

华宝中证 500 指数增强型发起式证券投资 基金 2020 年中期报告

2020 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：中国民生银行股份有限公司

送出日期：2020 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 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 2020 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	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	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作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	12
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	15
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	15
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	19
§ 7 投资组合报告	43
7.1 期末基金资产组合情况	43
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	44
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	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	54
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	55
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	55

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	55
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	56
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	56
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	56
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	56
7.12 市场中性策略执行情况	56
7.13 投资组合报告附注	56
§ 8 基金份额持有人信息	57
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	57
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	58
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	58
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	59
§ 9 开放式基金份额变动	59
§ 10 重大事件揭示	60
10.1 基金份额持有人大会决议	60
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	60
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	60
10.4 基金投资策略的改变	60
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	60
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	60
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	60
10.8 其他重大事件	61
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	62
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	62
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	62
§ 12 备查文件目录	63
12.1 备查文件目录	63
12.2 存放地点	63
12.3 查阅方式	63

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华宝中证 500 指数增强型发起式证券投资基金	
基金简称	华宝中证 500 增强	
基金主代码	005607	
基金运作方式	契约型开放式、发起式	
基金合同生效日	2018 年 4 月 19 日	
基金管理人	华宝基金管理有限公司	
基金托管人	中国民生银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	33,998,739.20 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华宝中证 500 增强 A	华宝中证 500 增强 C
下属分级基金的交易代码	005607	005608
报告期末下属分级基金的份额总额	22,478,432.43 份	11,520,306.77 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为中证 500 指数增强型基金，在实现对中证 500 指数有效跟踪的基础上，通过数量化的方法进行积极的组合配置和管理，力争实现超越标的指数的投资收益。
投资策略	本基金在复制标的指数的基础上优化投资组合，力求通过量化技术实现指数增强的效果。 1、资产配置策略 本基金主要投资于中证 500 指数成分股及备选股票，也会根据中证 500 股指期货的基差情况择机部分使用期货替代现货，降低成本。视市场情况本基金也会谨慎地参与一些绝对收益策略。同时，本基金将预留必要的现金，应对期货保证金的增加要求或投资者的赎回申请。 2、股票投资策略 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。在控制跟踪偏离度的前提下力争实现超额表现，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。 3、股指期货投资策略 在不同的市场环境下，本基金将综合考虑股指期货相对现货的基差、流动性、展期收益以及保证金要求等因素，选择部分使用股指期货多头合约替代指数现货，以求提高资金利用效率和组合收益水平。 4、债券投资策略 本基金基于流动性管理及策略性投资的需要，可投资于债券、货币市场工具和资产支持证券，以保证基金资产流动性，有效利用基金资产，提高基金资产的投资收益。

业绩比较基准	中证 500 指数收益率*95%+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，属于高预期风险、高预期收益的证券投资基金品种，其预期风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

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	中国民生银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	周雷	罗菲菲
	联系电话	021-38505888	010-58560666
	电子邮箱	xxpl@fsfund.com	tgbfxjdzx@cmbc.com.cn
客户服务电话		400-700-5588、400-820-5050、 021-38924558	95568
传真		021-38505777	010-58560798
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 2 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 2 号
邮政编码		200120	100031
法定代表人		孔祥清	高迎欣

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
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	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	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(2020 年 1 月 1 日-2020 年 6 月 30 日)	
	华宝中证 500 增强 A	华宝中证 500 增强 C

本期已实现收益	3,131,258.62	1,504,381.45
本期利润	3,687,035.86	1,853,436.08
加权平均基金份额本期利润	0.1422	0.1414
本期加权平均净值利润率	14.41%	14.44%
本期基金份额净值增长率	15.20%	14.99%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	1,189,239.14	505,419.59
期末可供分配基金份额利润	0.0529	0.0439
期末基金资产净值	24,562,898.90	12,478,898.30
期末基金份额净值	1.0927	1.0832
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	9.27%	8.32%

注：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、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）

3、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。

4、期末可供分配利润采用资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华宝中证 500 增强 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差	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
----	----------	------------	------------	---------------	-----	-----

		②		准差④		
过去一个月	9.14%	0.81%	8.04%	0.84%	1.10%	-0.03%
过去三个月	19.12%	1.02%	15.47%	1.08%	3.65%	-0.06%
过去六个月	15.20%	1.64%	10.84%	1.70%	4.36%	-0.06%
过去一年	26.00%	1.32%	17.63%	1.39%	8.37%	-0.07%
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至	9.27%	1.42%	-1.34%	1.49%	10.61%	-0.07%

华宝中证 500 增强 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	9.11%	0.81%	8.04%	0.84%	1.07%	-0.03%
过去三个月	19.01%	1.02%	15.47%	1.08%	3.54%	-0.06%
过去六个月	14.99%	1.64%	10.84%	1.70%	4.15%	-0.06%
过去一年	25.50%	1.32%	17.63%	1.39%	7.87%	-0.07%
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至	8.32%	1.42%	-1.34%	1.49%	9.66%	-0.07%

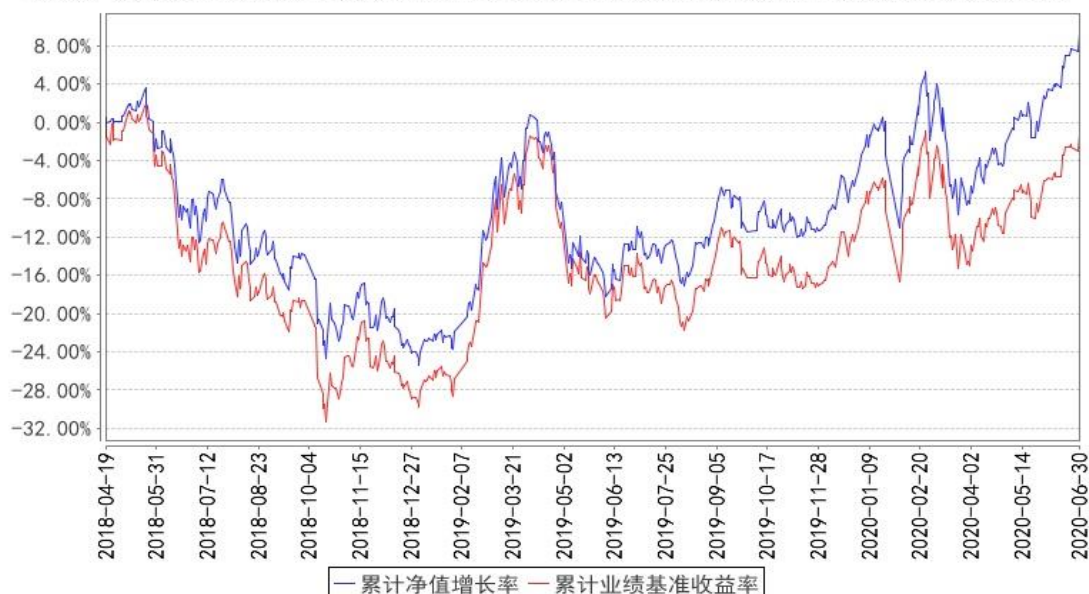
注：1、净值以及比较基准相关数据计算中涉及天数的，包括所有交易日以及季末最后一自然日（如非交易日）。

