

华宝标普沪港深中国增强价值指数证券投资
基金（LOF）
2019 年半年度报告

2019 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：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2019 年 8 月 29 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。本半年度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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 8 月 27 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 01 月 01 日起至 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	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
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.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
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.....	16
§5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	17
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.....	17
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	17
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	18
6.1 资产负债表.....	18
6.2 利润表.....	19
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	20

6.4 报表附注.....	21
§7 投资组合报告.....	42
7.1 期末基金资产组合情况.....	42
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	42
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.....	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	48
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.....	48
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.....	48
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.....	48
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.....	49
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	49
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	49
7.12 投资组合报告附注.....	49
§8 基金份额持有人信息.....	51
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	51
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	51
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	51
8.4 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的情况.....	52
§9 开放式基金份额变动.....	53
§10 重大事件揭示.....	54
10.1 基金份额持有人大会决议.....	54
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.....	54
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	54
10.4 基金投资策略的改变.....	54
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	54
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.....	54
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	54
10.8 其他重大事件.....	56
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	59

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	59
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	59
§12 备查文件目录.....	60
12.1 备查文件目录.....	60
12.2 存放地点.....	60
12.3 查阅方式.....	60

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华宝标普沪港深中国增强价值指数证券投资基金 (LOF)	
基金简称	华宝标普沪港深中国增强价值指数	
场内简称	价值基金	
基金主代码	501310	
交易代码	501310	
基金运作方式	上市契约型开放式 (LOF)	
基金合同生效日	2018 年 10 月 25 日	
基金管理人	华宝基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	122,287,653.91 份	
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所	
上市日期	2018 年 11 月 22 日	
下属分级基金的基金简称:	华宝价值基金	华宝价值基金 C
下属分级基金的交易代码:	501310	007397
报告期末下属分级基金的份额总额	122,266,608.02 份	21,045.89 份

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。正常情况下，本基金力争控制净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 5%。
投资策略	<p>本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好的跟踪标的指数，实现基金投资目标。</p> <p>1、组合复制策略 主要采取完全复制法，并根据标的指数成份股及其权重的变动对股票投资组合进行相应地调整。</p> <p>2、替代性策略 对于出现市场流动性不足、因法律法规原因个别成份股被限制投资等情况，导致本基金无法获得足够数量的股票时，基金管理人将通过投资成份股、非成份股、成份股个股衍生品等进行替代。</p> <p>3、债券投资策略 采用自上而下的投资策略，根据宏观经济分析、资金面动向分析等判断未来利率变动走势，并利用债券定价技术，进行个券选择。</p>
业绩比较基准	标普沪港深中国增强价值指数收益率×95%+人民币银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，其长期平均风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。本基金为指数型基金，具有与标的指数相似的风险收

	益特征。本基金将通过港股通投资香港证券市场，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。
--	---

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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	刘月华	田青
	联系电话	021-38505888	010-67595096
	电子邮箱	xxpl@fsfund.com	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		400-700-5588、 021-38924558	010—67595096
传真		021-38505777	010-66275853
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	北京市西城区金融大街 25 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	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		200120	100033
法定代表人		孔祥清	田国立

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》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.fsfund.com
基金半年度报告备置地点	本基金半年报置备地点包括基金管理人办公场所和基金托管人办公场所。

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司 基金管理人	北京市西城区太平桥大街 17 号 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

基金级别	华宝价值基金	华宝价值基金 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019 年 1 月 1 日 - 2019 年 6 月 30 日)	报告期(2019 年 5 月 21 日 - 2019 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	4,068,256.52	224.29
本期利润	2,529,616.09	491.13
加权平均基金份额本期利润	0.0274	0.0503
本期加权平均净值利润率	2.66%	5.05%
本期基金份额净值增长率	5.78%	2.56%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	1,201,069.56	199.29
期末可供分配基金份额利润	0.0098	0.0095
期末基金资产净值	123,467,677.58	21,245.18
期末基金份额净值	1.0098	1.0095
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	0.98%	2.56%

- 1、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。
- 2、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）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
- 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、C 类份额的实际起始日为 2019 年 5 月 21 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

华宝价值基金

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	3.53%	0.82%	2.11%	0.77%	1.42%	0.05%

过去三个月	-4.66%	1.01%	-4.36%	0.97%	-0.30%	0.04%
过去六个月	5.78%	1.09%	4.55%	1.08%	1.23%	0.01%
自基金合同生效日起至今	0.98%	1.00%	2.84%	1.04%	-1.86%	-0.04%

华宝价值基金 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	3.50%	0.82%	2.11%	0.77%	1.39%	0.05%
自基金合同生效日起至今	2.56%	0.77%	0.34%	0.75%	2.22%	0.02%

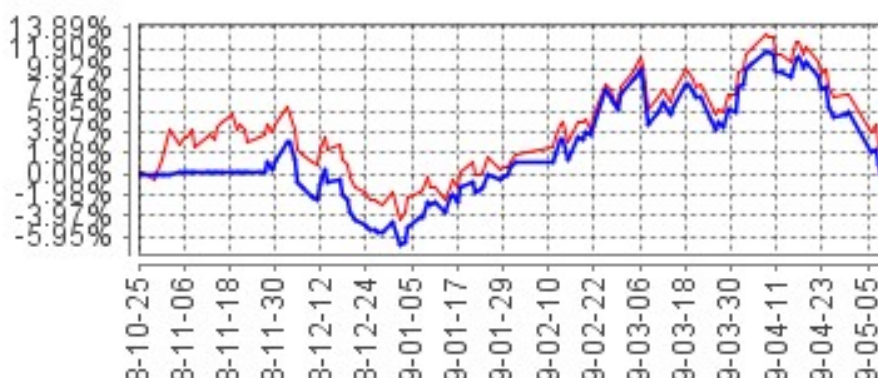
注：1、本基金基金合同生效于 2018 年 10 月 25 日，截至报告日，本基金基金合同生效未满一年。

