

华宝量化对冲策略混合型发起式证券投资
基金
2024 年中期报告

2024 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：2024 年 8 月 30 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 2024 年 08 月 28 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 2024 年 01 月 01 日起至 2024 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	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
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	14
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	14
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、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	16
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	19
§ 7 投资组合报告	42
7.1 期末基金资产组合情况	42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	43
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	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	55
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	56
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	57

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	57
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	57
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	57
7.10	本基金投资股指期货的投资政策	57
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	58
7.12	市场中性策略执行情况	58
7.13	投资组合报告附注	58
§ 8	基金份额持有人信息	59
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	59
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	59
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	60
8.4	发起式基金发起资金持有份额情况	60
§ 9	开放式基金份额变动	61
§ 10	重大事件揭示	61
10.1	基金份额持有人大会决议	61
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	61
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	61
10.4	基金投资策略的改变	62
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	62
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	62
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	62
10.8	其他重大事件	65
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息	67
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	67
11.2	影响投资者决策的其他重要信息	68
§ 12	备查文件目录	68
12.1	备查文件目录	68
12.2	存放地点	68
12.3	查阅方式	68

§ 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	320,567,933.47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	华宝量化对冲混合 D
下属分级基金的交 易代码	000753	000754	021381
报告期末下属分级 基金的份额总额	77,197,209.93份	155,451,556.91份	87,919,166.63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(2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日)		
	华宝量化对冲混合 A	华宝量化对冲混合 C	华宝量化对冲混合 D
			2024 年 4 月 26 日 (基金合同生效日)-2024 年 6 月 30 日
本期已实现收益	2,530,673.70	7,717,561.80	200,782.58
本期利润	2,373,751.06	7,710,336.86	341,569.95
加权平均基金份额本期利润	0.0423	0.0429	0.0269
本期加权平均净值利润率	3.65%	3.82%	2.30%
本期基金份额净值	4.13%	3.92%	1.22%

增长率			
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024年6月30日)		
期末可供分配利润	13,378,106.14	21,710,565.80	15,225,363.11
期末可供分配基金份额利润	0.1733	0.1397	0.1732
期末基金资产净值	90,575,316.07	177,162,122.71	103,144,529.74
期末基金份额净值	1.1733	1.1397	1.1732
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年6月30日)		
基金份额累计净值增长率	44.16%	40.08%	1.22%

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。

5. 自 2024 年 04 月 26 日分级基金成立日起，增设华宝量化对冲混合 D, D 份额的实际起始日 2024 年 04 月 29 日。

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	0.67%	0.23%	0.12%	0.00%	0.55%	0.23%
过去三个月	1.17%	0.25%	0.37%	0.00%	0.80%	0.25%
过去六个月	4.13%	0.28%	0.75%	0.01%	3.38%	0.27%
过去一年	4.97%	0.22%	1.50%	0.00%	3.47%	0.22%
过去三年	-0.64%	0.25%	4.50%	0.00%	-5.14%	0.25%

自基金合同生效起 至今	44.16%	0.27%	15.71%	0.01%	28.45%	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	0.64%	0.23%	0.12%	0.00%	0.52%	0.23%
过去三个月	1.07%	0.25%	0.37%	0.00%	0.70%	0.25%
过去六个月	3.92%	0.28%	0.75%	0.01%	3.17%	0.27%
过去一年	4.54%	0.22%	1.50%	0.00%	3.04%	0.22%
过去三年	-1.83%	0.25%	4.50%	0.00%	-6.33%	0.25%
自基金合同生效起 至今	40.08%	0.27%	15.71%	0.01%	24.37%	0.26%

华宝量化对冲混合 D

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	0.66%	0.23%	0.12%	0.00%	0.54%	0.23%
过去三个月	-	-	-	-	-	-
过去六个月	-	-	-	-	-	-
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起 至今	1.22%	0.24%	0.27%	0.00%	0.95%	0.24%

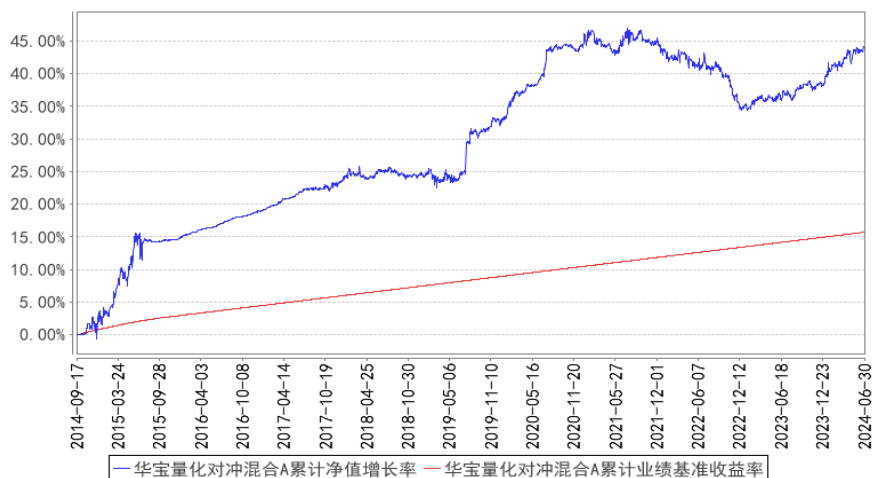
注：（1）基金业绩基准：一年期银行定期存款利率（税后）；

（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）；

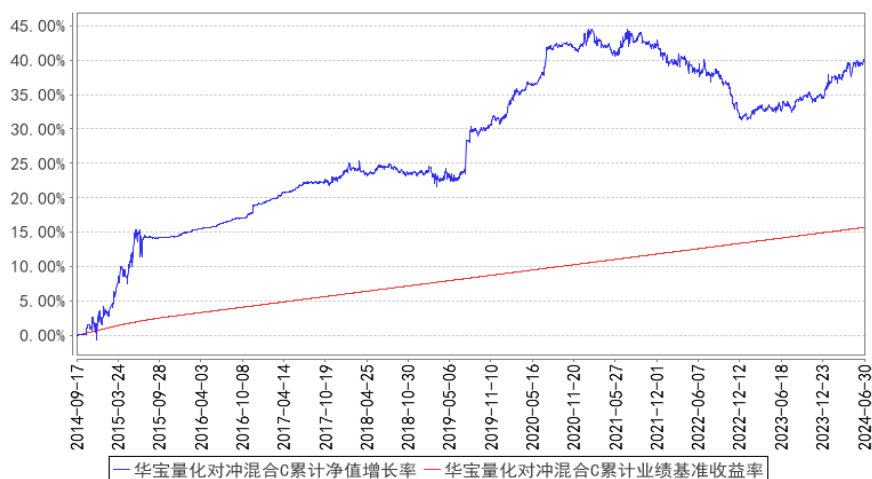
（3）报告期内新增基金 C 份额，基金 C 份额成立于 2024 年 04 月 26 日。

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

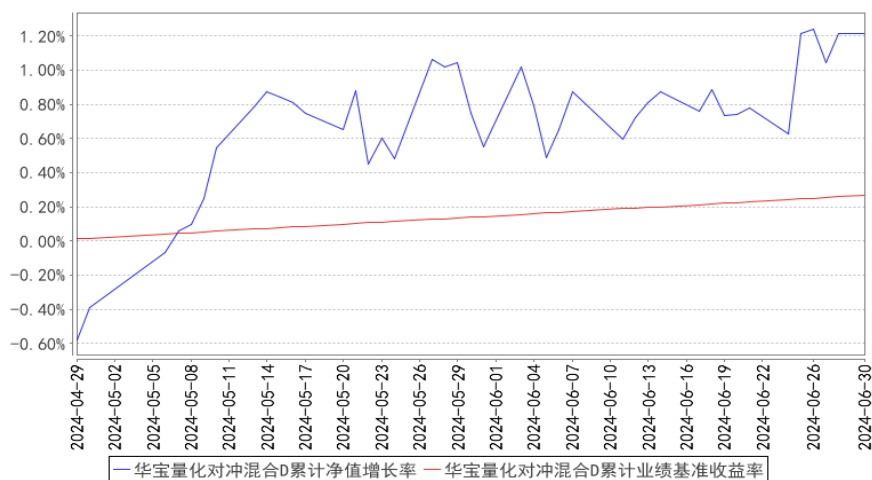
华宝量化对冲混合A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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



华宝量化对冲混合D累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：按照基金合同的约定，基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定，截至 2015 年 03 月 17 日，本基金已达到合同规定的资产配置比例。

§ 4 管理人报告

4.1 基金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。截至本报告期末（2024 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 141 只，涵盖股票型基金、混合型基金、债券型基金、货币市场基金、FOF 等。

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	-	22 年	硕士。曾在兴业证券、凯龙财经（上海）有限公司、中原证券从事金融工程研究工作。2005 年 8 月加入华宝基金管理有限公司，先后担任金融工程部数量分析师、金融工程部副总经理等职务，现任量化投资总监、量化投资部总经理。2009 年 9 月至 2015 年 11 月任华宝中证 100 指数证券投资基金基金经理，2010 年 4 月至 2015 年 11 月任上证 180 价值交易型开放式指数证券投资基金、华宝上证 180 价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，2014 年 9 月起任华宝量化对冲策略混合型发起式证券投资基金基金经理，2015 年 4 月至 2020 年 2 月任华宝事件驱动混合型证券投资基金基金经理，2016 年 12 月起任华宝沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金基金经理，2019 年 2 月至 2022 年 10 月任华宝科技先锋混合型证券投资基金基金经理，2021 年 12 月至 2023 年 11 月任华宝中证稀有金属主题指数增强型发起式证券投资基金基金经理，2022 年 8 月至 2023 年 11 月任华宝高端装备股票型发起式证券投资基金基金