2、本基金业绩比较基准为：中证 500 指数收益率*95%+银行活期存款利率(税后)*5%。

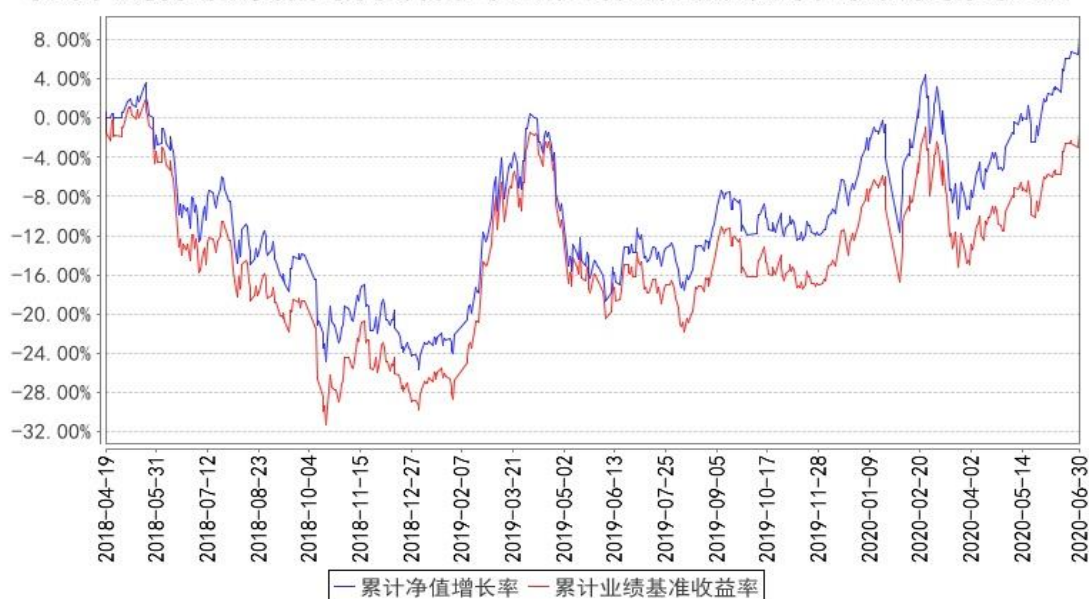
3、本基金成立于 2018 年 4 月 19 日。

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

华宝中证500增强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



华宝中证500增强C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：按照基金合同的约定，自基金成立日期的 6 个月内达到规定的资产组合，截至 2018 年 10 月 19 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

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（2020 年 6

月 30 日)，正在管理运作的证券投资基金分别为：华宝宝康债券投资基金、华宝宝康消费品证券投资基金、华宝宝康灵活配置证券投资基金、华宝多策略增长开放式证券投资基金、华宝现金宝货币市场基金、华宝动力组合混合型证券投资基金、华宝收益增长混合型证券投资基金、华宝先进成长混合型证券投资基金、华宝行业精选混合型证券投资基金、华宝海外中国成长混合型证券投资基金、华宝大盘精选混合型证券投资基金、华宝增强收益债券型证券投资基金、华宝中证 100 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、华宝上证 180 价值交易型开放式指数证券投资基金、华宝新兴产业混合型证券投资基金、华宝可转债债券型证券投资基金、华宝中证银行交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华宝标普石油天然气上游股票指数证券投资基金 (LOF)、华宝医药生物优选混合型证券投资基金、华宝资源优选混合型证券投资基金、华宝现金添益交易型货币市场基金、华宝服务优选混合型证券投资基金、华宝创新优选混合型证券投资基金、华宝生态中国混合型证券投资基金、华宝量化对冲策略混合型发起式证券投资基金、华宝高端制造股票型证券投资基金、华宝品质生活股票型证券投资基金、华宝稳健回报灵活配置混合型证券投资基金、华宝事件驱动混合型证券投资基金、华宝国策导向混合型证券投资基金、华宝中证医疗指数分级证券投资基金、华宝新价值灵活配置混合型证券投资基金、华宝中证 1000 指数分级证券投资基金、华宝新机遇灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)、华宝万物互联灵活配置混合型证券投资基金、华宝转型升级灵活配置混合型证券投资基金、华宝核心优势灵活配置混合型证券投资基金、华宝标普美国品质消费股票指数证券投资基金 (LOF)、华宝标普香港上市中国中小盘指数证券投资基金 (LOF)、华宝中证军工交易型开放式指数证券投资基金、华宝中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金、华宝新活力灵活配置混合型证券投资基金、华宝未来主导产业灵活配置混合型证券投资基金、华宝沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金、华宝新起点灵活配置混合型证券投资基金、华宝标普中国 A 股红利机会指数证券投资基金 (LOF)、华宝新飞跃灵活配置混合型证券投资基金、华宝新优选一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、华宝港股通恒生中国 (香港上市) 25 指数证券投资基金 (LOF)、华宝智慧产业灵活配置混合型证券投资基金、华宝第三产业灵活配置混合型证券投资基金、华宝中证银行交易型开放式指数证券投资基金、华宝价值发现混合型证券投资基金、华宝港股通恒生香港 35 指数证券投资基金 (LOF)、华宝中证 500 指数增强型发起式证券投资基金、华宝港股通香港精选混合型证券投资基金、华宝中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、华宝宝丰高等级债券型发起式证券投资基金、华宝绿色主题混合型证券投资基金、华宝标普沪港深中国增强价值指数证券投资基金 (LOF)、华宝标普中国 A 股质量价值指数证券投资基金 (LOF)、华宝科技先锋混合型证券投资基金、华宝大健康混合型证券投资基金、华宝中短债债券型发起式证券投资基金、华宝宝

裕纯债债券型证券投资基金、华宝稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、华宝中证医疗交易型开放式指数证券投资基金、华宝宝盛纯债债券型证券投资基金、华宝消费升级混合型证券投资基金、华宝宝怡纯债债券型证券投资基金、华宝中证科技龙头交易型开放式指数证券投资基金、华宝 MSCI 中国 A 股国际通 ESG 通用指数证券投资基金（LOF）、华宝中证科技龙头交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、华宝浮动净值型发起式货币市场基金、华宝政策性金融债债券型证券投资基金、华宝绿色领先股票型证券投资基金、华宝宝润纯债债券型证券投资基金、华宝致远混合型证券投资基金（QDII）、华宝宝惠纯债 39 个月定期开放债券型证券投资基金、华宝中证消费龙头指数证券投资基金（LOF）、华宝成长策略混合型证券投资基金、华宝红利精选混合型证券投资基金。