2、截至 2019 年 4 月 24 日，本基金已达到合同规定的资产配置比例。

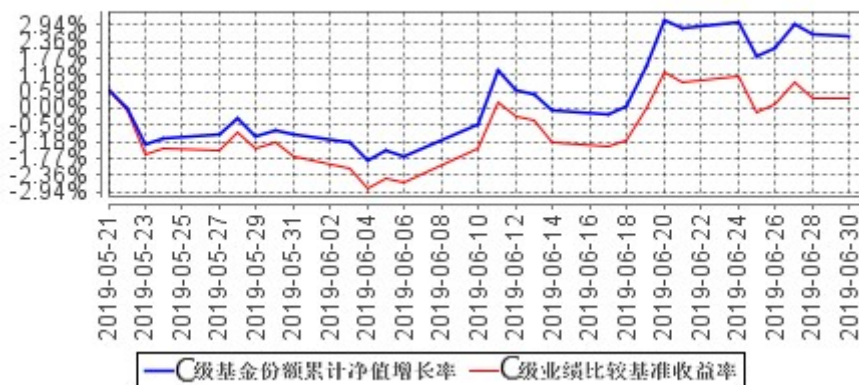
3、本基金 C 份额成立于 2019 年 5 月 21 日。

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

A级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准的历史走势对比图



C级基金份额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：1、本基金基金合同生效于 2018 年 10 月 25 日，截至报告日，本基金基金合同生效未满一年。
- 2、截至 2019 年 4 月 24 日，本基金已达到合同规定的资产配置比例。
- 3、本基金 C 份额成立于 2019 年 5 月 21 日。

§ 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

基金管理人是在 2003 年 3 月 7 日正式成立的合资基金管理公司，截至本报告期末（2019 年 6 月 30 日），正在管理运作的证券投资基金包括宝康系列基金、华宝多策略基金、华宝现金宝货币市场基金、华宝动力组合基金、华宝收益增长基金、华宝先进成长基金、华宝行业精选基金、华宝海外中国成长基金、华宝大盘精选基金、华宝增强收益基金、华宝中证 100 基金、上证 180 价值 ETF、华宝上证 180 价值 ETF 联接基金、华宝新兴产业基金、华宝可转债基金、华宝油气基金、华宝医药生物基金、华宝资源优选基金、华宝添益货币市场基金、华宝服务优选基金、华宝创新优选基金、华宝生态中国基金、华宝量化对冲基金、华宝高端制造基金、华宝品质生活基金、华宝稳健回报基金、华宝事件驱动基金、华宝国策导向基金、华宝新价值基金、华宝新机遇基金、华宝医疗分级基金、华宝中证 1000 分级基金、华宝万物互联基金、华宝转型升级基金、华宝核心优势基金、华宝美国消费基金、华宝香港中小盘基金、华宝中证全指证券公司 ETF、华宝中证军工 ETF、华宝新活力基金、华宝沪深 300 指数增强基金、华宝未来主导产业基金、华宝新起点基金、华宝红利基金、华宝新飞跃基金、华宝新优选基金、华宝香港大盘基金、华宝智慧产业基金、华宝第三产业基金、华宝银行 ETF、华宝银行 ETF 联接基金、华宝价值发现基金、华宝香港本地基金、华宝中证 500 指数增强基金、华宝香港精选基金、华宝券商 ETF 联接基金、华宝宝丰高等级债券基金、华宝绿色主题基金、华宝沪港深价值基金、华宝科技先锋基金、华宝宝裕纯债基金、华宝大健康基金、华宝中短债基金、华宝稳健 FOF 基金、华宝宝盛纯债基金、华宝宝怡纯债基金、华宝消费升级基金、华宝质量价值基金等，正在管理运作的证券投资基金资产净值合计 171,851,775,826.03 元。

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		
周晶	国际业务部 总经理，本基金基金经理、华宝	2018 年 10 月 25 日	-	14 年	博士。先后在美国德州奥斯丁市德亚资本、泛太平洋证券（美国）和汇丰证券（美国）从事数量分析、另类投资分析和证券投资

	<p>油气、华宝标普香港上市中国中小盘指数 (LOF)、华宝港股通恒生中国 (香港上市) 25 指数 (场内简称“香港大盘”)、华宝港股通恒生香港 35 指数 (场内简称“香港本地”)、华宝标普沪港深中国增强价值指数 (场内简称“价值基金”) 基金经理</p>			<p>研究工作。2005 年至 2007 年任华宝基金管理有限公司内控审计风险管理部主管。2011 年再次加入华宝基金管理有限公司任策略部总经理兼首席策略分析师，现任国际业务部总经理兼华宝资产管理(香港)有限公司董事。2013 年 6 月至 2015 年 11 月任华宝成熟市场动量优选证券投资基金基金经理，2014 年 9 月起任华宝标普石油天然气上游股票指数证券投资基金 (LOF) 基金经理，2015 年 9 月至 2017 年 8 月任华宝中国互联网股票型证券投资基金基金经理，2016 年 3 月起任华宝标普美国品质消费股票指数证券投资基金 (LOF) 基金经理，2016 年 6 月起任华宝标普香港上市中国中小盘指数证券投资基金 (LOF) 基金经理，2017 年 4 月起任华宝港股通恒生中国 (香港上市) 25 指数证券投资基金 (LOF) 基金经理，2018 年 3 月起任华宝港股通恒生香港 35 指数证券投资基金 (LOF) 基金经理，2018 年 10 月起任华宝标普沪港深中国增强价值指数证券投资基金 (LOF) 基金经理。</p>
--	--	--	--	---

注：1、任职日期以及离任日期均以基金公告为准。

2、证券从业含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》及其各项实施细则、《华宝标普沪港深中

国增强价值指数证券投资基金（LOF）基金合同》和其他相关法律法规的规定、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋取最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

由于股、债市的系统性风险和申购赎回引起的基金资产规模变化，华宝标普沪港深中国增强价值指数证券投资基金在短期内出现过基金资产总值占基金资产净值大于 140%和持有现金与到期日在一年之内的政府债券市值占基金资产净值比低于 5%的情况。发生此类情况后，该基金均在合理期限内得到了调整，没有给投资人带来额外风险或损失。

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，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