					经理，2023 年 2 月起任华宝量化选股混合型发起式证券投资基金基金经理。
王正	本基金基金经理	2020-01-02	-	12 年	硕士。2012 年 7 月加入华宝基金管理有限公司，先后担任助理量化分析师、分析师、基金经理助理等职务。2020 年 1 月起任华宝沪深 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。

4.1.3 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

本报告期内，本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 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

2024 年上半年全球宏观及地缘风险依然没有改善的迹象，美联储降息预期延后，俄乌和中东冲突局势未明，前期强势的资产依然表现较好，美元指数和美股维持高位，大宗商品黄金和原油也较为坚挺。国内方面，上半年经济数据显示信贷社融疲软，内需消费整体偏弱，生产端景气度平平，外需及出口韧性较强、形成一定支撑，物价有所回暖。货币政策更加兼顾内外均衡，在稳汇率的目标下，政策基调维持稳健灵活，市场利率短期下行空间有限。基于当前复杂的内外形势，政策将更加落实到发展新质生产力、结构调整优化、防范化解风险等固本培元、高质量发展的方向上。

股票市场方面，上半年市场风险偏好仍然较低，红利避险类资产表现相对较好，但多数指数下跌。整体来看，上半年大盘金融类和红利稳定类指数明显优于中小盘、消费及成长类指数，报告期沪深 300 指数略涨 0.89%，中证红利指数上涨 7.75%，中证 2000 指数下跌 23.28%，创业板指数下跌 10.99%。行业层面，银行、煤炭、家用电器、公用事业、石油石化等稳定高股息板块相对强势，但医药、食品饮料、计算机以及地产链走势较弱。因子层面，行业中性视角下，上半年沪深 300 内的长期符合逻辑的因子均有所表现，价值类因子依然较好，同时成长、盈利质量、分析师等因子也录得正超额。另外（大）市值因子表现也非常突出。

选股方面通过量化 Alpha 多因子选股模型，在期指对应的指数成分股及备选股中精选估值和业绩相匹配、基本面优质、经营稳健、具有核心竞争力的标的。本报告期，基金仍然坚持稳健的市场中性投资策略，利用股指期货对股票组合进行对冲，剥离系统性风险。报告期内各期指基差出现不同程度的走弱、IC 和 IM 贴水加深，基金根据不同品种基差情况进行了灵活的仓位调整，目前的对冲环境较前期对冲成本有所上升，但在历史上来看仍处于中位区间。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本报告期内基金份额 A 类净值增长率为 4.13%，同期业绩比较基准收益率为 0.75%；本报告期内基金份额 C 类净值增长率为 3.92%，同期业绩比较基准收益率为 0.75%；本报告期内基金份额 D 类净值增长率为 1.22%，同期业绩比较基准收益率为 0.27%。

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，金融市场仍可能面临一定的挑战：一是国际局势动荡，全球资产波动加大，美联储加息进程、美国大选、俄乌冲突、中美关系等均存在一定的不确定性及外部扰动的可能；二是居民端的资产负债表和现金流量表不同程度上被前两年的下行周期破坏，需要时间修复，内需的释放和产业的升级仍需更大的政策力度推动；三是经济数据的好转以及市场情绪和信心的提振也需要政策和时间，持续低迷的地产和消费、信贷数据，对下半年出口回落的担忧都使市场对经济前景的信心不足。展望下半年，美联储的降息概率逐渐增加，汇率压力有望缓解，货币政策也有了一定的空间，内部稳经济稳增长的政策有望持续加码。

尽管未来仍然存在一定的扰动因素，但 A 股经过 2-3 年较为充分的风险释放，估值已回归到非常有吸引力的水平，不必过于悲观。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”部分未在本托管人复核范围内）、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：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	13,291,968.35	1,201,902.44
结算备付金		27,963,273.03	25,371,050.04
存出保证金		29,207,180.55	20,052,662.87

交易性金融资产	6.4.7.2	267,218,077.18	189,457,890.51
其中：股票投资		247,467,676.64	174,518,368.86
基金投资		-	-
债券投资		19,750,400.54	14,939,521.65
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	-	6,099,274.85
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		-	277,877.55
应收股利		-	-
应收申购款		47,706,325.07	51,287.20
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		385,386,824.18	242,511,945.46
负债和净资产	附注号	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023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		12,547,103.96	-
应付赎回款		821,518.71	273,567.85
应付管理人报酬		237,131.52	205,116.73
应付托管费		47,426.31	41,023.33
应付销售服务费		63,772.80	65,135.06
应付投资顾问费		-	-
应交税费		9.53	131,568.19
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	787,892.83	866,647.61
负债合计		14,504,855.66	1,583,058.77
净 资 产：			
实收基金	6.4.7.7	320,567,933.47	218,480,800.12
未分配利润	6.4.7.8	50,314,035.05	22,448,086.57
净资产合计		370,881,968.52	240,928,886.69
负债和净资产总计		385,386,824.18	242,511,945.46

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额总额 320,567,933.47 份，其中华宝量化对冲混合 A 基金份额总额 77,197,209.93 份，基金份额净值 1.1733 元；华宝量化对冲混合 C 基金份额总额 155,451,556.91 份，基金份额净值 1.1397 元；华宝量化对冲混合 D 基金份额总额 87,919,166.63 份，基金份额净值 1.1732 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：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
一、营业总收入		12,620,360.12	5,407,266.14
1. 利息收入		600,670.74	246,347.48
其中：存款利息收入	6.4.7.9	321,369.28	230,936.57
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		279,301.46	15,410.91
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		11,881,509.27	709,020.28
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-2,352,182.94	3,544,832.13
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	166,298.42	40,028.90
资产支持证券投资	6.4.7.12	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	11,353,566.23	-4,866,690.92
股利收益	6.4.7.15	2,713,827.56	1,990,850.17
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-23,360.21	4,331,424.88
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	161,540.32	120,473.50
减：二、营业总支出		2,194,702.25	1,858,527.53
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,355,706.45	1,148,239.31
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	271,141.27	229,647.87

3. 销售服务费	6.4.10.2.3	408,441.67	372,199.74
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	6.4.7.18	-	-
7. 税金及附加		49,844.56	-
8. 其他费用	6.4.7.19	109,568.30	108,440.61
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		10,425,657.87	3,548,738.61
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		10,425,657.87	3,548,738.61
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		10,425,657.87	3,548,738.61

6.3 净资产变动表

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：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	218,480,800.12	-	22,448,086.57	240,928,886.69
二、本期期初净资产	218,480,800.12	-	22,448,086.57	240,928,886.69
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	102,087,133.35	-	27,865,948.48	129,953,081.83
（一）、综合收益总额	-	-	10,425,657.87	10,425,657.87
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	102,087,133.35	-	17,440,290.61	119,527,423.96
其中：1. 基金申购款	196,305,472.96	-	29,976,327.08	226,281,800.04
2. 基金赎回款	-94,218,339.61	-	-12,536,036.47	-106,754,376.08
（三）、本期向基金份额持有人分	-	-	-	-

配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）				
四、本期期末净资产	320,567,933.47	-	50,314,035.05	370,881,968.52
项目	上年度可比期间 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	238,482,917.67	-	18,775,883.68	257,258,801.35
二、本期期初净资产	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净资产变动数（净资产减少以“-”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净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
四、本期期末净资产	191,612,518.14	-	18,249,110.23	209,861,628.37

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

向辉

张幸骏

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

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 2024 年 8 月 30 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 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及 2024 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。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(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 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
活期存款	13,291,968.35
等于：本金	13,290,497.09
加：应计利息	1,471.26
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	13,291,968.35

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	254,691,080.85	-	247,467,676.64	-7,223,404.21	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	19,499,937.00	220,400.54	19,750,400.54	30,063.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	19,499,937.00	220,400.54	19,750,400.54	30,063.00
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	274,191,017.85	220,400.54	267,218,077.18	-7,193,341.21	

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 2024 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	-248,329,940.00	-	-	-
其中：股指期货投资	-248,329,940.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-248,329,940.00	-	-	-

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
IC2407	IC2407	-40.00	-39,340,800.00	2,012,760.00
IC2409	IC2409	-38.00	-37,051,520.00	2,860,800.00
IF2407	IF2407	-52.00	-53,617,200.00	883,140.00
IF2408	IF2408	-10.00	-10,282,200.00	-18,060.00
IF2409	IF2409	-100.00	-102,708,000.00	-408,420.00
合计				5,330,220.00
减：可抵销期货暂收款				5,330,220.00
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

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

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 2024年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1,044.39
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	702,313.08
其中：交易所市场	702,313.08
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	84,535.36
合计	787,892.83

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 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	44,038,623.62	44,038,623.62
本期申购	55,121,962.90	55,121,962.90
本期赎回（以“-”号填列）	-21,963,376.59	-21,963,376.59
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	77,197,209.93	77,197,209.93