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		
丰晨成	本基金基金经理、上证 180 价值 ETF、华宝上证 180 价值 ETF 联接、华宝中证全指证券公司 ETF、华宝券商 ETF 联接、华宝中证 1000 指数分级基金经理	2018 年 4 月 19 日	-	10	硕士。2009 年加入华宝基金管理有限公司，先后担任助理产品经理、数量分析师、投资经理助理、投资经理、基金经理等职务。2015 年 11 月起任上证 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。2016 年 8 月起任华宝中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2018 年 4 月起任华宝中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金经理。2018 年 6 月起任华宝中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理。2018 年 8 月起任华宝中证 1000 指数分级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、证券从业含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》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、《华宝中证 500 指数增强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，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

中证 500 指数增强基金运用量化选股模型和行业配置模型进行股票筛选和权重配置，精选具有合理估值的高成长性股票，在跟踪中证 500 指数的基础上力争实现稳定的超越指数的表现。2020 年一季度，A 股市场受到国内和国外疫情的影响出现了波动，二季度市场在宏观政策呵护，经济生活逐步恢复正常下，市场逐渐振荡走强，以中证 500 为代表的中小市值指数表现较好，报告期内本基金表现相对基准指数取得了一定的超额收益。

本报告期为基金的正常运作期，在操作中，我们遵守基金合同，按照既定的量化投资策略，应对成分股调整和基金申购赎回，通过个股选择和行业配置等多种手段努力争取超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金份额 A 净值增长率为 15.20%；本报告期基金份额 C 净值增长率为 14.99%；同期业绩比较基准收益率为 10.84%。

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，尽管国内疫情可能会有反复，国际政治局势复杂多变、中美大国博弈、进出口形势不稳定等风险点相互交织，局势复杂多变，作为一个经济总量大、基础设施健全、腹地广阔的大国，自身的稳态调节机制能应对外部的风险，宏观经济抵御内外风险的韧性仍在。我们秉持 GARP 选股逻辑，通过量化方法克服恐惧心理，同时也根据运行期的累计表现和经验不断研究改进现有模型的途径方法，力争保持模型的稳定性的同时也提高其获取超额收益的水平。未来，我们认为中证 500 指数作为中盘股的基准指数，仍有较好的中期配置价值。

作为基金的管理人，我们将继续遵守基金合同，按照既定的量化投资策略，应对成分股调整和基金申购赎回，通过个股选择和行业配置等多种手段努力争取超额收益。

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。

（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

本基金为发起式基金,基金合同于 2018 年 4 月 19 日生效,基金管理人于 2018 年 4 月 17 日运用固有资金作为发起资金认购本基金,且承诺持有期限自本基金合同生效之日起不少于 3 年。

根据本基金基金合同的规定:基金合同生效日起三年后的对应日,若基金资产规模低于 2 亿元,本基金应当按照基金合同约定的程序进行清算并终止,且不得通过召开基金份额持有人大会的方式延续。基金合同生效三年后继续存续的,基金存续期内,连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于五千万元情形的,基金管理人应当在定期报告中予以披露;连续 60 个工作日出现前述情形之一的,基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案,如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等,并召开基金份额持有人大会进行表决。

截止 2020 年 6 月 30 日,本基金基金合同生效未满三年,基金管理人暂无需对基金持有人数或基金资产净值进行预警说明。

§ 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,中国民生银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金

法》及其他法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，依法安全保管了基金财产，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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，按照相关法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，本托管人对本基金的投资运作方面进行了监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人复核审查的本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、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：华宝中证 500 指数增强型发起式证券投资基金

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	2,873,156.03	2,943,083.21
结算备付金		129,642.37	382,834.35
存出保证金		11,539.44	18,713.79
交易性金融资产	6.4.7.2	34,667,683.37	41,402,226.72
其中：股票投资		34,667,683.37	41,402,226.72
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		-	20,389.60
应收利息	6.4.7.5	306.91	800.36
应收股利		-	-

应收申购款		341,249.76	399,004.48
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		38,023,577.88	45,167,052.51
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 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		137,117.69	20,521.08
应付赎回款		676,014.60	803,326.12
应付管理人报酬		29,852.00	37,272.75
应付托管费		3,582.23	4,472.72
应付销售服务费		4,025.93	5,021.42
应付交易费用	6.4.7.7	85,761.19	69,152.53
应交税费		-	88.73
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	45,427.04	80,724.38
负债合计		981,780.68	1,020,579.73
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	33,998,739.20	46,649,885.15
未分配利润	6.4.7.10	3,043,058.00	-2,503,412.37
所有者权益合计		37,041,797.20	44,146,472.78
负债和所有者权益总计		38,023,577.88	45,167,052.51

6.2 利润表

会计主体：华宝中证 500 指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
一、收入		6,122,223.37	5,267,923.21
1. 利息收入		9,494.67	14,703.75
其中：存款利息收入	6.4.7.11	9,494.67	14,703.75
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			
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		5,162,461.09	4,396,897.50
其中：股票投资收益	6.4.7.12	4,892,095.72	3,894,053.18
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资	6.4.7.13.5	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	132,233.01
股利收益	6.4.7.16	270,365.37	370,611.31
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	904,831.87	819,668.53
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	45,435.74	36,653.43
减：二、费用		581,751.43	734,674.13
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	191,978.08	189,776.15
2. 托管费	6.4.10.2.2	23,037.34	22,773.16
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	25,679.42	25,106.93
4. 交易费用	6.4.7.19	285,251.47	442,415.81
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	436.37
7. 其他费用	6.4.7.20	55,805.12	54,165.71
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		5,540,471.94	4,533,249.08
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		5,540,471.94	4,533,249.08

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华宝中证 500 指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 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)	46,649,885.15	-2,503,412.37	44,146,472.78
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	5,540,471.94	5,540,471.94
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)	-12,651,145.95	5,998.43	-12,645,147.52
其中：1. 基金申购款	22,070,899.94	-441,561.57	21,629,338.37
2. 基金赎回款	-34,722,045.89	447,560.00	-34,274,485.89
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(基金净值)	33,998,739.20	3,043,058.00	37,041,797.20
项目	上年度可比期间 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)	42,343,581.88	-10,173,482.92	32,170,098.96
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	4,533,249.08	4,533,249.08
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)	5,805,629.64	-820,121.54	4,985,508.10
其中：1. 基金申购款	28,380,065.56	-3,468,293.04	24,911,772.52
2. 基金赎回款	-22,574,435.92	2,648,171.50	-19,926,264.42
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（基金净值）	48,149,211.52	-6,460,355.38	41,688,856.14