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

2019 年一季度，全球风险资产迅速反弹。主要原因在于美联储今年以来货币政策导向迅速由

鹰转鸽，同时中美贸易谈判一季度整体进展顺利，市场预期双方大概率上半年能够达成最终决议。而对于港股和 A 股而言，除了以上利好之外，中国央行一季度推行较宽松的货币政策，市场给予了非常正面的回应。而中国经济数据也在 3 月出现企稳迹象，国内 3 月官方 PMI 指数重回 50 以上。这进一步提振了市场的信心。因此 A 股和港股一季度表现靓丽。但四月十九日中央政治局会议强调“坚持结构性去杠杆，在推动高质量发展中防范化解风险，坚决打好三大攻坚战”，国内货币政策由此从一季度的宽松转向稳健。而后续四月和五月的经济数据都不尽如人意，投资者开始担心经济下行风险，市场步入调整。而美国总统特朗普五月五日突然发推特，表示将提高中国进口商品关税到 25%，中美之间贸易摩擦骤然升级，市场的风险偏好因此大幅下降。五月 24 日中国人民银行发布接管包商银行的公告，投资者开始更加担忧中小银行的系统性金融风险，从而导致股票市场进一步下挫。此后央行信心喊话并确认政策工具准备充足后，市场情绪有所恢复。六月十八日中美两国元首就贸易问题通电话后，投资者风险偏好有所抬升，A 股和港股都有所反弹。截止今年二季度末，标普沪港深中国增强价值指数（人民币），从 1495.3 上涨到 1560.17，涨幅 4.34%。恒生国企指数这段期间上涨 7.48%，沪深 300 指数这段期间上涨 27.1%。标的指数涨幅低于恒生国企和沪深 300 指数的原因在于指数成分股以银行、材料、工业等传统周期行业为主，这些行业在二季度受流动性收紧影响较大。沪港深中国增强价值从基金上半年年化波动率为 17.6%，相较恒生国企指数的 17.2%略高，相较沪深 300 指数的 24.9%更低。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金份额 A 净值收益率为 5.78%，同期业绩比较基准收益率为 4.55%。本报告期基金份额 C 净值收益率为 2.56%，同期业绩比较基准收益率为 0.34%。

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 2019 年下半年，我们认为 A 股和港股股票市场下半年或将以震荡为主，而四季度市场机会可能比三季度更大。

三季度初始 A 股和港股即将进入半年报业绩期，两地市场皆面临业绩下调的压力，但预计将展现一定韧性。大阪 G20 会议之后，美国对中国出口额外的 3000 亿美元 25%关税暂不征收，后续盈利下调空间或较为有限，A 股和港股存在一定的业绩支撑。而 19 年一季度，中国逆周期对冲政策加码，积极财政政策、信用扩张、基建反弹、价格韧性支撑经济名义值高韧性，降低了经济失

速压力。货币及社融改善仍存在一定惯性，经济失速下行风险有所降低。但经济向上弹性仍不足：政策相机抉择和“保持定力”意味着不是“大水漫灌”式的刺激，而中美贸易摩擦下的出口冲击和制造业投资增长受阻，使得经济和盈利或缺乏向上弹性。较有利的是，目前市场对于 19 年 A 股和港股全年的 EPS 增速预测已经历了较大幅的下修，后续盈利继续下调的空间较为有限，这是两地市场当下和 2018 年中较为不同之处。但不可否认，后续中报和三季报期间，基本面验证回落和流动性边际改善较大概率将使市场更多呈现出震荡特征。

进入三季度末，我们认为 A 股和港股市场机会将增大。主要原因在于：（1）2019 年 4 季度由于基数原因盈利增速有望反弹（2）财政政策上地方债是否能突破全年发行额度的验证期是 9 到 10 月；（3）中美贸易谈判在四季度可能会达成部分协议；（4）8 月和 11 月，海外重要指数公司或将两次进一步提升 A 股纳入系数。如果届时外需或内需预期出现边际改善的信号，将对于 A 股和港股形成提振。具体信号包括：1) 外需角度 — 美国宽松货币政策对于利率敏感板块的提振效应；2) 国内货币政策在经济下行期后续的政策和增长之间博弈的具体演绎。对于以上两大信号保持密切关注。

从全球股市的长期数据来看，价值因子是一个能够相对于基准有超额收益的有效投资因子，该因子的超额收益在震荡或下行市场环境中更为明显。我们认为本基金这样安全边际较高的价值型策略指数基金今年后续仍然能够有所表现。此外，四季度向低估值板块迁移底仓，是 A 股和港股较为稳定的市场特征，银行和地产值得关注，对于标的指数形成利好。此外，新中国成立 70 周年，国企改革有望加速，标的指数内国企占比较高，国企周期龙头阶段性主题行情有利于标的阶段性发挥。

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。

(1) 日常估值流程

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帐务处理；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。

(2) 特殊业务估值流程

根据中国证券监督管理委员会[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、中国证券投资基金业协会《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》、《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》、《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》等有关规定及本公司的估值制度，对特殊品种或由于特殊原因导致投资品种不存在活跃市场的情况，量化投资部根据估值委员会确定的对停牌股票或异常交易股票估值调整的方法（比如：指数收益法）进行估值，并兼顾行业研究员基于上市公司估值模型计算结果所提出的估值建议或意见。必要时基金经理也会就估值模型及估值方法的确定提出建议和意见，但由估值委员会做最终决策。

上述参与估值流程的人员均具备估值业务所需的专业胜任能力，参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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基金托管人应尽的义务。

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。

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

§ 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：华宝标普沪港深中国增强价值指数证券投资基金（LOF）

报告截止日：2019年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	8,180,324.13	3,645,471.52
结算备付金		97,268.70	2,845,716.20
存出保证金		38,753.77	135,614.89
交易性金融资产	6.4.7.2	116,339,745.01	56,568,365.32
其中：股票投资		116,339,745.01	56,568,365.32
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	1,706.16	1,832.60
应收股利		1,199,223.22	-
应收申购款		507,799.29	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		126,364,820.28	63,197,000.53
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018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		-	-
应付证券清算款		13.97	310,470.71
应付赎回款		2,449,141.33	523,620.47
应付管理人报酬		72,966.33	42,201.04
应付托管费		14,593.28	8,440.21
应付销售服务费		4.16	-
应付交易费用	6.4.7.7	69,901.08	74,260.60

应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	269,277.37	144,329.57
负债合计		2,875,897.52	1,103,322.60
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	122,287,653.91	65,049,268.37
未分配利润	6.4.7.10	1,201,268.85	-2,955,590.44
所有者权益合计		123,488,922.76	62,093,677.93
负债和所有者权益总计		126,364,820.28	63,197,000.53

报告截止日 2019 年 6 月 30 日，华宝价值基金基金份额净值 1.0098 元，基金份额总额 122,266,608.02 份；华宝价值基金 C 基金份额净值 1.0095 元，基金份额总额 21,045.89 份。华宝标普沪港深中国增强价值指数份额总额合计为 122,287,653.91 份。

6.2 利润表

会计主体：华宝标普沪港深中国增强价值指数证券投资基金（LOF）

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
一、收入		3,425,043.72
1.利息收入		39,201.36
其中：存款利息收入	6.4.7.11	39,201.36
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		-
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		4,716,323.54
其中：股票投资收益	6.4.7.12	1,831,541.18
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-
股利收益	6.4.7.16	2,884,782.36
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-1,538,373.59
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	207,892.41