华宝量化对冲混合 C

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	174,442,176.50	174,442,176.50
本期申购	53,264,343.43	53,264,343.43
本期赎回（以“-”号填列）	-72,254,963.02	-72,254,963.02
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	155,451,556.91	155,451,556.91

华宝量化对冲混合 D

项目	本期 2024 年 4 月 26 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	-	-
本期申购	87,919,166.63	87,919,166.63
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
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	87,919,166.63	87,919,166.63

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 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	10,307,890.97	-4,723,894.07	5,583,996.90
本期期初	10,307,890.97	-4,723,894.07	5,583,996.90
本期利润	2,530,673.70	-156,922.64	2,373,751.06
本期基金份额交易产生的变动数	8,825,198.06	-3,404,839.88	5,420,358.18
其中：基金申购款	14,538,972.38	-5,716,036.91	8,822,935.47
基金赎回款	-5,713,774.32	2,311,197.03	-3,402,577.29
本期已分配利润	-	-	-
本期末	21,663,762.73	-8,285,656.59	13,378,106.14

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	35,415,811.76	-18,551,722.09	16,864,089.67
本期期初	35,415,811.76	-18,551,722.09	16,864,089.67
本期利润	7,717,561.80	-7,224.94	7,710,336.86
本期基金份额交易产生的变动数	-4,881,811.48	2,017,950.75	-2,863,860.73
其中：基金申购款	11,729,683.74	-5,460,085.29	6,269,598.45
基金赎回款	-16,611,495.22	7,478,036.04	-9,133,459.18
本期已分配利润	-	-	-
本期末	38,251,562.08	-16,540,996.28	21,710,565.80

华宝量化对冲混合 D

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-

本期期初	-	-	-
本期利润	200,782.58	140,787.37	341,569.95
本期基金份额交易产生的变动数	24,461,818.04	-9,578,024.88	14,883,793.16
其中：基金申购款	24,461,818.04	-9,578,024.88	14,883,793.16
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	24,662,600.62	-9,437,237.51	15,225,363.11

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
活期存款利息收入	8,660.36	
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	312,308.09	
其他	400.83	
合计	321,369.28	

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
卖出股票成交总额	351,584,496.90	
减：卖出股票成本总额	352,980,425.52	
减：交易费用	956,254.32	
买卖股票差价收入	-2,352,182.94	

6.4.7.10.3 股票投资收益——证券出借差价收入

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
债券投资收益——利息收入	154,029.74	
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	12,268.68	
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	166,298.42
----	------------

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	13,879,521.86
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	13,616,529.62
减：应计利息总额	250,374.79
减：交易费用	348.77
买卖债券差价收入	12,268.68

6.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

6.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

6.4.7.12.1 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 贵金属投资收益

6.4.7.13.1 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 衍生工具收益

6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
股指期货投资收益	11,353,566.23

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	2,713,827.56
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	2,713,827.56

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	393,299.79
股票投资	371,906.79
债券投资	21,393.00
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-416,660.00
权证投资	-
期货投资	-416,660.00
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	-23,360.21

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	151,227.68
基金转换费收入	10,312.64
合计	161,540.32

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。

6.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
审计费用	24,863.02
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行费用	6,432.94
账户维护费	18,000.00
上清所 CFCA 证书服务费	600.00

合计	109,568.30
----	------------

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 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023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	25,585,687.71	3.30	693,647.13	0.07

6.4.10.1.2 债券交易

6.4.10.1.3 债券回购交易

6.4.10.1.4 权证交易

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024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	23,945.46	3.28	23,945.46	3.41
关联方名称	上年度可比期间 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

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 2024年1月1日至2024年6月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,355,706.45	1,148,239.31
其中：应支付销售机构的客户维护费	529,728.02	530,172.54
应支付基金管理人的净管理费	825,978.43	618,066.77

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 2024年1月1日至2024年6月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	271,141.27	229,647.87

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	华宝量化对冲混 合 D	合计
华宝基金	-	11,022.10	61.23	11,083.33
华宝证券	-	842.36	1.64	844.00
中国银行	-	92,934.47	-	92,934.47
合计	-	104,798.93	62.87	104,861.80
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 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	华宝量化对冲混 合 D	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

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，D 类基金份额的销售服务费按前一日 D 类基金份额的基金资产净值的 0.2% 年费率计提。本基金各类基金份额销售服务费计提的计算方法如下：

C 类基金份额： $H = E \times 0.4\% \div \text{当年天数}$

D 类基金份额： $H = E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$

H 为各类基金份额每日应计提的基金销售服务费，E 为各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

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。

6.4.10.5 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固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固有资金投资本基金。

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 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023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	13,291,968.35	8,660.36	1,985,458.15	5,745.39

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（2024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
001379	腾	2024	6个月	新股	16.98	13.48	186	3,158.28	2,507.28	-

	达科技	年1月11日		锁定						
001389	广合科技	2024年3月26日	6个月	新股锁定	17.43	34.56	222	3,869.46	7,672.32	-
301392	汇成真空	2024年5月28日	6个月	新股锁定	12.20	41.66	219	2,671.80	9,123.54	-
301502	华阳智能	2024年1月26日	6个月	新股锁定	28.01	37.83	138	3,865.38	5,220.54	-
301539	宏鑫科技	2024年4月3日	6个月	新股锁定	10.64	19.82	361	3,841.04	7,155.02	-
301565	中仑新材	2024年6月13日	6个月	新股锁定	11.88	18.98	634	7,531.92	12,033.32	-
301566	达利凯普	2023年12月22日	6个月	新股锁定	8.90	16.97	576	5,126.40	9,774.72	-
301580	爱迪特	2024年6月19日	6个月	新股锁定	44.95	65.93	167	7,506.65	11,010.31	-
301587	中瑞股份	2024年3月27日	6个月	新股锁定	21.73	25.26	306	6,649.38	7,729.56	-
301589	诺瓦星云	2024年2月1日	6个月	新股锁定	126.89	188.01	335	42,508.15	62,983.35	-
301589	诺瓦星云	2024年5月30日	2个月	新股锁定-送股	-	188.01	268	-	50,386.68	-
603082	北自	2024年1月	6个月	新股锁定	21.28	29.49	104	2,213.12	3,066.96	-

	科技	23 日								
603285	键邦股份	2024 年 6 月 28 日	6 个月	新股锁定	18.65	18.65	129	2,405.85	2,405.85	-
603285	键邦股份	2024 年 6 月 28 日	1 个月内(含)	新股流通受限	18.65	18.65	1,158	21,596.70	21,596.70	-
603312	西典新能	2024 年 1 月 4 日	6 个月	新股锁定	29.02	25.36	91	2,640.82	2,307.76	-
603325	博隆技术	2024 年 1 月 3 日	6 个月	新股锁定	72.46	68.06	39	2,825.94	2,654.34	-
603341	龙旗科技	2024 年 2 月 23 日	6 个月	新股锁定	26.00	37.49	130	3,380.00	4,873.70	-
603350	安乃达	2024 年 6 月 26 日	1 个月内(含)	新股流通受限	20.56	20.56	945	19,429.20	19,429.20	-
603350	安乃达	2024 年 6 月 26 日	6 个月	新股锁定	20.56	20.56	106	2,179.36	2,179.36	-
603381	永臻股份	2024 年 6 月 19 日	6 个月	新股锁定	23.35	25.13	113	2,638.55	2,839.69	-
688530	欧莱新材	2024 年 4 月 29 日	6 个月	新股锁定	9.60	16.10	344	3,302.40	5,538.40	-
688584	上海合晶	2024 年 2 月 1 日	6 个月	新股锁定	22.66	15.89	386	8,746.76	6,133.54	-
688691	灿芯股份	2024 年 4 月 2 日	6 个月	新股锁定	19.86	42.51	247	4,905.42	10,499.97	-

688692	达梦数据	2024年6月4日	6个月	新股锁定	86.96	174.93	98	8,522.08	17,143.14	-
688695	中创股份	2024年3月6日	6个月	新股锁定	22.43	31.55	186	4,171.98	5,868.30	-
688709	成都华微	2024年1月31日	6个月	新股锁定	15.69	18.79	460	7,217.40	8,643.40	-

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

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

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在经营管理和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