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：

黄小薏

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

华宝中证 500 指数增强型发起式证券投资基金(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》、《华宝中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》(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]15 号文批准公开募集。本基金为契约型开放式、发起式基金,存续期限为不定期,首次设立募集基金份额为 55,157,340.21 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 00004 号的验资报告。基金合同于 2018 年 4 月 19 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,基金托管人为中国民生银行股份有限公司。

根据基金合同相关规定,本基金根据认购费、申购费、销售服务费收取方式不同,将基金份额分为不同类别,即 A 类基金份额(以下简称“华宝中证 500 增强 A”)和 C 类基金份额(以下简称“华宝中证 500 增强 C”)两类份额。其中,华宝中证 500 增强 A 是指在投资人认购/申购基金时收取认购/申购费用的基金份额类别;华宝中证 500 增强 C 是指在投资人认购/申购时不收取认购/申购费用,而是从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额类别。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《华宝中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》和《华宝中证 500 指数增强型发起式证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金的投资范围主要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(包括国内依法发行和上市交易的国债、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)、货币市

场工具、权证、资产支持证券、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:本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产的 80%,其中投资于中证 500 指数成分股及备选成分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%。本基金投资股指期货、权证及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准为:中证 500 指数收益率*95%+银行活期存款利率(税后)*5%。

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 2020 年 8 月 31 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)和在财务报表附注所列示依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。同时,对于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修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度和中期度报告>》、其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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于 2020 年 6 月 30 日的财务状况以及 2020 年上半年的经营成果和净值变动情况。

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

—

6.4.5.2 会计估计变更的说明

—

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

(1) 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

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》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

(2) 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（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、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《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》的规定，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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，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，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。

（3） 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011 年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

（4） 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（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、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

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》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，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，暂不征收企业所得税。

（5） 个人所得税

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》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《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》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金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，暂减按 25% 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；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《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》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

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 2020 年 6 月 30 日
活期存款	2,873,156.03
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	2,873,156.03

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	31,014,251.46	34,667,683.37	3,653,431.91
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	31,014,251.46	34,667,683.37	3,653,431.91

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 2020 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	242.52
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	58.40
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	0.89
应收黄金合约拆借孳息	—
应收出借证券利息	—
其他	5.10
合计	306.91

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 2020 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	85,761.19
银行间市场应付交易费用	—
合计	85,761.19

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2020 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	619.54
应付证券出借违约金	-
预提费用	34,807.50
应付指数使用费	10,000.00
合计	45,427.04

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

华宝中证 500 增强 A

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	31,232,018.04	31,232,018.04
本期申购	7,417,480.27	7,417,480.27
本期赎回（以“-”号填列）	-16,171,065.88	-16,171,065.88
-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	22,478,432.43	22,478,432.43

华宝中证 500 增强 C

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	15,417,867.11	15,417,867.11
本期申购	14,653,419.67	14,653,419.67
本期赎回（以“-”号填列）	-18,550,980.01	-18,550,980.01
-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	11,520,306.77	11,520,306.77

注：申购含红利再投以及转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

华宝中证 500 增强 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-2,158,836.81	548,978.42	-1,609,858.39
本期利润	3,131,258.62	555,777.24	3,687,035.86

本期基金份额 交易产生的变 动数	216,817.33	-209,528.33	7,289.00
其中：基金申 购款	-144,232.66	38,039.71	-106,192.95
基金赎 回款	361,049.99	-247,568.04	113,481.95
本期已分配利 润	-	-	-
本期末	1,189,239.14	895,227.33	2,084,466.47
华宝中证 500 增强 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-1,160,400.50	266,846.52	-893,553.98
本期利润	1,504,381.45	349,054.63	1,853,436.08
本期基金份额 交易产生的变 动数	161,438.64	-162,729.21	-1,290.57
其中：基金申 购款	-329,258.45	-6,110.17	-335,368.62
基金赎 回款	490,697.09	-156,619.04	334,078.05
本期已分配利 润	-	-	-
本期末	505,419.59	453,171.94	958,591.53

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	8,205.30
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	1,065.41
其他	223.96
合计	9,494.67

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	4,892,095.72
股票投资收益——赎回差价收入	-

股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	4,892,095.72

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	98,825,751.15
减：卖出股票成本总额	93,933,655.43
买卖股票差价收入	4,892,095.72

6.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

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

本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无债券投资收益。

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

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

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

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	270,365.37
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	270,365.37

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	904,831.87
股票投资	904,831.87
债券投资	—

资产支持证券投资	-
基金投资	-
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	904,831.87

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	41,902.77
基金转换费收入	3,532.97
合计	45,435.74

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	285,251.47
银行间市场交易费用	-
合计	285,251.47

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
审计费用	9,944.48
信息披露费	24,863.02
证券出借违约金	-
银行费用	997.62
指数使用费	20,000.00
合计	55,805.12

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	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国民生银行股份有限公司(“中国民生银行”)	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
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
华宝证券有限责任公司(“华宝证券”)	受宝武集团控制的公司
华宝投资有限公司(“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(“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

本基金本期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本期及上年度可比期间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

本基金本期及上年度可比期间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

本基金本报告期及上年度可比期间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

本基金本期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易。

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 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 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	191,978.08	189,776.15
其中：支付销售机构的客户维护费	56,535.41	51,453.78

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 1.0%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 X 1.0% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 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	23,037.34	22,773.16

注：支付基金托管人中国民生银行的托管费按前一日基金资产净值 0.12%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 X 0.12% / 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	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
-------------	---------------------------------------

方名称	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华宝中证 500 增强 A	华宝中证 500 增强 C	合计
华宝基金	—	1,938.41	1,938.41
民生银行	—	5,406.06	5,406.06
华宝证券	—	7,073.32	7,073.32
合计	—	14,417.79	14,417.79
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	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		
	华宝中证 500 增强 A	华宝中证 500 增强 C	合计
华宝基金	—	3,654.20	3,654.20
民生银行	—	6,125.67	6,125.67
华宝证券	—	8,649.14	8,649.14
合计	—	18,429.01	18,429.01

注：支付基金销售机构的基金销售服务费按前一日基金资产净值的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给华宝基金，再由华宝基金计算并支付给各基金销售机构。A 类基金份额持有人和 C 类基金份额持有人约定的年基金销售服务费率分别为 0.00% 和 0.40%。其计算公式为：

$$\text{日基金销售服务费} = \text{前一日基金资产净值} \times \text{约定年费率} / \text{当年天数}。$$

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

本基金本报告期及上年度可比期间无与关联方进行的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

本基金报告期及上年度可比期间未发生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

本基金报告期及上年度可比期间未发生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

份额单位：份

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
	华宝中证 500 增强 A	华宝中证 500 增强 C
基金合同生效日（2018 年 4 月 19 日）持有的基金份额	—	—
报告期初持有的基金份额	10,000,450.05	—
报告期间申购/买入总份额	—	—
报告期间因拆分变动份额	—	—
减：报告期间赎回/卖出总份额	—	—
报告期末持有的基金份额	10,000,450.05	—
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	44.49%	—
项目	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
	华宝中证 500 增强 A	华宝中证 500 增强 C
基金合同生效日（2018 年 4 月 19 日）持有的基金份额	—	—
报告期初持有的基金份额	10,000,450.05	—
报告期间申购/买入总份额	—	—
报告期间因拆分变动份额	—	—
减：报告期间赎回/卖出总份额	—	—
报告期末持有的基金份额	10,000,450.05	—
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	31.48%	—