减：二、费用		894,936.50
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	349,341.29
2. 托管费	6.4.10.2.2	69,868.32
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	4.36
4. 交易费用	6.4.7.19	306,608.09
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		-
7. 其他费用	6.4.7.20	169,114.44
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		2,530,107.22
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		2,530,107.22

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华宝标普沪港深中国增强价值指数证券投资基金（LOF）

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	65,049,268.37	-2,955,590.44	62,093,677.93
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	2,530,107.22	2,530,107.22
三、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）	57,238,385.54	1,626,752.07	58,865,137.61
其中：1. 基金申购款	153,987,271.22	7,950,617.47	161,937,888.69
2. 基金赎回款	-96,748,885.68	-6,323,865.40	-103,072,751.08
四、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）	-	-	-
五、期末所有者权益	122,287,653.91	1,201,268.85	123,488,922.76

(基金净值)			
--------	--	--	--

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：

_____	_____	_____
黄小慧	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

华宝标普沪港深中国增强价值指数证券投资基金(LOF)(以下简称“本基金”)系由基金管理人华宝基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《华宝标普沪港深中国增强价值指数证券投资基金(LOF)基金合同》(以下简称“基金合同”)及其他有关法律法规的规定,经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)以证监许可[2018]582 号文批准公开募集。本基金为上市契约型开放式基金,存续期限为不定期,首次设立募集基金份额为 246,763,927.66 份,经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)验证,并出具了编号为德师报(验)字(18)第 00009 号的验资报告。基金合同于 2018 年 10 月 25 日正式生效。本基金的基金管理人为华宝基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、截至报告期末最新公告的基金合同及《华宝标普沪港深中国增强价值指数证券投资基金(LOF)招募说明书》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,包括标的指数成份股、备选成份股、依法发行上市的其他股票(包括港股通标的股票和中国证监会核准发行上市的其他股票)、债券(国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、债券回购、资产支持证券、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、权证、股指期货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)。本基金可以参与融资和转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为:本基金投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%,且投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%;每个交易日日终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)或者投资于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%。本基金出于跟踪标的指数的需要,选择将部分基金资产投资于港股或选择不将基金资产投资于港股,基金资产并非必然投资港股。本基金通过港股通投资标的指数的成份股、备选成份股,未来如果港股通业务规则发生变化或出现法律法规或监管部门允许投资的其他模式,基金管理人可在履行适当程序后相应调整。本基金的业绩比较基准为:标普沪港深中国增强价值指数收益率 $\times 95\%$ +人民币银行活期存款利率(税后) $\times 5\%$ 。

本基金的财务报表于 2019 年 8 月 29 日已经本基金的基金管理人批准报出。

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颁布的企业会计准则及相关规定(以下简称“企业会计准则”)以及中国证监会发布的基金行业实务操作的有关规定编制,同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2019 半年度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 2019 年 6 月 30 日的财务状况以及 2019 半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金本报告期所采用的会计政策和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

本基金本报告期内无需说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2008]1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008 年 9 月 18 日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、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[2014]48 号《关于实施全国中小企业股份转让系统挂牌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[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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]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]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》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

1) 证券投资基金(封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券免征增值税；2018 年 1 月 1 日起，公开募集证券投资基金运营过程中发生的其他增值税应税行为，以基金管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。

2) 对证券投资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，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不缴纳企业所得税。

3) 对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司在收到相关扣收税款当月的法定申报期内向主管税务机关申报缴纳；从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。对基金通过沪港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20%的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20%的税率代扣个人所得税。

4) 对基金取得的债券利息收入，由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20%的个人所得税，暂不缴纳企业所得税。

5) 对于基金从事 A 股买卖，出让方按 0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税，对受让方不再缴纳印花税。对于基金通过沪港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

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 2019年6月30日
活期存款	8,180,324.13
定期存款	-
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	-
合计：	8,180,324.13

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	120,434,410.15	116,339,745.01	-4,094,665.14
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	120,434,410.15	116,339,745.01	-4,094,665.14

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

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 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
应收活期存款利息	1,594.85
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	93.32
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	9.39
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	8.60
合计	1,706.16

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
交易所市场应付交易费用	69,901.08
银行间市场应付交易费用	-
合计	69,901.08

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	8,920.28
预提费用	104,727.29
指数使用费	141,424.73

应付数据使用费	14,205.07
合计	269,277.37

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

华宝价值基金		
项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	65,049,268.37	65,049,268.37
本期申购	153,961,685.77	153,961,685.77
本期赎回(以“-”号填列)	-96,744,346.12	-96,744,346.12
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	122,266,608.02	122,266,608.02

金额单位：人民币元

华宝价值基金C		
项目	本期 2019年5月21日至2019年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	-	-
本期申购	25,585.45	25,585.45
本期赎回(以“-”号填列)	-4,539.56	-4,539.56
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	21,045.89	21,045.89

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

华宝价值基金			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-172,994.51	-2,782,595.93	-2,955,590.44
本期利润	4,068,256.52	-1,538,640.43	2,529,616.09

本期基金份额交易产生的变动数	837,617.29	789,426.62	1,627,043.91
其中：基金申购款	1,534,443.06	6,416,404.53	7,950,847.59
基金赎回款	-696,825.77	-5,626,977.91	-6,323,803.68
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,732,879.30	-3,531,809.74	1,201,069.56

单位：人民币元

华宝价值基金 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	224.29	266.84	491.13
本期基金份额交易产生的变动数	583.32	-875.16	-291.84
其中：基金申购款	747.62	-977.74	-230.12
基金赎回款	-164.30	102.58	-61.72
本期已分配利润	-	-	-
本期末	807.61	-608.32	199.29

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
活期存款利息收入	32,649.49
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	5,902.63
其他	649.24
合计	39,201.36

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
卖出股票成交总额	50,534,908.43
减：卖出股票成本总额	48,703,367.25
买卖股票差价收入	1,831,541.18

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

无

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

无

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
股票投资产生的股利收益	2,884,782.36
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,884,782.36

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-1,538,373.59
——股票投资	-1,538,373.59
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
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	-1,538,373.59

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	207,892.41
其他	-
合计	207,892.41

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	306,608.09
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	306,608.09

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
审计费用	24,795.19
信息披露费	29,932.10
指数使用费	102,948.00
银行费用	1,113.48
数据使用费	10,325.67
合计	169,114.44

注：根据基金合同及与标的指数许可方所签订的指数许可使用协议，本基金的指数许可使用费从基金财产中列支，按前一日基金资产净值的 0.05% 的年费率计提。其计算公式为：日指数许可使用费=前一日基金资产净值×0.05%÷当年天数。指数许可使用费的收取下限为每年 30,000 美元。