均存放于大型股份制商业银行，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净资产的比例较低（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约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、流通受限制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票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票，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货币资金、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 2024 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	13,291,968.35	-	-	-	13,291,968.35
结算备付金	27,963,273.03	-	-	-	27,963,273.03
存出保证金	47,214.15	-	-	29,159,966.40	29,207,180.55
交易性金融资产	19,750,400.54	-	-	247,467,676.64	267,218,077.18
应收申购款	-	-	-	47,706,325.07	47,706,325.07
资产总计	61,052,856.07	-	-	324,333,968.11	385,386,824.18
负债					
应付赎回款	-	-	-	821,518.71	821,518.71
应付管理人报酬	-	-	-	237,131.52	237,131.52
应付托管费	-	-	-	47,426.31	47,426.31
应付清算款	-	-	-	12,547,103.96	12,547,103.96
应付销售服务费	-	-	-	63,772.80	63,772.80
应交税费	-	-	-	9.53	9.53
其他负债	-	-	-	787,892.83	787,892.83
负债总计	-	-	-	14,504,855.66	14,504,855.66
利率敏感度缺口	61,052,856.07	-	-	309,829,112.45	370,881,968.52
上年度末 2023 年 12 月 31 日					
资产					
货币资金	1,201,902.44	-	-	-	1,201,902.44
结算备付金	25,371,050.04	-	-	-	25,371,050.04
存出保证金	42,641.27	-	-	20,010,021.60	20,052,662.87
交易性金融资产	14,939,521.65	-	-	174,518,368.86	189,457,890.51
买入返售金融资产	6,099,274.85	-	-	-	6,099,274.85
应收申购款	-	-	-	51,287.20	51,287.20
应收清算款	-	-	-	277,877.55	277,877.55
资产总计	47,654,390.25	-	-	194,857,555.21	242,511,945.46
负债					
应付赎回款	-	-	-	273,567.85	273,567.85
应付管理人报酬	-	-	-	205,116.73	205,116.73
应付托管费	-	-	-	41,023.33	41,023.33
应付销售服务费	-	-	-	65,135.06	65,135.06
应交税费	-	-	-	131,568.19	131,568.19
其他负债	-	-	-	866,647.61	866,647.61
负债总计	-	-	-	1,583,058.77	1,583,058.77
利率敏感度缺口	47,654,390.25	-	-	193,274,496.44	240,928,886.69

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 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 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	247,467,676.64	66.72	174,518,368.86	72.44

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	247,467,676.64	66.72	174,518,368.86	72.44

注：其他包含在期货交易所交易的期货投资。在当日无负债结算制度下，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。

6.4.13.4.3.2 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（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）
	1. 业绩比较基准上升 5%	162,890.86	89,139.70
	2. 业绩比较基准下降 5%	-162,890.86	-89,139.70

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

假设	-		
	-		
	-		
分析	风险价值 (单位：人民币元)	本期末（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）
	合计	-	0.00

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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	247,166,899.69	173,690,645.27
第二层次	19,796,011.65	14,939,521.65
第三层次	255,165.84	827,723.59
合计	267,218,077.18	189,457,890.51

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	247,467,676.64	64.21
	其中：股票	247,467,676.64	64.21
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	19,750,400.54	5.12
	其中：债券	19,750,400.54	5.12

	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	41,255,241.38	10.70
8	其他各项资产	76,913,505.62	19.96
9	合计	385,386,824.18	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	960,338.00	0.26
B	采矿业	12,914,653.00	3.48
C	制造业	143,470,866.30	38.68
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	9,549,133.00	2.57
E	建筑业	5,130,828.80	1.38
F	批发和零售业	6,299,317.00	1.70
G	交通运输、仓储和邮政业	8,816,148.80	2.38
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,272,567.55	2.23
J	金融业	42,407,777.10	11.43
K	房地产业	3,535,803.00	0.95
L	租赁和商务服务业	2,087,008.00	0.56
M	科学研究和技术服务业	717,608.09	0.19
N	水利、环境和公共设施管理业	593,517.00	0.16
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	569,664.00	0.15
R	文化、体育和娱乐业	2,142,447.00	0.58
S	综合	-	-
	合计	247,467,676.64	66.72

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	5,804	8,516,731.56	2.30
2	601318	中国平安	140,100	5,794,536.00	1.56
3	300750	宁德时代	29,560	5,321,686.80	1.43
4	000333	美的集团	59,298	3,824,721.00	1.03
5	600036	招商银行	109,400	3,740,386.00	1.01
6	601899	紫金矿业	181,600	3,190,712.00	0.86
7	002475	立讯精密	77,400	3,042,594.00	0.82
8	601398	工商银行	483,500	2,755,950.00	0.74
9	600887	伊利股份	105,300	2,720,952.00	0.73
10	000858	五粮液	21,200	2,714,448.00	0.73
11	600048	保利发展	295,900	2,592,084.00	0.70
12	601166	兴业银行	145,500	2,563,710.00	0.69
13	000651	格力电器	64,900	2,545,378.00	0.69
14	300760	迈瑞医疗	7,900	2,298,189.00	0.62
15	002415	海康威视	71,600	2,213,156.00	0.60
16	000725	京东方 A	530,500	2,169,745.00	0.59
17	601668	中国建筑	385,380	2,046,367.80	0.55
18	601919	中远海控	129,500	2,005,955.00	0.54
19	600030	中信证券	107,600	1,961,548.00	0.53
20	600900	长江电力	66,700	1,928,964.00	0.52
21	600919	江苏银行	257,300	1,911,739.00	0.52
22	600926	杭州银行	146,000	1,905,300.00	0.51
23	600050	中国联通	395,200	1,857,440.00	0.50
24	601328	交通银行	246,700	1,842,849.00	0.50
25	600028	中国石化	277,900	1,756,328.00	0.47
26	002001	新和成	88,500	1,699,200.00	0.46
27	601138	工业富联	61,000	1,671,400.00	0.45
28	600018	上港集团	284,000	1,641,520.00	0.44
29	002311	海大集团	34,700	1,632,635.00	0.44
30	600809	山西汾酒	7,600	1,602,688.00	0.43
31	600219	南山铝业	414,400	1,578,864.00	0.43
32	601838	成都银行	103,600	1,573,684.00	0.42
33	600660	福耀玻璃	32,200	1,542,380.00	0.42
34	002594	比亚迪	6,100	1,526,525.00	0.41
35	601211	国泰君安	112,200	1,520,310.00	0.41
36	000977	浪潮信息	41,500	1,509,355.00	0.41
37	600999	招商证券	107,000	1,488,370.00	0.40

38	601088	中国神华	33,300	1,477,521.00	0.40
39	601688	华泰证券	118,900	1,473,171.00	0.40
40	000425	徐工机械	205,400	1,468,610.00	0.40
41	002938	鹏鼎控股	35,400	1,407,504.00	0.38
42	300783	三只松鼠	64,000	1,399,680.00	0.38
43	688036	传音控股	18,132	1,387,823.28	0.37
44	300628	亿联网络	37,600	1,382,552.00	0.37
45	002179	中航光电	34,840	1,325,662.00	0.36
46	601006	大秦铁路	182,100	1,303,836.00	0.35
47	601857	中国石油	122,900	1,268,328.00	0.34
48	600741	华域汽车	77,000	1,261,260.00	0.34
49	300251	光线传媒	149,500	1,257,295.00	0.34
50	601288	农业银行	282,000	1,229,520.00	0.33
51	600332	白云山	41,300	1,211,329.00	0.33
52	600089	特变电工	87,300	1,210,851.00	0.33
53	601169	北京银行	202,700	1,183,768.00	0.32
54	601615	明阳智能	122,500	1,156,400.00	0.31
55	300408	三环集团	39,600	1,155,924.00	0.31
56	000001	平安银行	111,200	1,128,680.00	0.30
57	000807	云铝股份	81,700	1,103,767.00	0.30
58	601000	唐山港	231,300	1,087,110.00	0.29
59	601939	建设银行	146,700	1,085,580.00	0.29
60	000568	泸州老窖	7,500	1,076,175.00	0.29
61	000063	中兴通讯	38,100	1,065,657.00	0.29
62	300316	晶盛机电	35,700	1,025,661.00	0.28
63	600023	浙能电力	143,900	1,023,129.00	0.28
64	600183	生益科技	48,400	1,019,304.00	0.27
65	688008	澜起科技	17,411	995,212.76	0.27
66	601225	陕西煤业	38,600	994,722.00	0.27
67	000338	潍柴动力	60,700	985,768.00	0.27
68	600027	华电国际	140,500	975,070.00	0.26
69	002555	三七互娱	74,500	972,225.00	0.26
70	600674	川投能源	51,700	969,375.00	0.26
71	601390	中国中铁	144,600	942,792.00	0.25
72	000661	长春高新	10,200	936,054.00	0.25
73	300450	先导智能	56,100	932,943.00	0.25
74	601898	中煤能源	73,400	916,032.00	0.25
75	600690	海尔智家	31,800	902,484.00	0.24
76	003816	中国广核	194,700	901,461.00	0.24
77	600276	恒瑞医药	21,700	834,582.00	0.23
78	600941	中国移动	7,600	817,000.00	0.22
79	002648	卫星化学	45,400	816,292.00	0.22
80	600096	云天化	41,400	803,988.00	0.22