注：基金管理人投资本基金适用的认（申）购/赎回费率按照本基金招募说明书的规定执行。

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

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人以外的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 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 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
中国民生银行股份有限公司	2,873,156.03	8,205.30	2,486,267.24	12,237.45

注：本基金的银行存款由基金托管人中国民生银行保管，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

本基金本期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(2020 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	可流通日	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
002500	山西证券	2020 年 6 月 29 日	2020 年 07 月 10 日	配股流通受限	5.00	6.54	6,510	32,550.00	42,575.40	-
300840	酷特智能	2020 年 6 月 30 日	2020 年 07 月 08 日	新股流通受限	5.94	5.94	675	4,009.50	4,009.50	-
300843	胜蓝股份	2020 年 6 月 23 日	2020 年 7 月 2 日	新股流通受限	10.01	10.01	639	6,396.39	6,396.39	-
300845	捷安高	2020 年	2020 年	新股流	17.63	17.63	298	5,253.74	5,253.74	-

	科	6 月 24 日	07 月 03 日	通受限						
300846	首都在线	2020 年 6 月 22 日	2020 年 7 月 1 日	新股流 通受限	3.37	3.37	1,131	3,811.47	3,811.47	-

注：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。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。此外，基金还可作为特定投资者，认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末 估值单 价	复牌日期	复牌 开盘单价	数量 (股)	期末 成本总额	期末 估值总额	备注
601880	大连港	2020 年 6 月 22 日	重大事项停牌	1.72	2020 年 07 月 08 日	1.87	12,000	21,000.00	20,640.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本期末无银行间市场债券正回购，因此没有在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

本基金本报告期内未发生转融通证券出借业务。

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

本基金为指数增强型基金，在实现对中证 500 指数有效跟踪的基础上，通过数量化的方法

进行积极的组合配置和管理，力争实现超越标的指数的投资收益。本基金属于高预期风险、高预期收益的证券投资基金品种，其预期风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资、股指期货等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，公司内部监督和反馈系统包括内部控制委员会、督察长、合规审计部、风险管理部、各部门负责人和风险控制联络人、各业务岗位。内部控制委员会负责对公司经营管理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。

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。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

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，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公司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。

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，主要包括利率风险、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。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算

备付金、存出保证金等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020 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	2,873,156.03	-	-	-	2,873,156.03
结算备付金	129,642.37	-	-	-	129,642.37
存出保证金	11,539.44	-	-	-	11,539.44
交易性金融资产	-	-	-	34,667,683.37	34,667,683.37
应收利息	-	-	-	306.91	306.91
应收申购款	4,262.47	-	-	336,987.29	341,249.76
资产总计	3,018,600.31	-	-	35,004,977.57	38,023,577.88
负债					
应付赎回款	-	-	-	676,014.60	676,014.60
应付管理人报酬	-	-	-	29,852.00	29,852.00
应付托管费	-	-	-	3,582.23	3,582.23
应付证券清算款	-	-	-	137,117.69	137,117.69
应付销售服务费	-	-	-	4,025.93	4,025.93
应付交易费用	-	-	-	85,761.19	85,761.19
其他负债	-	-	-	45,427.04	45,427.04
负债总计	-	-	-	981,780.68	981,780.68
利率敏感度缺口	3,018,600.31	-	-	34,023,196.89	37,041,797.20
上年度末 2019 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	2,943,083.21	-	-	-	2,943,083.21
结算备付金	382,834.35	-	-	-	382,834.35
存出保证金	18,713.79	-	-	-	18,713.79
交易性金融资产	-	-	-	41,402,226.72	41,402,226.72
应收利息	-	-	-	800.36	800.36
应收申购款	20,837.50	-	-	378,166.98	399,004.48
应收证券清算款	-	-	-	20,389.60	20,389.60
资产总计	3,365,468.85	-	-	41,801,583.66	45,167,052.51
负债					
应付赎回款	-	-	-	803,326.12	803,326.12
应付管理人报酬	-	-	-	37,272.75	37,272.75
应付托管费	-	-	-	4,472.72	4,472.72
应付证券清算款	-	-	-	20,521.08	20,521.08
应付销售服务费	-	-	-	5,021.42	5,021.42
应付交易费用	-	-	-	69,152.53	69,152.53

应交税费	-	-	-	88.73	88.73
其他负债	-	-	-	80,724.38	80,724.38
负债总计	-	-	-	1,020,579.73	1,020,579.73
利率敏感度缺口	3,365,468.85	-	-	40,781,003.93	44,146,472.78

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：投资于股票资产的比例不低于基金资产的 80%，其中投资于中证 500 指数成分股及备选成分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%。本基金投资股指期货、权证及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。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 2020 年 6 月 30 日		上年度末 2019 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	34,667,683.37	93.59	41,402,226.72	93.78
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	34,667,683.37	93.59	41,402,226.72	93.78

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		
	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(2020 年 6 月 30 日)	上年度末(2019 年 12 月 31 日)
分析	业绩比较基准上升 5%	1,757,587.35	2,067,613.08
	业绩比较基准下降 5%	-1,757,587.35	-2,067,613.08

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

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银行存款、结算备付金、存出保证金、应收申购款、应收利息以及其他金融负债，因其剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

(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且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币 34,584,996.87 元，属于第二层次的余额为人民币 82,686.5 元，无划分为第三层次余额（于上年度末，属于第一层次的余额为人民币 41,395,648.68 元，属于第二层次的余额为人民币 6,578.04 元，无划分为第三层次余额）。

(ii) 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。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具第三层次公允价值本期未发生变动。

(2) 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大承诺事项。

(3) 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的其他重要事项。

§ 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	34,667,683.37	91.17
	其中：股票	34,667,683.37	91.17

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	3,002,798.40	7.90
8	其他各项资产	353,096.11	0.93
9	合计	38,023,577.88	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	227,856.00	0.62
B	采矿业	476,427.50	1.29
C	制造业	17,102,166.90	46.17
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	498,056.60	1.34
E	建筑业	418,976.00	1.13
F	批发和零售业	1,090,220.20	2.94
G	交通运输、仓储和邮政业	469,887.00	1.27
H	住宿和餐饮业	85,259.00	0.23
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,560,040.60	9.61
J	金融业	1,532,083.40	4.14
K	房地产业	1,223,459.00	3.30
L	租赁和商务服务业	509,646.00	1.38
M	科学研究和技术服务业	258,856.00	0.70
N	水利、环境和公共设施管理业	401,486.00	1.08
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	152,150.00	0.41
R	文化、体育和娱乐业	635,538.00	1.72
S	综合	150,627.00	0.41