6.4.7.21 分部报告

无。

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，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无其它需作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(以下简称“华宝基金”)	基金管理人、基金销售机构、注册登记机构
中国建设银行股份有限公司(以下简称“中国建设银行”)	基金托管人、基金销售机构
华宝信托有限责任公司(以下简称“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
中国宝武钢铁集团有限公司 (以下简称“宝武集团”)	华宝信托的最终控制人
华宝证券有限责任公司 (以下简称“华宝证券”)	受宝武集团控制的公司
华宝投资有限公司 (以下简称“华宝投资”)	受宝武集团控制的公司
宝钢集团财务有限责任公司 (以下简称“宝钢财务”)	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 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018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	694,027.00	0.43%	-	-

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本期无通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本期无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本期无通过关联方交易单元进行的权证交易。

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 2019年1月1日至2019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	646.42	0.47%	646.42	0.92%

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
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	349,341.29
其中：支付销售机构的客户维护费	132,476.24

注：支付基金管理人华宝基金的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 0.75% 的年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×0.75%÷当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	69,868.32

注：支付基金托管人中国建设银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.15% 的年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.15%÷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		
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华宝价值基金	华宝价值基金 C	合计
华宝基金	-	0.83	0.83
合计	-	0.83	0.83

注：本基金 C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.40%，销售服务费按前一日 C 类基金份额基金资产净值的 0.40% 年费率计提。

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

本基金本报告期内无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 各关联方投资本基金的情况**6.4.10.4.1 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。

6.4.10.4.2 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 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 2019年1月1日至2019年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	8,180,324.13	32,649.49

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期末投资于基金托管人中国建设银行发行的股票——建设银行(证券代码：00939) 987,000 股，期末公允价值为人民币 5,843,150.35 元，占本基金期末基金资产净值比例为 4.73%。

除以上情况外，无其他需要说明的关联方交易事项。

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（2019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**

本基金本报告期末持有的证券中无因新发/增发证券而于期末持有流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末持有的股票中无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因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无因交易所市场债券正回购交易而抵押的债券。

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

本基金为指数型基金，跟踪标普沪港深中国增强价值指数。本基金在日常经营活动中面临的与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与跟踪指数相同的风险收益目标。

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、监察稽核部、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；监察稽核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监察稽核部对各岗位、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，并对风险管理部和监察稽核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结合定性分析和定量分析方法，估计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。

为了规避信用风险，本公司在交易前对交易对手的资信状况进行充分的评估。本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，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通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，违约风险发生的可能性很小；在场外交易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，通过对投资品种的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。

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 金融资产和金融负债的到期期限分析

无

6.4.13.3.2 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》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)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上市公司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；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。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

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。

本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及存出保证金等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019 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	8,180,324.13	-	-	-	8,180,324.13
结算备付金	97,268.70	-	-	-	97,268.70
存出保证金	38,753.77	-	-	-	38,753.77
交易性金融资产	-	-	-	116,339,745.01	116,339,745.01
应收利息	-	-	-	1,706.16	1,706.16
应收股利	-	-	-	1,199,223.22	1,199,223.22
应收申购款	3,982.52	-	-	503,816.77	507,799.29
资产总计	8,320,329.12	-	-	118,044,491.16	126,364,820.28
负债					
应付证券清算款	-	-	-	13.97	13.97
应付赎回款	-	-	-	2,449,141.33	2,449,141.33
应付管理人报酬	-	-	-	72,966.33	72,966.33
应付托管费	-	-	-	14,593.28	14,593.28
应付指数使用费	-	-	-	4.16	4.16
应付交易费用	-	-	-	69,901.08	69,901.08
其他负债	-	-	-	269,277.37	269,277.37
负债总计	-	-	-	2,875,897.52	2,875,897.52
利率敏感度缺口	8,320,329.12	-	-	115,168,593.64	123,488,922.76
上年度末 2018 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	3,645,471.52	-	-	-	3,645,471.52
结算备付金	2,845,716.20	-	-	-	2,845,716.20
存出保证金	135,614.89	-	-	-	135,614.89
交易性金融资产	-	-	-	56,568,365.32	56,568,365.32
应收利息	-	-	-	1,832.60	1,832.60
资产总计	6,626,802.61	-	-	56,570,197.92	63,197,000.53
负债					
应付证券清算款	-	-	-	310,470.71	310,470.71
应付赎回款	-	-	-	523,620.47	523,620.47
应付管理人报酬	-	-	-	42,201.04	42,201.04
应付托管费	-	-	-	8,440.21	8,440.21
应付交易费用	-	-	-	74,260.60	74,260.60
其他负债	-	-	-	144,329.57	144,329.57

负债总计	-	-	-	1,103,322.60	1,103,322.60
利率敏感度缺口	6,626,802.61	-	-	55,466,875.32	62,093,677.93

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本报告期末，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

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。本基金持有不以记账本位币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

截至本报告期末，本基金所持有的交易性金融资产主要投资于香港股票市场，以港币计价，金额折合成人民币为 64,171,676.41 元。

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的股票，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。

本基金采用指数化投资策略，股票资产跟踪的标的指数为标普沪港深中国增强价值指数，通过指数化分散投资降低其他价格风险。本基金投资于标的指数成份股及其备选成份股股票资产的比例不低于基金资产净值的 90%，且投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%。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 2019年6月30日	上年度末 2018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	116,339,745.01	94.21	56,568,365.32	91.10
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
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	116,339,745.01	94.21	56,568,365.32	91.10

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于本报告期末，本基金成立尚未满一年，无足够历史经验数据计算其他价格风险对基金资产净值的影响。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 不以公允价值计量的金融工具

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。

(b) 以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于本报告期末，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为人民币 116,339,745.01 元，无属于第二层次和第三层次的余额(2018 年 12 月 31 日属于第一层次的余额为人民币 56,568,365.32 元，无属于第二层次和第三层次的余额)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于本基金投资的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、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根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关证券公允价值应属第二层次或第三层次。

(iii) 第三层次公允价值计量的金融工具

无。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项

§ 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	116,339,745.01	92.07
	其中：股票	116,339,745.01	92.07
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	8,277,592.83	6.55
8	其他各项资产	1,747,482.44	1.38
9	合计	126,364,820.28	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 期末指数投资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	-	-
B	采矿业	729,521.00	0.59
C	制造业	15,525,220.80	12.57
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	293,488.00	0.24
E	建筑业	9,435,518.00	7.64
F	批发和零售业	2,377,822.00	1.93
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	17,770,988.80	14.39