81	300059	东方财富	75,500	797,280.00	0.21
82	603369	今世缘	17,100	790,020.00	0.21
83	600989	宝丰能源	44,900	778,117.00	0.21
84	600104	上汽集团	55,600	770,616.00	0.21
85	600309	万华化学	9,500	768,170.00	0.21
86	002371	北方华创	2,400	767,736.00	0.21
87	603986	兆易创新	8,000	764,960.00	0.21
88	601633	长城汽车	30,000	759,000.00	0.20
89	300383	光环新网	89,500	756,275.00	0.20
90	000963	华东医药	26,900	748,089.00	0.20
91	601766	中国中车	99,000	743,490.00	0.20
92	688029	南微医学	11,921	733,856.76	0.20
93	000776	广发证券	59,900	728,983.00	0.20
94	600585	海螺水泥	30,900	728,931.00	0.20
95	002920	德赛西威	8,300	722,847.00	0.19
96	603259	药明康德	18,311	717,608.09	0.19
97	601975	招商南油	199,600	716,564.00	0.19
98	001979	招商蛇口	81,300	714,627.00	0.19
99	601916	浙商银行	258,700	714,012.00	0.19
100	600803	新奥股份	34,100	709,280.00	0.19
101	000938	紫光股份	31,500	704,025.00	0.19
102	601319	中国人保	136,200	701,430.00	0.19
103	300724	捷佳伟创	12,900	696,729.00	0.19
104	000999	华润三九	16,320	694,905.60	0.19
105	300401	花园生物	46,800	671,112.00	0.18
106	000786	北新建材	22,500	667,350.00	0.18
107	601881	中国银河	61,100	663,546.00	0.18
108	600966	博汇纸业	136,700	653,426.00	0.18
109	002299	圣农发展	47,600	649,264.00	0.18
110	600760	中航沈飞	16,000	641,600.00	0.17
111	002236	大华股份	41,500	641,590.00	0.17
112	600141	兴发集团	32,900	627,732.00	0.17
113	601985	中国核电	58,800	626,808.00	0.17
114	300677	英科医疗	23,200	621,992.00	0.17
115	000932	华菱钢铁	139,800	619,314.00	0.17
116	603290	斯达半导	7,180	618,269.80	0.17
117	002027	分众传媒	100,900	611,454.00	0.16
118	002049	紫光国微	11,500	604,900.00	0.16
119	002697	红旗连锁	130,600	604,678.00	0.16
120	000528	柳工	53,400	597,546.00	0.16
121	002139	拓邦股份	55,200	586,224.00	0.16
122	603236	移远通信	12,400	579,452.00	0.16
123	601717	郑煤机	39,100	578,680.00	0.16

124	000933	神火股份	28,600	578,578.00	0.16
125	000960	锡业股份	37,300	577,777.00	0.16
126	000703	恒逸石化	81,200	575,708.00	0.16
127	300015	爱尔眼科	55,200	569,664.00	0.15
128	600406	国电南瑞	22,800	569,088.00	0.15
129	000733	振华科技	13,700	568,961.00	0.15
130	600511	国药股份	18,400	566,536.00	0.15
131	601877	正泰电器	29,700	566,082.00	0.15
132	002444	巨星科技	22,800	563,160.00	0.15
133	002273	水晶光电	32,900	558,642.00	0.15
134	000758	中色股份	109,800	557,784.00	0.15
135	600372	中航机载	46,500	556,605.00	0.15
136	603501	韦尔股份	5,600	556,472.00	0.15
137	600011	华能国际	57,300	551,226.00	0.15
138	601800	中国交建	61,600	550,704.00	0.15
139	601933	永辉超市	220,500	546,840.00	0.15
140	600420	国药现代	51,000	544,680.00	0.15
141	000708	中信特钢	39,900	541,443.00	0.15
142	688408	中信博	5,834	537,194.72	0.14
143	601600	中国铝业	69,200	527,996.00	0.14
144	600312	平高电气	27,100	527,095.00	0.14
145	601872	招商轮船	62,200	525,590.00	0.14
146	600916	中国黄金	53,800	517,556.00	0.14
147	002266	浙富控股	184,700	515,313.00	0.14
148	002701	奥瑞金	123,000	511,680.00	0.14
149	300953	震裕科技	9,300	504,060.00	0.14
150	300002	神州泰岳	61,900	502,628.00	0.14
151	000785	居然之家	206,600	502,038.00	0.14
152	688389	普门科技	30,546	496,677.96	0.13
153	002916	深南电路	4,600	486,542.00	0.13
154	002991	甘源食品	8,000	485,200.00	0.13
155	600938	中国海油	14,700	485,100.00	0.13
156	300638	广和通	28,300	483,930.00	0.13
157	600570	恒生电子	27,400	483,884.00	0.13
158	300014	亿纬锂能	11,900	475,048.00	0.13
159	002550	千红制药	87,600	472,164.00	0.13
160	300124	汇川技术	9,200	471,960.00	0.13
161	002532	天山铝业	58,000	470,380.00	0.13
162	601888	中国中免	7,500	468,675.00	0.13
163	601229	上海银行	63,700	462,462.00	0.12
164	688100	威胜信息	12,094	461,386.10	0.12
165	600031	三一重工	27,500	453,750.00	0.12
166	300119	瑞普生物	32,500	442,650.00	0.12

167	605111	新洁能	14,340	438,660.60	0.12
168	601658	邮储银行	82,800	419,796.00	0.11
169	600066	宇通客车	15,900	410,220.00	0.11
170	603993	洛阳钼业	47,800	406,300.00	0.11
171	600863	内蒙华电	85,400	396,256.00	0.11
172	300855	图南股份	14,900	393,956.00	0.11
173	000027	深圳能源	53,400	389,820.00	0.11
174	600132	重庆啤酒	6,400	388,480.00	0.10
175	300841	康华生物	7,600	384,864.00	0.10
176	601868	中国能建	181,300	384,356.00	0.10
177	601665	齐鲁银行	77,800	381,998.00	0.10
178	601128	常熟银行	50,030	378,727.10	0.10
179	603899	晨光股份	12,100	378,488.00	0.10
180	600438	通威股份	19,800	378,378.00	0.10
181	300207	欣旺达	24,900	377,733.00	0.10
182	002126	银轮股份	21,600	376,056.00	0.10
183	002745	木林森	46,400	373,984.00	0.10
184	002423	中粮资本	49,700	372,253.00	0.10
185	601311	骆驼股份	45,700	366,514.00	0.10
186	688599	天合光能	21,652	366,351.84	0.10
187	600737	中粮糖业	38,100	365,379.00	0.10
188	000563	陕国投 A	132,500	364,375.00	0.10
188	603160	汇顶科技	5,300	364,375.00	0.10
189	300999	金龙鱼	13,300	363,755.00	0.10
190	000927	中国铁物	151,800	361,284.00	0.10
191	001965	招商公路	30,400	360,544.00	0.10
192	603766	隆鑫通用	53,000	359,340.00	0.10
193	600711	盛屯矿业	96,900	355,623.00	0.10
194	002215	诺普信	47,600	354,620.00	0.10
195	000709	河钢股份	181,000	351,140.00	0.09
196	000848	承德露露	44,600	350,556.00	0.09
197	002847	盐津铺子	8,180	349,858.60	0.09
198	300390	天华新能	20,100	345,318.00	0.09
199	601678	滨化股份	99,200	345,216.00	0.09
200	600315	上海家化	19,400	344,932.00	0.09
201	002534	西子洁能	34,400	344,344.00	0.09
202	600750	江中药业	14,900	344,339.00	0.09
203	002206	海利得	90,100	344,182.00	0.09
204	688016	心脉医疗	3,462	339,449.10	0.09
205	603567	珍宝岛	31,400	330,642.00	0.09
206	002138	顺络电子	12,000	329,520.00	0.09
207	002204	大连重工	77,100	329,217.00	0.09
208	002390	信邦制药	98,000	324,380.00	0.09

209	601969	海南矿业	51,000	323,340.00	0.09
210	002984	森麒麟	13,400	322,806.00	0.09
211	601100	恒立液压	6,900	321,402.00	0.09
212	002191	劲嘉股份	89,000	321,290.00	0.09
213	601618	中国中冶	103,300	320,230.00	0.09
214	002601	龙佰集团	16,900	313,833.00	0.08
215	000921	海信家电	9,600	309,504.00	0.08
216	601012	隆基绿能	21,880	306,757.60	0.08
217	000795	英洛华	50,400	279,216.00	0.08
218	003006	百亚股份	11,700	277,290.00	0.07
219	603806	福斯特	18,820	276,654.00	0.07
220	300957	贝泰妮	5,700	275,424.00	0.07
221	002558	巨人网络	29,100	274,704.00	0.07
222	600886	国投电力	15,000	273,600.00	0.07
223	002736	国信证券	31,300	271,997.00	0.07
224	603658	安图生物	5,900	271,813.00	0.07
225	603025	大豪科技	19,200	265,344.00	0.07
226	300685	艾德生物	15,000	264,600.00	0.07
227	000650	仁和药业	44,600	263,140.00	0.07
228	002020	京新药业	24,500	256,515.00	0.07
229	601865	福莱特	12,500	251,250.00	0.07
230	000915	华特达因	8,300	250,328.00	0.07
231	002004	华邦健康	65,700	249,660.00	0.07
232	601001	晋控煤业	15,000	247,800.00	0.07
233	688169	石头科技	629	246,945.40	0.07
234	002595	豪迈科技	6,400	244,288.00	0.07
235	002557	洽洽食品	8,600	242,434.00	0.07
236	002304	洋河股份	3,000	242,220.00	0.07
237	300529	健帆生物	8,900	242,169.00	0.07
238	002318	久立特材	10,200	237,966.00	0.06
239	300308	中际旭创	1,720	237,153.60	0.06
240	300470	中密控股	6,700	226,527.00	0.06
241	601816	京沪高铁	42,100	226,077.00	0.06
242	000400	许继电气	6,500	223,665.00	0.06
243	300458	全志科技	9,400	220,994.00	0.06
244	601628	中国人寿	7,100	220,455.00	0.06
245	002978	安宁股份	7,700	214,522.00	0.06
246	600216	浙江医药	19,500	214,110.00	0.06
247	601126	四方股份	11,100	213,342.00	0.06
248	603328	依顿电子	26,600	209,076.00	0.06
249	002409	雅克科技	3,300	207,603.00	0.06
250	002768	国恩股份	11,100	207,570.00	0.06
251	600575	淮河能源	52,400	203,836.00	0.05