	合计	28,792,735.20	77.73
--	----	---------------	-------

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	159,102.00	0.43
C	制造业	4,085,800.90	11.03
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	120,650.96	0.33
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	301,636.00	0.81
G	交通运输、仓储和邮政业	122,293.00	0.33
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	323,943.21	0.87
J	金融业	280,752.00	0.76
K	房地产业	73,926.00	0.20
L	租赁和商务服务业	22,250.00	0.06
M	科学研究和技术服务业	122,463.60	0.33
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	229,606.50	0.62
R	文化、体育和娱乐业	32,524.00	0.09
S	综合	-	-
	合计	5,874,948.17	15.86

7.2.3 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

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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	002821	凯莱英	1,600	388,800.00	1.05
2	300253	卫宁健康	14,690	336,988.60	0.91
3	002127	南极电商	15,800	334,486.00	0.90

4	300558	贝达药业	2,200	307,956.00	0.83
5	002340	格林美	57,800	287,266.00	0.78
6	002385	大北农	31,000	282,410.00	0.76
7	603444	吉比特	500	274,505.00	0.74
8	300012	华测检测	13,100	258,856.00	0.70
9	601128	常熟银行	33,400	250,834.00	0.68
10	600739	辽宁成大	13,100	247,983.00	0.67
11	002353	杰瑞股份	7,800	241,800.00	0.65
12	300315	掌趣科技	32,400	237,492.00	0.64
13	002174	游族网络	9,100	237,328.00	0.64
14	300496	中科创达	3,000	233,100.00	0.63
15	601799	星宇股份	1,800	228,600.00	0.62
16	600143	金发科技	17,200	226,524.00	0.61
17	000513	丽珠集团	4,600	220,846.00	0.60
18	300212	易华录	3,900	218,400.00	0.59
19	600521	华海药业	6,340	215,116.20	0.58
20	600529	山东药玻	3,700	214,600.00	0.58
21	600486	扬农化工	2,600	214,500.00	0.58
22	002595	豪迈科技	11,000	214,060.00	0.58
23	600201	生物股份	7,650	212,976.00	0.57
24	603712	七一二	5,500	211,090.00	0.57
25	600801	华新水泥	8,900	211,019.00	0.57
26	000050	深天马 A	13,700	210,432.00	0.57
27	601865	福莱特	10,800	203,040.00	0.55
28	002075	沙钢股份	16,100	201,250.00	0.54
29	603707	健友股份	3,100	200,167.00	0.54
30	300357	我武生物	3,200	199,200.00	0.54
31	002373	千方科技	8,300	199,117.00	0.54
32	300274	阳光电源	13,700	197,143.00	0.53
33	601099	太平洋	62,000	196,540.00	0.53
34	600161	天坛生物	4,260	193,105.80	0.52
35	603517	绝味食品	2,700	190,998.00	0.52
36	000887	中鼎股份	24,300	190,755.00	0.51
37	600549	厦门钨业	16,100	190,624.00	0.51
38	002223	鱼跃医疗	5,200	189,280.00	0.51
39	600298	安琪酵母	3,800	188,024.00	0.51
40	600426	华鲁恒升	10,500	185,640.00	0.50
41	002500	山西证券	28,210	184,493.40	0.50
42	002131	利欧股份	47,500	183,350.00	0.49
43	002013	中航机电	23,000	181,700.00	0.49
44	002439	启明星辰	4,300	180,901.00	0.49
45	002078	太阳纸业	19,000	180,880.00	0.49

46	000807	云铝股份	40,700	177,452.00	0.48
47	002465	海格通信	13,600	175,984.00	0.48
48	002557	洽洽食品	3,200	173,408.00	0.47
49	002368	太极股份	3,900	170,391.00	0.46
50	600804	鹏博士	18,700	167,926.00	0.45
51	601689	拓普集团	6,000	167,400.00	0.45
52	002901	大博医疗	1,400	167,006.00	0.45
53	300166	东方国信	13,200	163,812.00	0.44
54	002185	华天科技	12,000	162,360.00	0.44
55	002414	高德红外	5,460	159,868.80	0.43
56	600410	华胜天成	11,700	159,120.00	0.43
57	000739	普洛药业	6,700	156,043.00	0.42
58	600216	浙江医药	8,100	156,006.00	0.42
59	002583	海能达	20,500	155,595.00	0.42
60	300618	寒锐钴业	2,500	155,050.00	0.42
61	600153	建发股份	19,100	154,710.00	0.42
62	600598	北大荒	9,600	154,560.00	0.42
63	603882	金域医学	1,700	152,150.00	0.41
64	601233	桐昆股份	11,900	151,844.00	0.41
65	000009	中国宝安	17,700	150,627.00	0.41
66	002064	华峰氨纶	29,300	148,551.00	0.40
67	600642	申能股份	25,000	147,750.00	0.40
68	300017	网宿科技	17,200	146,028.00	0.39
69	300113	顺网科技	5,700	144,780.00	0.39
70	300133	华策影视	19,900	144,275.00	0.39
71	600415	小商品城	29,600	144,152.00	0.39
72	000826	启迪环境	19,400	143,948.00	0.39
73	603228	景旺电子	4,080	143,575.20	0.39
74	300630	普利制药	1,900	140,505.00	0.38
75	002217	合力泰	26,600	139,650.00	0.38
76	002925	盈趣科技	2,400	139,056.00	0.38
77	603866	桃李面包	2,700	137,403.00	0.37
78	300285	国瓷材料	4,100	137,391.00	0.37
79	600079	人福医药	5,000	136,100.00	0.37
80	300088	长信科技	12,100	135,520.00	0.37
81	000750	国海证券	31,000	134,540.00	0.36
82	000988	华工科技	5,500	134,365.00	0.36
83	000999	华润三九	4,600	134,274.00	0.36
84	002242	九阳股份	3,600	134,172.00	0.36
85	002511	中顺洁柔	5,900	131,570.00	0.36
86	002203	海亮股份	14,900	130,375.00	0.35
87	600500	中化国际	25,500	129,030.00	0.35