K	房地产业	5,823,046.00	4.72
L	租赁和商务服务业	212,464.00	0.17
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	52,168,068.60	42.25

7.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

本报告期末未持有积极投资的境内股票。

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
房地产	5,112,604.15	4.14
非日常生活消费品	3,069,657.14	2.49
工业	10,708,268.31	8.67
公用事业	1,147,182.20	0.93
金融	24,588,665.35	19.91
能源	10,728,289.38	8.69
信息技术	1,275,278.29	1.03
医疗保健	641,799.94	0.52
原材料	6,899,931.65	5.59
合计	64,171,676.41	51.97

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

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	占基金资产净值比例（%）
1	601166	兴业银行	366,800	6,708,772.00	5.43
2	00939	建设银行	987,000	5,843,150.35	4.73
3	601668	中国建筑	986,800	5,674,100.00	4.59
4	03988	中国银行	1,896,000	5,503,856.69	4.46
5	600000	浦发银行	445,650	5,205,192.00	4.22

6	00386	中国石油化工股份	1,078,000	5,035,332.18	4.08
7	00857	中国石油股份	1,122,000	4,253,877.42	3.44
8	00267	中信股份	396,000	3,922,368.75	3.18
9	03328	交通银行	574,000	2,994,204.30	2.42
10	600019	宝钢股份	404,100	2,626,650.00	2.13
11	01800	中国交通建设	374,000	2,299,659.95	1.86
12	03323	中国建材	376,000	2,265,652.30	1.83
13	01288	农业银行	771,000	2,217,772.40	1.80
14	601169	北京银行	293,880	1,736,830.80	1.41
15	601818	光大银行	434,200	1,654,302.00	1.34
16	600383	金地集团	127,700	1,523,461.00	1.23
17	00998	中信银行	382,000	1,495,334.03	1.21
18	000100	TCL 集团	441,800	1,471,194.00	1.19
19	00390	中国中铁	258,000	1,348,096.54	1.09
20	600606	绿地控股	196,800	1,344,144.00	1.09
21	600741	华域汽车	62,100	1,341,360.00	1.09
22	601669	中国电建	248,300	1,313,507.00	1.06
23	600919	江苏银行	170,700	1,239,282.00	1.00
24	600015	华夏银行	159,300	1,226,610.00	0.99
25	02328	中国财险	162,000	1,201,316.48	0.97
26	00489	东风集团股份	202,000	1,137,224.45	0.92
27	01988	民生银行	238,000	1,132,632.62	0.92
28	01186	中国铁建	131,500	1,108,169.28	0.90
29	601618	中国中冶	363,900	1,106,256.00	0.90
30	01171	兖州煤业股份	164,000	1,053,128.95	0.85
31	02777	富力地产	78,400	1,035,859.47	0.84
32	600068	葛洲坝	166,100	1,034,803.00	0.84
33	03383	雅居乐集团	108,000	993,734.31	0.80
34	600153	建发股份	109,600	973,248.00	0.79
35	02333	长城汽车	197,500	971,166.63	0.79
36	00148	建滔集团	49,000	937,497.65	0.76
37	000709	河钢股份	304,000	908,960.00	0.74
38	00392	北京控股	26,000	907,985.05	0.74
39	00884	旭辉控股集团	200,000	906,049.80	0.73
40	01658	邮储银行	214,000	873,467.19	0.71
41	00966	中国太平	46,200	849,382.10	0.69
42	00144	招商局港口	70,000	817,731.94	0.66
43	600755	厦门国贸	93,400	806,042.00	0.65

44	00358	江西铜业股份	86,000	786,767.90	0.64
45	600376	首开股份	84,600	755,478.00	0.61
46	601233	桐昆股份	48,300	749,133.00	0.61
47	000402	金融街	93,600	733,824.00	0.59
48	03311	中国建筑国际	104,000	733,706.81	0.59
49	002092	中泰化学	89,900	715,604.00	0.58
50	01339	中国人民保险集团	258,000	692,204.45	0.56
51	03377	远洋集团	232,500	679,009.55	0.55
52	02689	玖龙纸业	110,000	670,564.82	0.54
53	01378	中国宏桥	133,000	644,641.24	0.52
54	02607	上海医药	47,500	641,799.94	0.52
55	03883	中国奥园	65,000	627,813.34	0.51
56	600166	福田汽车	257,100	609,327.00	0.49
57	000825	太钢不锈	149,300	607,651.00	0.49
58	02600	中国铝业	248,000	604,291.23	0.49
59	600297	广汇汽车	134,200	598,532.00	0.48
60	600325	华发股份	76,500	597,465.00	0.48
61	000625	长安汽车	88,200	584,766.00	0.47
62	000778	新兴铸管	118,600	526,584.00	0.43
63	00493	国美零售	703,000	519,456.82	0.42
64	600567	山鹰纸业	153,600	517,632.00	0.42
65	00338	上海石油化工股份	188,000	512,665.85	0.42
66	000039	中集集团	48,000	512,640.00	0.42
67	000830	鲁西化工	47,000	511,360.00	0.41
68	600282	南钢股份	143,000	500,500.00	0.41
69	01359	中国信达	315,000	498,767.22	0.40
70	000932	华菱钢铁	101,740	485,299.80	0.39
71	01055	中国南方航空股份	100,000	478,535.04	0.39
72	002110	三钢闽光	49,900	464,070.00	0.38
73	01813	合景泰富集团	65,500	456,908.60	0.37
74	000671	阳光城	69,500	450,360.00	0.36
75	01958	北京汽车	102,500	441,809.24	0.36
76	600266	北京城建	51,900	418,314.00	0.34
77	01628	禹洲地产	128,000	413,229.08	0.33
78	000059	华锦股份	62,700	401,280.00	0.32
79	600782	新钢股份	78,200	391,000.00	0.32

80	02009	金隅集团	177,000	390,806.55	0.32
81	01898	中煤能源	135,000	385,950.83	0.31
82	600418	江淮汽车	74,400	383,904.00	0.31
83	600348	阳泉煤业	64,200	373,002.00	0.30
84	00323	马鞍山钢铁股份	132,000	359,956.87	0.29
85	02799	中国华融	299,000	357,704.94	0.29
86	600711	盛屯矿业	65,900	356,519.00	0.29
87	000488	晨鸣纸业	66,100	354,296.00	0.29
88	03800	保利协鑫能源	893,000	337,780.64	0.27
89	00347	鞍钢股份	106,200	332,574.82	0.27
90	02314	理文造纸	69,000	332,010.07	0.27
91	03618	重庆农村商业银行	88,000	328,992.84	0.27
92	06881	中国银河	77,500	315,644.00	0.26
93	600039	四川路桥	84,300	306,852.00	0.25
94	600409	三友化工	52,300	296,018.00	0.24
95	000040	东旭蓝天	44,200	293,488.00	0.24
96	600060	海信电器	33,900	292,218.00	0.24
97	00165	中国光大控股	28,000	284,235.74	0.23
98	000717	韶钢松山	61,800	273,774.00	0.22
99	01071	华电国际电力股份	88,000	239,197.15	0.19
100	000415	渤海租赁	54,200	212,464.00	0.17