252	300457	赢合科技	11,400	203,262.00	0.05
253	601567	三星医疗	5,700	199,500.00	0.05
254	000883	湖北能源	32,800	197,128.00	0.05
255	600642	申能股份	22,100	195,143.00	0.05
256	688050	爱博医疗	2,656	194,737.92	0.05
257	002583	海能达	47,100	191,697.00	0.05
258	600176	中国巨石	17,000	187,850.00	0.05
259	002472	双环传动	8,500	187,170.00	0.05
260	002245	蔚蓝锂芯	24,100	186,775.00	0.05
261	600710	苏美达	22,900	186,635.00	0.05
262	600486	扬农化工	3,300	186,285.00	0.05
263	002053	云南能投	15,400	186,186.00	0.05
264	600874	创业环保	33,200	185,588.00	0.05
265	000727	冠捷科技	89,700	184,782.00	0.05
266	300253	卫宁健康	31,300	184,670.00	0.05
267	002958	青农商行	68,800	184,384.00	0.05
268	600320	振华重工	53,900	184,338.00	0.05
269	000830	鲁西化工	15,900	184,281.00	0.05
270	601058	赛轮轮胎	13,100	183,400.00	0.05
271	000990	诚志股份	24,600	183,024.00	0.05
272	603871	嘉友国际	10,320	182,560.80	0.05
273	300598	诚迈科技	6,500	182,520.00	0.05
274	000887	中鼎股份	14,900	182,376.00	0.05
275	000828	东莞控股	20,200	182,002.00	0.05
276	600210	紫江企业	34,200	181,944.00	0.05
277	600017	日照港	68,000	181,560.00	0.05
278	300079	数码视讯	44,700	181,482.00	0.05
279	002128	电投能源	8,600	181,460.00	0.05
280	300768	迪普科技	15,300	181,305.00	0.05
281	000157	中联重科	23,600	181,248.00	0.05
282	601163	三角轮胎	11,900	181,118.00	0.05
283	002851	麦格米特	7,000	180,880.00	0.05
284	000951	中国重汽	12,600	180,432.00	0.05
285	002203	海亮股份	22,600	180,348.00	0.05
286	601677	明泰铝业	15,600	180,336.00	0.05
287	002979	雷赛智能	9,900	180,180.00	0.05
288	002078	太阳纸业	12,900	179,955.00	0.05
289	600577	精达股份	45,200	179,444.00	0.05
290	600170	上海建工	83,400	179,310.00	0.05
291	000488	晨鸣纸业	51,800	179,228.00	0.05
292	603323	苏农银行	37,200	178,932.00	0.05
293	002237	恒邦股份	15,500	178,405.00	0.05
294	000630	铜陵有色	49,300	177,973.00	0.05

295	601108	财通证券	26,900	177,809.00	0.05
296	002807	江阴银行	47,100	177,567.00	0.05
297	600252	中恒集团	81,800	177,506.00	0.05
298	603348	文灿股份	6,400	177,216.00	0.05
299	002563	森马服饰	30,500	177,205.00	0.05
300	601555	东吴证券	30,000	177,000.00	0.05
301	002221	东华能源	21,500	176,515.00	0.05
302	002249	大洋电机	37,300	176,429.00	0.05
303	601528	瑞丰银行	37,300	176,056.00	0.05
304	301219	腾远钴业	4,600	175,996.00	0.05
305	603103	横店影视	12,700	175,768.00	0.05
306	002065	东华软件	38,800	175,376.00	0.05
307	000423	东阿阿胶	2,800	175,280.00	0.05
308	600586	金晶科技	30,200	175,160.00	0.05
309	002242	九阳股份	16,700	175,016.00	0.05
310	000923	河钢资源	10,100	173,922.00	0.05
310	002081	金螳螂	57,400	173,922.00	0.05
311	600761	安徽合力	8,000	173,120.00	0.05
312	688520	神州细胞	4,398	173,061.30	0.05
313	300856	科思股份	5,400	172,854.00	0.05
314	600643	爱建集团	45,800	172,666.00	0.05
315	603919	金徽酒	9,500	172,615.00	0.05
316	600284	浦东建设	32,300	172,482.00	0.05
317	000735	罗牛山	39,800	172,334.00	0.05
318	600623	华谊集团	29,800	172,244.00	0.05
319	300497	富祥药业	19,200	171,456.00	0.05
320	603187	海容冷链	14,700	171,402.00	0.05
321	600197	伊力特	9,600	170,976.00	0.05
322	300587	天铁股份	42,300	170,892.00	0.05
323	002961	瑞达期货	15,600	170,820.00	0.05
324	600073	光明肉业	31,000	170,810.00	0.05
325	300770	新媒股份	5,100	170,238.00	0.05
326	300687	赛意信息	12,200	169,824.00	0.05
327	600335	国机汽车	29,200	168,484.00	0.05
328	600872	中炬高新	7,400	167,906.00	0.05
329	002498	汉缆股份	51,000	167,790.00	0.05
330	601989	中国重工	34,000	167,620.00	0.05
331	600015	华夏银行	26,000	166,400.00	0.04
332	600158	中体产业	21,400	164,566.00	0.04
333	601886	江河集团	33,500	163,480.00	0.04
334	603517	绝味食品	10,600	163,240.00	0.04
335	600729	重庆百货	7,300	163,228.00	0.04
336	002099	海翔药业	31,900	163,009.00	0.04

337	000792	盐湖股份	9,300	162,285.00	0.04
338	600521	华海药业	9,500	161,975.00	0.04
339	002351	漫步者	12,300	161,745.00	0.04
340	603156	养元饮品	7,600	161,652.00	0.04
341	002850	科达利	2,100	160,398.00	0.04
342	600861	北京人力	9,800	159,936.00	0.04
343	002145	中核钛白	48,300	158,424.00	0.04
344	688567	孚能科技	16,433	157,756.80	0.04
345	601801	皖新传媒	22,700	157,311.00	0.04
346	600373	中文传媒	10,600	157,304.00	0.04
347	000513	丽珠集团	4,200	156,282.00	0.04
348	603368	柳药集团	8,900	155,750.00	0.04
349	002032	苏泊尔	3,100	155,310.00	0.04
350	300674	宇信科技	14,000	155,120.00	0.04
351	000069	华侨城 A	75,700	154,428.00	0.04
352	600988	赤峰黄金	9,400	153,596.00	0.04
353	300144	宋城演艺	19,100	153,373.00	0.04
354	000034	神州数码	6,700	153,363.00	0.04
355	002832	比音勒芬	6,300	152,271.00	0.04
356	600273	嘉化能源	21,200	151,368.00	0.04
357	600612	老凤祥	2,600	151,294.00	0.04
358	600150	中国船舶	3,700	150,627.00	0.04
359	601607	上海医药	7,800	149,058.00	0.04
360	600380	健康元	13,300	148,561.00	0.04
361	002056	横店东磁	11,900	148,393.00	0.04
362	300832	新产业	2,200	148,368.00	0.04
363	603055	台华新材	14,400	145,872.00	0.04
364	002517	恺英网络	15,200	145,160.00	0.04
365	300662	科锐国际	8,900	143,557.00	0.04
366	002727	一心堂	9,500	143,355.00	0.04
367	688111	金山办公	621	141,277.50	0.04
368	300498	温氏股份	7,000	138,740.00	0.04
369	600566	济川药业	4,300	136,353.00	0.04
370	601728	中国电信	22,000	135,300.00	0.04
371	300755	华致酒行	9,900	135,234.00	0.04
372	002925	盈趣科技	10,500	133,035.00	0.04
373	603267	鸿远电子	3,900	132,990.00	0.04
374	600426	华鲁恒升	4,800	127,872.00	0.03
375	000596	古井贡酒	600	126,642.00	0.03
376	600436	片仔癀	600	124,302.00	0.03
377	601966	玲珑轮胎	6,700	123,079.00	0.03
378	601901	方正证券	15,900	122,907.00	0.03
379	600572	康恩贝	27,300	122,031.00	0.03