88	002028	思源电气	6,300	128,898.00	0.35
89	600649	城投控股	21,700	128,898.00	0.35
90	002690	美亚光电	2,400	126,240.00	0.34
91	300316	晶盛机电	5,100	126,174.00	0.34
92	600120	浙江东方	18,300	125,721.00	0.34
93	600273	嘉化能源	14,200	124,108.00	0.34
94	002244	滨江集团	29,000	123,830.00	0.33
95	600325	华发股份	17,500	123,550.00	0.33
96	000543	皖能电力	30,700	123,414.00	0.33
97	002920	德赛西威	2,000	122,660.00	0.33
98	002191	劲嘉股份	13,600	121,176.00	0.33
99	000778	新兴铸管	35,200	120,736.00	0.33
100	600064	南京高科	12,300	119,556.00	0.32
101	601615	明阳智能	9,600	119,520.00	0.32
102	002085	万丰奥威	18,200	117,936.00	0.32
103	002589	瑞康医药	22,000	117,920.00	0.32
104	000686	东北证券	13,900	117,455.00	0.32
105	300115	长盈精密	5,100	116,535.00	0.31
106	300376	易事特	22,400	116,480.00	0.31
107	002152	广电运通	9,000	116,460.00	0.31
108	603556	海兴电力	8,000	115,520.00	0.31
109	600380	健康元	7,100	115,304.00	0.31
110	002156	通富微电	4,600	115,230.00	0.31
111	600039	四川路桥	29,700	113,454.00	0.31
112	002080	中材科技	7,300	113,150.00	0.31
113	002273	水晶光电	6,600	113,124.00	0.31
114	601966	玲珑轮胎	5,600	113,120.00	0.31
115	002387	维信诺	7,800	111,384.00	0.30
116	600580	卧龙电驱	9,900	111,276.00	0.30
117	600737	中粮糖业	14,300	111,254.00	0.30
118	000400	许继电气	8,400	110,880.00	0.30
119	600704	物产中大	26,300	110,723.00	0.30
120	300168	万达信息	5,000	110,350.00	0.30
121	002507	涪陵榨菜	3,000	108,030.00	0.29
122	603816	顾家家居	2,400	108,024.00	0.29
123	000967	盈峰环境	13,000	107,250.00	0.29
124	600348	阳泉煤业	25,200	106,344.00	0.29
125	000878	云南铜业	10,000	106,100.00	0.29
126	600373	中文传媒	9,000	106,020.00	0.29
127	603317	天味食品	1,905	105,879.90	0.29
128	600282	南钢股份	32,600	105,298.00	0.28
129	600967	内蒙一机	10,100	104,939.00	0.28

130	600125	铁龙物流	18,800	104,904.00	0.28
131	601168	西部矿业	18,000	104,400.00	0.28
132	600266	城建发展	20,400	103,428.00	0.28
133	002419	天虹股份	10,600	101,230.00	0.27
134	300002	神州泰岳	16,300	100,897.00	0.27
135	002074	国轩高科	3,700	99,308.00	0.27
136	600062	华润双鹤	7,500	99,150.00	0.27
137	600657	信达地产	24,000	98,880.00	0.27
138	600633	浙数文化	10,100	98,778.00	0.27
139	000547	航天发展	7,200	98,424.00	0.27
140	600909	华安证券	14,400	98,352.00	0.27
141	600823	世茂股份	22,000	98,340.00	0.27
142	601200	上海环境	8,000	96,000.00	0.26
143	600195	中牧股份	5,800	94,134.00	0.25
144	000932	华菱钢铁	24,700	93,119.00	0.25
145	601000	唐山港	41,600	92,768.00	0.25
146	002807	江阴银行	23,600	92,748.00	0.25
147	000488	晨鸣纸业	18,700	92,378.00	0.25
148	600155	华创阳安	7,700	92,323.00	0.25
149	600885	宏发股份	2,300	92,276.00	0.25
150	000559	万向钱潮	18,900	91,476.00	0.25
151	000563	陕国投 A	24,200	89,782.00	0.24
152	002670	国盛金控	9,800	89,670.00	0.24
153	000581	威孚高科	4,300	88,924.00	0.24
154	600765	中航重机	8,600	87,892.00	0.24
155	002648	卫星石化	5,300	86,231.00	0.23
156	000983	西山煤电	22,750	85,312.50	0.23
157	002653	海思科	3,200	85,152.00	0.23
158	603338	浙江鼎力	1,120	84,862.40	0.23
159	002138	顺络电子	3,400	84,830.00	0.23
160	000537	广宇发展	11,500	83,950.00	0.23
161	300459	金科文化	24,300	83,835.00	0.23
162	300595	欧普康视	1,200	83,208.00	0.22
163	603659	璞泰来	800	82,416.00	0.22
164	600017	日照港	32,900	81,921.00	0.22
165	600820	隧道股份	14,200	80,230.00	0.22
166	600316	洪都航空	5,000	79,000.00	0.21
167	002081	金螳螂	10,000	78,600.00	0.21
168	000681	视觉中国	4,200	78,204.00	0.21
169	603233	大参林	960	77,971.20	0.21
170	603806	福斯特	1,560	77,859.60	0.21
171	000027	深圳能源	16,440	76,281.60	0.21

172	000960	锡业股份	8,800	75,328.00	0.20
173	002709	天赐材料	2,200	74,338.00	0.20
174	600056	中国医药	5,200	73,580.00	0.20
175	601801	皖新传媒	13,200	73,392.00	0.20
176	002458	益生股份	4,800	73,296.00	0.20
177	600970	中材国际	13,600	71,808.00	0.19
178	002831	裕同科技	2,600	71,526.00	0.19
179	600751	海航科技	22,500	70,425.00	0.19
180	600875	东方电气	7,900	69,915.00	0.19
181	600827	百联股份	4,800	69,360.00	0.19
182	600022	山东钢铁	53,700	69,273.00	0.19
183	600782	新钢股份	16,500	67,320.00	0.18
184	600315	上海家化	1,400	67,060.00	0.18
185	002110	三钢闽光	10,000	66,600.00	0.18
186	002745	木林森	4,300	66,263.00	0.18
187	000401	冀东水泥	4,100	65,764.00	0.18
188	000997	新大陆	4,100	65,518.00	0.18
189	600717	天津港	14,400	63,648.00	0.17
190	603858	步长制药	2,200	63,470.00	0.17
191	600515	海航基础	12,200	63,440.00	0.17
192	600874	创业环保	9,500	63,080.00	0.17
193	600307	酒钢宏兴	40,800	62,832.00	0.17
194	600160	巨化股份	9,000	62,010.00	0.17
195	600256	广汇能源	22,900	61,830.00	0.17
196	600985	淮北矿业	7,900	61,541.00	0.17
197	002266	浙富控股	15,800	61,146.00	0.17
198	000012	南玻A	12,000	60,240.00	0.16
199	600643	爱建集团	7,500	59,625.00	0.16
200	600338	西藏珠峰	5,700	57,000.00	0.15
201	600572	康恩贝	10,300	56,650.00	0.15
202	600729	重庆百货	1,800	56,196.00	0.15
203	601333	广深铁路	24,900	56,025.00	0.15
204	000825	太钢不锈	16,800	55,776.00	0.15
205	600563	法拉电子	900	55,620.00	0.15
206	600094	大名城	9,300	55,335.00	0.15
207	603568	伟明环保	2,340	54,288.00	0.15
208	601718	际华集团	16,200	53,784.00	0.15
209	000883	湖北能源	14,600	51,392.00	0.14
210	600757	长江传媒	10,000	50,900.00	0.14
211	603355	莱克电气	2,000	49,780.00	0.13
212	600478	科力远	10,500	49,455.00	0.13
213	600258	首旅酒店	3,200	49,184.00	0.13