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本报告期末未持有积极投资部分的股票投资。

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	601166	兴业银行	5,391,299.00	8.68
2	601668	中国建筑	4,788,436.10	7.71
3	00386	中国石油化工股份	4,721,381.73	7.60
4	03988	中国银行	4,603,134.12	7.41
5	00939	建设银行	4,521,848.22	7.28

6	600000	浦发银行	4,231,776.00	6.82
7	00857	中国石油股份	3,964,828.45	6.39
8	00267	中信股份	3,041,086.94	4.90
9	600019	宝钢股份	2,548,414.30	4.10
10	03328	交通银行	2,536,366.09	4.08
11	601818	光大银行	2,236,400.00	3.60
12	01800	中国交通建设	2,016,172.60	3.25
13	01288	农业银行	2,002,247.57	3.22
14	03323	中国建材	1,837,196.56	2.96
15	600383	金地集团	1,790,541.10	2.88
16	000100	TCL 集团	1,769,375.00	2.85
17	601169	北京银行	1,635,245.00	2.63
18	600741	华域汽车	1,605,874.52	2.59
19	601618	中国中冶	1,479,240.00	2.38
20	600919	江苏银行	1,376,836.00	2.22
21	00998	中信银行	1,300,538.12	2.09
22	601669	中国电建	1,287,981.00	2.07
23	00390	中国中铁	1,246,418.16	2.01

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	01398	工商银行	3,209,892.69	5.17
2	00688	中国海外发展	2,284,832.05	3.68
3	601668	中国建筑	2,200,932.00	3.54
4	601166	兴业银行	2,016,018.00	3.25
5	00939	建设银行	1,720,966.56	2.77
6	03988	中国银行	1,717,288.04	2.77
7	00386	中国石油化工股份	1,545,558.81	2.49
8	600000	浦发银行	1,519,240.00	2.45
9	00267	中信股份	1,475,427.46	2.38
10	00857	中国石油股份	1,231,150.08	1.98
11	00728	中国电信	1,101,907.15	1.77
12	03328	交通银行	1,000,332.80	1.61

13	600019	宝钢股份	870,368.00	1.40
14	01099	国药控股	829,728.17	1.34
15	01800	中国交通建设	823,512.84	1.33
16	01288	农业银行	611,834.34	0.99
17	00390	中国中铁	545,116.45	0.88
18	03323	中国建材	528,239.59	0.85
19	601169	北京银行	521,661.00	0.84
20	00836	华润电力	513,144.57	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	110,013,120.53
卖出股票收入（成交）总额	50,534,908.43

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金未投资股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金未投资股指期货。

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 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金未投资国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚，无证券投资决策程序需特别说明。

7.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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。

7.12.3 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	38,753.77
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	1,199,223.22
4	应收利息	1,706.16
5	应收申购款	507,799.29
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,747,482.44

7.12.4 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。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极投资。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，合计数可能不等于分项之和。

§ 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
华宝价值基金	14,625	8,360.11	0.00	0.00%	122,266,608.02	100.00%
华宝价值基金 C	27	779.48	0.00	0.00%	21,045.89	100.00%
合计	14,652	8,346.14	0.00	0.00%	122,287,653.91	100.00%

8.2 期末上市基金前十名持有人

华宝价值基金

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例
1	张巍	2,027,790.00	4.85%
2	屈艳贞	1,234,500.00	2.96%
3	郑文强	1,054,500.00	2.52%
4	朱李燕	888,800.00	2.13%
5	慕永青	871,710.00	2.09%
6	刘垚	731,700.00	1.75%
7	张光明	705,529.00	1.69%
8	叶秀华	605,215.00	1.45%
9	吴庆华	580,000.00	1.39%
10	陈坤雄	546,978.00	1.31%

注：上述持有人均为场内持有人。

8.3 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	华宝价值	32,366.73	0.0265%

持有本基金	基金		
	华宝价值基金 C	2,134.59	10.1426%
	合计	34,501.32	0.0282%

8.4 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的情况

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	华宝价值基金	0
	华宝价值基金 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	华宝价值基金	0
	华宝价值基金 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华宝价值基金	华宝价值基金 C
基金合同生效日（2018 年 10 月 25 日）基金份额总额	246,763,927.66	-
本报告期期初基金份额总额	65,049,268.37	-
本报告期期间基金总申购份额	153,961,685.77	25,585.45
减：本报告期期间基金总赎回份额	96,744,346.12	4,539.56
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	122,266,608.02	21,045.89

§ 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

托管人中国建设银行 2019 年 6 月 4 日发布公告，聘任蔡亚蓉为中国建设银行股份有限公司资产托管业务部总经理。

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、基金资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

本报告期内，基金管理人、托管人及其高级管理人员未有受到稽查或处罚的情况。

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	股票交易	应支付该券商的佣金

	交易单元 数量	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	备注
中信证券	2	92,756,152.20	57.77%	74,433.36	54.17%	-
天风证券	2	18,965,203.61	11.81%	17,604.48	12.81%	-
海通证券	1	15,120,183.67	9.42%	14,075.73	10.24%	-
长江证券	1	6,329,423.47	3.94%	5,893.34	4.29%	-
光大证券	1	3,767,997.10	2.35%	3,509.91	2.55%	-
广发证券	2	3,663,362.00	2.28%	3,411.45	2.48%	-
西南证券	1	2,145,505.00	1.34%	1,999.41	1.46%	-
民生证券	1	1,861,776.79	1.16%	1,733.73	1.26%	-
中泰证券	2	1,690,993.00	1.05%	1,540.99	1.12%	-
招商证券	2	1,412,746.50	0.88%	1,286.88	0.94%	-
东吴证券	1	1,389,136.00	0.87%	1,293.10	0.94%	-
东方证券	2	1,347,549.00	0.84%	1,254.97	0.91%	-
东北证券	1	1,254,938.00	0.78%	1,168.73	0.85%	-
万联证券	1	1,169,242.00	0.73%	1,065.41	0.78%	-
中投证券	1	1,048,388.10	0.65%	976.27	0.71%	-
安信证券	1	1,028,638.00	0.64%	957.83	0.70%	-
申万宏源	3	989,566.00	0.62%	921.06	0.67%	-
华创证券	1	953,699.00	0.59%	887.09	0.65%	-
瑞银证券	1	795,085.00	0.50%	740.48	0.54%	-
华宝证券	1	694,027.00	0.43%	646.42	0.47%	-
国金证券	1	573,336.00	0.36%	533.90	0.39%	-
银河证券	1	494,002.52	0.31%	460.15	0.33%	-
国泰君安	2	310,827.00	0.19%	283.19	0.21%	-
中信建投	2	299,738.00	0.19%	273.32	0.20%	-
长城证券	1	197,678.00	0.12%	184.09	0.13%	-
兴业证券	2	191,099.00	0.12%	174.13	0.13%	-
华泰证券	1	97,737.00	0.06%	91.06	0.07%	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
中金国际	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
华信证券	1	-	-	-	-	-