380	002120	韵达股份	15,600	120,744.00	0.03
381	600499	科达制造	14,300	120,549.00	0.03
382	688187	时代电气	2,437	120,339.06	0.03
383	601117	中国化学	14,600	120,304.00	0.03
384	688009	中国通号	19,876	119,256.00	0.03
385	000935	四川双马	9,900	118,899.00	0.03
386	688819	天能股份	4,924	117,486.64	0.03
387	002142	宁波银行	5,300	116,918.00	0.03
388	600955	维远股份	8,100	116,721.00	0.03
389	603008	喜临门	6,700	116,111.00	0.03
390	601818	光大银行	36,000	114,120.00	0.03
391	603296	华勤技术	2,060	113,773.80	0.03
392	301589	诺瓦星云	603	113,370.03	0.03
393	300442	润泽科技	4,700	112,565.00	0.03
394	002950	奥美医疗	17,000	112,200.00	0.03
395	600201	生物股份	15,500	111,755.00	0.03
396	600588	用友网络	11,000	110,000.00	0.03
397	603228	景旺电子	3,300	104,940.00	0.03
398	000728	国元证券	17,300	104,838.00	0.03
399	300033	同花顺	1,000	103,700.00	0.03
400	000783	长江证券	21,400	103,362.00	0.03
401	600161	天坛生物	3,920	95,648.00	0.03
402	300502	新易盛	900	94,995.00	0.03
403	002463	沪电股份	2,600	94,900.00	0.03
404	600547	山东黄金	3,400	93,092.00	0.03
405	601878	浙商证券	8,600	92,192.00	0.02
406	300433	蓝思科技	5,000	91,250.00	0.02
407	300274	阳光电源	1,440	89,323.20	0.02
408	600489	中金黄金	6,000	88,800.00	0.02
409	600875	东方电气	4,800	88,560.00	0.02
410	000800	一汽解放	11,200	87,696.00	0.02
411	600745	闻泰科技	3,100	87,575.00	0.02
412	600837	海通证券	10,100	86,456.00	0.02
413	000617	中油资本	15,300	84,456.00	0.02
414	603393	新天然气	2,400	83,376.00	0.02
415	600285	羚锐制药	3,400	82,314.00	0.02
416	002241	歌尔股份	4,200	81,942.00	0.02
417	000100	TCL 科技	18,800	81,216.00	0.02
418	002028	思源电气	1,200	80,280.00	0.02
419	300394	天孚通信	900	79,578.00	0.02
420	600233	圆通速递	5,000	78,250.00	0.02
421	603568	伟明环保	3,800	78,204.00	0.02
422	000498	山东路桥	14,700	76,881.00	0.02

423	601019	山东出版	6,500	76,830.00	0.02
424	002043	兔宝宝	7,400	76,738.00	0.02
425	600795	国电电力	12,700	76,073.00	0.02
426	688188	柏楚电子	411	75,850.05	0.02
427	002007	华兰生物	4,800	75,792.00	0.02
428	601377	兴业证券	14,900	75,394.00	0.02
429	000166	申万宏源	17,400	74,994.00	0.02
430	002837	英维克	3,500	74,865.00	0.02
431	600007	中国国贸	3,400	74,664.00	0.02
432	300776	帝尔激光	1,600	73,536.00	0.02
433	002705	新宝股份	5,200	73,164.00	0.02
434	603297	永新光学	1,200	72,588.00	0.02
435	601636	旗滨集团	11,000	70,950.00	0.02
436	603699	纽威股份	4,100	70,192.00	0.02
437	688065	凯赛生物	1,544	70,082.16	0.02
438	600346	恒力石化	4,800	66,960.00	0.02
439	600025	华能水电	6,200	66,836.00	0.02
440	600016	民生银行	17,100	64,809.00	0.02
441	600362	江西铜业	2,700	63,936.00	0.02
442	600460	士兰微	3,600	63,036.00	0.02
443	002252	上海莱士	8,000	62,560.00	0.02
444	603486	科沃斯	1,300	61,334.00	0.02
445	605117	德业股份	800	59,472.00	0.02
446	603288	海天味业	1,700	58,599.00	0.02
447	300782	卓胜微	700	54,418.00	0.01
448	603198	迎驾贡酒	900	51,750.00	0.01
449	688256	寒武纪	253	50,263.51	0.01
450	300979	华利集团	800	48,680.00	0.01
451	000876	新希望	5,300	48,442.00	0.01
452	000895	双汇发展	2,000	47,540.00	0.01
453	002841	视源股份	1,600	47,248.00	0.01
454	002493	荣盛石化	4,800	46,368.00	0.01
455	000408	藏格矿业	1,900	45,733.00	0.01
456	601236	红塔证券	7,100	45,582.00	0.01
457	605499	东鹏饮料	200	43,150.00	0.01
458	603799	华友钴业	1,900	42,047.00	0.01
459	002202	金风科技	5,900	39,648.00	0.01
460	300751	迈为股份	300	35,844.00	0.01
461	300896	爱美客	180	30,978.00	0.01
462	603285	键邦股份	1,287	24,002.55	0.01
463	603195	公牛集团	290	22,364.80	0.01
464	603350	安乃达	1,051	21,608.56	0.01
465	688692	达梦数据	98	17,143.14	0.00

466	601727	上海电气	4,600	17,020.00	0.00
467	600188	兖矿能源	700	15,911.00	0.00
468	601808	中海油服	800	13,760.00	0.00
469	301565	中仑新材	634	12,033.32	0.00
470	301580	爱迪特	167	11,010.31	0.00
471	688691	灿芯股份	247	10,499.97	0.00
472	301566	达利凯普	576	9,774.72	0.00
473	301392	汇成真空	219	9,123.54	0.00
474	688709	成都华微	460	8,643.40	0.00
475	601698	中国卫通	600	8,454.00	0.00
476	688561	奇安信	334	7,889.08	0.00
477	301587	中瑞股份	306	7,729.56	0.00
478	001389	广合科技	222	7,672.32	0.00
479	600893	航发动力	200	7,310.00	0.00
480	301539	宏鑫科技	361	7,155.02	0.00
481	688584	上海合晶	386	6,133.54	0.00
482	688695	中创股份	186	5,868.30	0.00
483	688530	欧莱新材	344	5,538.40	0.00
484	301502	华阳智能	138	5,220.54	0.00
485	603341	龙旗科技	130	4,873.70	0.00
486	603082	北自科技	104	3,066.96	0.00
487	603381	永臻股份	113	2,839.69	0.00
488	603325	博隆技术	39	2,654.34	0.00
489	001379	腾达科技	186	2,507.28	0.00
490	603312	西典新能	91	2,307.76	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	600519	贵州茅台	4,851,593.00	2.01
2	601318	中国平安	4,445,814.00	1.85
3	300750	宁德时代	3,710,399.00	1.54
4	600887	伊利股份	3,273,106.77	1.36
5	600066	宇通客车	2,804,333.00	1.16
6	600048	保利发展	2,775,602.00	1.15
7	000651	格力电器	2,686,991.00	1.12
8	000333	美的集团	2,546,826.00	1.06
9	600901	江苏金租	2,449,882.00	1.02
10	601899	紫金矿业	2,215,377.00	0.92
11	600690	海尔智家	2,188,003.00	0.91
12	603993	洛阳钼业	2,132,030.00	0.88
13	000725	京东方 A	2,130,645.00	0.88

14	000858	五 粮 液	2,094,477.00	0.87
15	601919	中远海控	2,011,588.70	0.83
16	601668	中国建筑	1,999,806.00	0.83
17	600036	招商银行	1,999,759.00	0.83
18	600872	中炬高新	1,990,744.00	0.83
19	002027	分众传媒	1,972,503.00	0.82
20	601717	郑煤机	1,924,689.00	0.80

注：买入金额不包括相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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	600519	贵州茅台	4,154,692.00	1.72
2	601318	中国平安	3,487,516.00	1.45
3	600900	长江电力	3,285,033.00	1.36
4	600066	宇通客车	3,240,236.00	1.34
5	000651	格力电器	3,033,250.00	1.26
6	600901	江苏金租	2,675,886.60	1.11
7	300750	宁德时代	2,122,751.00	0.88
8	600036	招商银行	2,115,465.00	0.88
9	000338	潍柴动力	2,019,628.00	0.84
10	000333	美的集团	1,922,640.00	0.80
11	601857	中国石油	1,826,058.00	0.76
12	603993	洛阳钼业	1,817,358.00	0.75
13	601899	紫金矿业	1,803,225.00	0.75
14	000157	中联重科	1,788,956.00	0.74
15	601288	农业银行	1,774,482.00	0.74
16	601717	郑煤机	1,767,623.00	0.73
17	603338	浙江鼎力	1,764,846.00	0.73
18	600919	江苏银行	1,734,528.00	0.72
19	600690	海尔智家	1,717,400.00	0.71
20	603486	科沃斯	1,699,251.00	0.71

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	425,557,826.51
卖出股票收入（成交）总额	351,584,496.90

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	19,750,400.54	5.33
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	19,750,400.54	5.33

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	019709	23 国债 16	95,000	9,648,343.15	2.60
2	019631	20 国债 05	50,000	5,038,126.03	1.36
3	019685	22 国债 20	19,000	1,932,027.23	0.52
4	019698	23 国债 05	13,000	1,315,929.45	0.35
5	019740	24 国债 09	10,000	1,003,418.63	0.27

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 247,467,676.64 元,占基金资产净值的比例为 66.72%;运用股指期货进行对冲的空头合约市值-242,999,720.00 元,占基金资产净值的比例为-65.52%,空头合约市值占股票资产的比例为-98.19%。本报告期内,本基金执行市场中性策略的投资收益为 9,001,383.29 元,公允价值变动损益为-44,753.21 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 2024 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办理经常项目资金收付,未对交易单证的真实性及其与外汇收支的一致性进行合理审查行为、违反规定办理结汇、售汇业务行为、违反规定办理资本项目资金收付行为;于 2023 年 11 月 27 日收到国家外汇管理局深圳市分局警告,罚款,没收违法所得的处罚措施。

华宝量化对冲混合截止 2024 年 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违规经营,涉嫌违反法律法规,违反结汇、售汇及付汇管理规定;于 2023 年 11 月 27 日收到国家外汇管理局深圳市分局警告,罚款,没收违法所得的处罚措施。

