	2023-05-30
12	华宝基金关于旗下部分基金新增西部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	2023-06-16

§ 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

§ 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。

12.2 存放地点

以上文件存于基金管理人办公场所和基金托管人住所备投资者查阅。

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

2023 年 8 月 31 日