国信证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
红塔证券	1	-	-	-	-	-
广州证券	1	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
中航证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-

注：基金管理人选择交易单元的标准和程序如下：

(1) 选择标准：资力雄厚，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. 本基金本报告期券商交易单元新增：红塔证券。

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

本基金本报告期内未租用证券公司交易单元进行其它证券投资。

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	华宝基金管理有限公司旗下基金资产净值公告	基金管理人网站	2019 年 1 月 1 日
2	华宝基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加北京百度百盈基金销售有限公司为代销机构的公告	上海证券报、证券时报、中国证券报、基金管理人网站	2019 年 1 月 10 日

3	关于华宝基金管理有限公司旗下部分开放式基金 2019 年非港股通交易日暂停申购、赎回及定期定额投资业务的公告	上海证券报、证券时报、中国证券报、基金管理人网站	2019 年 1 月 16 日
4	华宝标普沪港深中国增强价值指数证券投资基金 (LOF) 2018 年第 4 季度报告	证券时报、基金管理人网站	2019 年 1 月 21 日
5	华宝标普沪港深中国增强价值指数证券投资基金 (LOF) 暂停申购赎回及定期定额投资业务的公告	证券时报、基金管理人网站	2019 年 1 月 28 日
6	华宝标普中国 A 股质量价值指数证券投资基金 (LOF) 资产净值公告	证券时报、基金管理人网站	2019 年 3 月 1 日
7	华宝标普沪港深中国增强价值指数证券投资基金 (LOF) 场内交易价格波动的提示公告	证券时报、基金管理人网站	2019 年 3 月 1 日
8	华宝基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加北京汇成基金销售有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报、基金管理人网站	2019 年 3 月 21 日
9	华宝标普沪港深中国增强价值指数证券投资基金 (LOF) 2018 年度报告 (摘要)	证券时报、基金管理人网站	2019 年 3 月 30 日
10	华宝标普沪港深中国增强价值指数证券投资基金 (LOF) 2018 年度报告	基金管理人网站	2019 年 3 月 30 日
11	关于华宝现金宝货币基金 E 类份额转换、赎回转申购业务费率优惠公告	上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报、基金管理人网站	2019 年 4 月 15 日
12	华宝标普沪港深中国增强价值指数证券投资基金 (LOF) 暂停申购赎回及定期定额投资业务的公告	证券时报、基金管理人网站	2019 年 4 月 16 日
13	华宝标普沪港深中国增强价值指数证券投资基金 (LOF) 2019 年第 1 季度报告	证券时报、基金管理人网站	2019 年 4 月 19 日
14	华宝标普沪港深中国增强价值指数证券投资基金 (LOF) 暂停申购、赎回及定期定额投	证券时报、基金管理人网站	2019 年 4 月 24 日

	资业务的公告		
15	华宝标普沪港深中国增强价值指数证券投资基金（LOF）暂停申购、赎回及定期定额投资业务的公告	证券时报、基金管理人网站	2019 年 5 月 8 日
16	华宝基金管理有限公司关于华宝标普沪港深中国增强价值指数证券投资基金（LOF）增加 C 类基金份额并修改基金合同的公告	证券时报、基金管理人网站	2019 年 5 月 13 日
17	华宝标普沪港深中国增强价值指数证券投资基金（LOF）托管协议	基金管理人网站	2019 年 5 月 13 日
18	华宝标普沪港深中国增强价值指数证券投资基金（LOF）基金合同	基金管理人网站	2019 年 5 月 13 日
19	华宝标普沪港深中国增强价值指数证券投资基金（LOF）招募说明书（摘要）（更新）	证券时报、基金管理人网站	2019 年 6 月 10 日
20	华宝标普沪港深中国增强价值指数证券投资基金（LOF）招募说明书（更新）	基金管理人网站	2019 年 6 月 10 日
21	华宝基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加通华财富（上海）基金销售有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报、基金管理人网站	2019 年 6 月 12 日
22	关于华宝现金宝 E 货币基金定期转换、定期赎回转申购业务费率优惠公告	上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报、基金管理人网站	2019 年 6 月 18 日
23	华宝基金管理有限公司关于旗下部分基金可投资科创板股票的公告	上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报、基金管理人网站	2019 年 6 月 22 日
24	华宝标普沪港深中国增强价值指数证券投资基金（LOF）暂停申购、赎回及定期定额投资业务的公告	证券时报、基金管理人网站	2019 年 6 月 26 日
25	华宝基金管理有限公司旗下基金资产净值公告	基金管理人网站	2019 年 6 月 30 日

§ 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

无

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

- 1、基金管理人于 2019 年 5 月 13 日发布公告，自 2019 年 5 月 17 日增加华宝标普沪港深中国增强价值指数证券投资基金（LOF）C 类基金份额并修改基金合同。
- 2、基金管理人于 2019 年 6 月 22 日发布《华宝基金管理有限公司关于旗下部分基金可投资科创板股票的公告》，以上事项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；
华宝标普沪港深中国增强价值指数证券投资基金 (LOF) 基金合同；
华宝标普沪港深中国增强价值指数证券投资基金 (LOF) 招募说明书；
华宝标普沪港深中国增强价值指数证券投资基金 (LOF) 托管协议
基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
基金管理人报告期内在指定报刊上披露的各种公告；
基金托管人业务资格批件和营业执照。

12.2 存放地点

以上文件存于基金管理人及基金托管人办公场所备投资者查阅。

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

2019 年 8 月 29 日