华宝量化对冲混合截止 2024 年 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招商银行理财业务存在以下违法违规行为:一、未能有效穿透识别底层资产二、信息披露不规范;于 2024 年 06 月 24 日收到国家金融监督管理总局罚款的处罚措施。

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。

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	29,207,180.55
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	47,706,325.07
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	76,913,505.62

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	14,137	5,460.65	27,952,266.03	36.21	49,244,943.90	63.79
华宝量化对冲混合 C	57,230	2,716.26	49,032,210.14	31.54	106,419,346.77	68.46
华宝量化对冲混合 D	45	1,953,759.26	87,772,350.52	99.83	146,816.11	0.17
合计	71,412	4,488.99	164,756,826.69	51.40	155,811,106.78	48.60

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	161,986.02	0.2098
	华宝量化对冲混合 C	778.09	0.0005
	华宝量化对冲混合 D	145,944.23	0.1660
	合计	308,708.34	0.0963

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
	华宝量化对冲混合 D	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
	华宝量化对冲混合 D	10~50
	合计	10~50

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	3.06	不少于 3 年
基金管理人高级管理人员	117,860.68	0.04	100,000.00	0.03	不少于 3 年
基金经理等人员	-	-	100,000.00	0.03	不少于 3 年
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	117,860.68	0.04	10,000,000.00	3.12	-

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	华宝量化对冲混合 D
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	44,038,623.62	174,442,176.50	-
本报告期基金总申购份额	55,121,962.90	53,264,343.43	87,919,166.63
减：本报告期基金总赎回份额	21,963,376.59	72,254,963.02	-
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期末基金份额总额	77,197,209.93	155,451,556.91	87,919,166.63

§ 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，经中国银行股份有限公司研究决定，郭德秋先生不再担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告

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 (%)	
申万宏源	3	101,242,893.66	13.04	95,765.24	13.11	-
国信证券	1	66,565,662.03	8.58	62,964.94	8.62	-
麦高证券	1	61,704,285.98	7.95	57,749.34	7.90	-
山西证券	2	59,500,141.32	7.67	55,686.06	7.62	-
中信证券	4	59,417,858.01	7.66	55,949.80	7.66	-
方正证券	1	52,659,153.52	6.78	49,284.32	6.74	-
中金国际	2	50,734,868.94	6.54	47,482.59	6.50	-
国联证券	3	50,458,574.99	6.50	47,729.41	6.53	-
浙商证券	2	47,417,905.45	6.11	44,820.21	6.13	-
中信建投	2	41,058,230.43	5.29	38,687.98	5.29	-
国泰君安	1	40,682,389.24	5.24	38,480.66	5.27	-
长江证券	1	38,865,000.40	5.01	36,763.16	5.03	-
华宝证券	1	25,585,687.71	3.30	23,945.46	3.28	-
国海证券	2	24,962,555.95	3.22	23,474.26	3.21	-
上海证券	2	18,829,852.86	2.43	17,810.56	2.44	-
德邦证券	1	15,690,646.90	2.02	14,685.34	2.01	-
华创证券	2	9,896,531.00	1.28	9,262.15	1.27	-
华泰证券	2	5,008,427.53	0.65	4,688.19	0.64	-
国元证券	2	4,659,044.77	0.60	4,360.42	0.60	-
财通证券	3	965,526.31	0.12	903.64	0.12	-
中泰证券	1	188,844.08	0.02	178.62	0.02	-

天风证券	3	10,909.24	0.00	10.21	0.00	-
东北证券	2	6,564.48	0.00	6.20	0.00	-
招商证券	4	4,148.00	0.00	3.88	0.00	-
东吴证券	2	1,758.12	0.00	1.66	0.00	-
长城证券	2	-	-	-	-	-
诚通证券	2	-	-	-	-	-
大和证券	2	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
东方财富	2	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	2	-	-	-	-	-
东亚前海 证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	4	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
国投证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
宏信证券	2	-	-	-	-	-
华安证券	2	-	-	-	-	-
华金证券	1	-	-	-	-	-
华林证券	1	-	-	-	-	-
江海证券	2	-	-	-	-	-
开源证券	2	-	-	-	-	-
联储证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	2	-	-	-	-	-
申港证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证 券	1	-	-	-	-	-
五矿证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
英大证券	2	-	-	-	-	-
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，并能为本基金提供全面的信息服；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退租的有：国投证券、天风证券。

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 (%)
申万宏源	1,907,899.79	8.34	5,900,000.00	0.27	-	-
国信证券	-	-	47,000,000.00	2.17	-	-
麦高证券	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	6,462,591.98	28.25	145,305,000.00	6.72	-	-
方正证券	-	-	471,280,000.00	21.79	-	-
中金国际	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	4,377,681.86	19.13	229,995,000.00	10.64	-	-
中信建投	1,723,924.17	7.53	329,100,000.00	15.22	-	-
国泰君安	-	-	5,400,000.00	0.25	-	-
长江证券	-	-	51,680,000.00	2.39	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	14,000,000.00	0.65	-	-
上海证券	4,341,808.73	18.98	582,060,000.00	26.92	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	2,044,595.62	8.94	225,709,000.00	10.44	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	5,900,000.00	0.27	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	29,700,000.00	1.37	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	2,021,540.27	8.84	19,480,000.00	0.90	-	-

长城证券	-	-	-	-	-	-
诚通证券	-	-	-	-	-	-
大和证券	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
东亚前海 证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
宏信证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
华林证券	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
联储证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
申港证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证 券	-	-	-	-	-	-
五矿证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-
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	华宝基金关于旗下部分基金新增银泰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	2024-01-05
2	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	2024-01-19

3	华宝基金管理有限公司旗下部分基金年度报告提示性公告	上海证券报，证券日报， 证券时报，中国证券报	2024-03-29
4	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	2024-04-19
5	华宝量化对冲策略混合型发起式证券投资基金（D类份额）基金产品资料概要（更新）	基金管理人网站	2024-04-25
6	华宝量化对冲策略混合型发起式证券投资基金基金合同	基金管理人网站	2024-04-25
7	华宝量化对冲策略混合型发起式证券投资基金托管协议	基金管理人网站	2024-04-25
8	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	2024-04-25
9	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	2024-04-25
10	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	2024-04-25
11	关于华宝量化对冲策略混合型发起式证券投资基金暂停通过直销渠道对本基金C类份额的申购、转换转入及定期定额投资业务的公告	基金管理人网站，证券时报	2024-04-25
12	华宝基金管理有限公司关于华宝量化对冲策略混合型发起式证券投资基金增加D类基金份额并修改基金合同等法律文件的公告	基金管理人网站，证券时报	2024-04-25
13	关于华宝量化对冲策略混合型发起式证券投资基金C类份额暂停通过好买基金、同花顺申购、转换转入及定期定额投资业务的公告	基金管理人网站，证券时报	2024-05-24
14	华宝基金关于华宝量化对冲策略混合型发起式证券投资基金D类新增上海好买基金销售有限公司为代销机构的通知	基金管理人网站	2024-05-24
15	华宝基金关于华宝量化对冲策略混合型发起式证券投资基金D类新增浙江同花顺基金销售有限公司为代销机构的通知	基金管理人网站	2024-05-24
16	关于华宝量化对冲策略混合型发起式证券投资基金C类份额暂停通过和讯基金申购、转换转入及定期定额投资业务的公告	基金管理人网站，证券时报	2024-06-06
17	华宝基金关于华宝量化对冲策略混合	基金管理人网站	2024-06-06

	型发起式证券投资基金 D 类新增和讯信息科技有限公司为代销机构的通知		
18	关于华宝量化对冲策略混合型发起式证券投资基金 C 类份额暂停通过基煜基金申购、转换转入及定期定额投资业务的公告	基金管理人网站, 证券时报	2024-06-18
19	华宝基金关于华宝量化对冲策略混合型发起式证券投资基金 D 类新增上海基煜基金销售有限公司为代销机构的通知	基金管理人网站	2024-06-18
20	关于华宝量化对冲策略混合型发起式证券投资基金 C 类份额暂停通过蚂蚁基金申购、转换转入及定期定额投资业务的公告	基金管理人网站, 证券时报	2024-06-19
21	华宝基金关于华宝量化对冲策略混合型发起式证券投资基金 D 类新增蚂蚁(杭州)基金销售有限公司为代销机构的通知	基金管理人网站	2024-06-19
22	华宝基金关于旗下部分基金新增湘财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	2024-06-21
23	关于华宝量化对冲策略混合型发起式证券投资基金 C 类份额暂停通过华宝证券申购、转换转入及定期定额投资业务的公告	基金管理人网站, 证券时报	2024-06-27
24	华宝基金关于华宝量化对冲策略混合型发起式证券投资基金 D 类新增华宝证券股份有限公司为代销机构的公告	基金管理人网站, 证券时报	2024-06-27
25	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	2024-06-28
26	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	2024-06-28
27	华宝量化对冲策略混合型发起式证券投资基金(D类份额)基金产品资料概要(更新)	基金管理人网站	2024-06-28

§ 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

基金管理人于 2024 年 04 月 25 日发布华宝基金管理有限公司关于华宝量化对冲策略混合型发起式证券投资基金增加 D 类基金份额并修改基金合同等法律文件的公告，具体内容详见公司公告，请投资者予以关注。

§ 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及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

2024 年 8 月 30 日