214	300418	昆仑万维	1,900	47,424.00	0.13
215	300182	捷成股份	11,700	46,683.00	0.13
216	601512	中新集团	4,000	46,000.00	0.12
217	300251	光线传媒	4,200	45,822.00	0.12
218	601098	中南传媒	4,300	45,494.00	0.12
219	600748	上实发展	8,800	44,968.00	0.12
220	601811	新华文轩	4,400	44,748.00	0.12
221	000090	天健集团	6,400	44,224.00	0.12
222	002019	亿帆医药	1,900	43,643.00	0.12
223	600376	首开股份	7,000	41,020.00	0.11
224	000031	大悦城	7,600	38,684.00	0.10
225	000898	鞍钢股份	14,800	36,260.00	0.10
226	000600	建投能源	7,100	36,139.00	0.10
227	600754	锦江酒店	1,300	36,075.00	0.10
228	300296	利亚德	5,900	35,813.00	0.10
229	600073	上海梅林	3,700	35,113.00	0.09
230	603983	丸美股份	400	34,412.00	0.09
231	000402	金融街	4,700	31,208.00	0.08
232	002010	传化智联	5,700	31,008.00	0.08
233	601975	招商南油	12,900	30,831.00	0.08
234	002375	亚厦股份	3,000	30,660.00	0.08
235	000930	中粮科技	4,400	30,052.00	0.08
236	603883	老百姓	300	30,012.00	0.08
237	600755	厦门国贸	4,500	29,700.00	0.08
238	600862	中航高科	1,700	28,764.00	0.08
239	300207	欣旺达	1,300	24,570.00	0.07
240	600694	大商股份	1,000	23,990.00	0.06
241	600639	浦东金桥	1,400	22,372.00	0.06
242	601880	大连港	12,000	20,640.00	0.06
243	601003	柳钢股份	4,600	20,378.00	0.06
244	000089	深圳机场	2,500	19,150.00	0.05

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

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	600031	三一重工	8,600	161,336.00	0.44
2	300529	健帆生物	2,220	154,290.00	0.42
3	600763	通策医疗	900	150,093.00	0.41
4	002773	康弘药业	2,800	138,880.00	0.37
5	002371	北方华创	800	136,728.00	0.37
6	002463	沪电股份	5,300	132,394.00	0.36

7	300308	中际旭创	2,000	126,000.00	0.34
8	002179	中航光电	3,000	123,030.00	0.33
9	601012	隆基股份	3,000	122,190.00	0.33
10	000858	五 粮 液	700	119,784.00	0.32
11	300033	同花顺	900	119,772.00	0.32
12	002049	紫光国微	1,500	109,125.00	0.29
13	000333	美的集团	1,800	107,622.00	0.29
14	600352	浙江龙盛	8,200	104,878.00	0.28
15	000776	广发证券	7,400	104,488.00	0.28
16	601100	恒立液压	1,300	104,260.00	0.28
17	002180	纳思达	3,100	102,021.00	0.28
18	600809	山西汾酒	700	101,500.00	0.27
19	600745	闻泰科技	800	100,760.00	0.27
20	002697	红旗连锁	9,100	99,372.00	0.27
21	601628	中国人寿	3,600	97,956.00	0.26
22	601872	招商轮船	16,400	95,612.00	0.26
23	600585	海螺水泥	1,700	89,947.00	0.24
24	603456	九洲药业	3,300	89,430.00	0.24
25	600299	安迪苏	7,100	86,762.00	0.23
26	600741	华域汽车	4,000	83,160.00	0.22
27	300015	爱尔眼科	1,830	79,513.50	0.21
28	002099	海翔药业	10,000	79,100.00	0.21
29	002812	恩捷股份	1,200	78,960.00	0.21
30	603708	家家悦	1,600	78,816.00	0.21
31	300319	麦捷科技	7,000	77,770.00	0.21
32	300699	光威复材	1,200	75,276.00	0.20
33	002384	东山精密	2,400	71,880.00	0.19
34	002182	云海金属	7,300	69,642.00	0.19
35	600547	山东黄金	1,900	69,578.00	0.19
36	002478	常宝股份	14,400	69,552.00	0.19
37	300481	濮阳惠成	3,600	69,408.00	0.19
38	000338	潍柴动力	5,000	68,600.00	0.19
39	002531	天顺风能	10,700	63,986.00	0.17
40	300258	精锻科技	6,000	63,180.00	0.17
41	600114	东睦股份	6,000	62,280.00	0.17
42	300607	拓斯达	1,440	58,593.60	0.16
43	603027	千禾味业	1,820	57,475.60	0.16
44	601933	永辉超市	6,100	57,218.00	0.15
45	600674	川投能源	6,000	55,620.00	0.15
46	002129	中环股份	2,400	53,904.00	0.15
47	603259	药明康德	540	52,164.00	0.14
48	002065	东华软件	4,000	50,080.00	0.14
49	300122	智飞生物	500	50,075.00	0.14

50	002032	苏 泊 尔	700	49,700.00	0.13
51	600988	赤峰黄金	4,100	48,790.00	0.13
52	603583	捷昌驱动	700	47,866.00	0.13
53	300383	光环新网	1,800	46,926.00	0.13
54	300365	恒华科技	4,300	43,860.00	0.12
55	300014	亿纬锂能	895	42,825.75	0.12
56	603060	国检集团	2,040	40,779.60	0.11
57	601808	中海油服	3,100	40,734.00	0.11
58	600705	中航资本	10,100	39,996.00	0.11
59	600612	老凤祥	800	38,552.00	0.10
60	600459	贵研铂业	1,200	35,772.00	0.10
61	601985	中国核电	8,600	35,174.00	0.09
62	000034	神州数码	1,400	34,076.00	0.09
63	300144	宋城演艺	1,880	32,524.00	0.09
64	603658	安图生物	200	32,488.00	0.09
65	300577	开润股份	1,200	32,364.00	0.09
66	002251	步 步 高	2,300	32,154.00	0.09
67	600536	中国软件	400	31,680.00	0.09
68	000977	浪潮信息	800	31,344.00	0.08
69	600048	保利地产	2,100	31,038.00	0.08
70	600104	上汽集团	1,800	30,582.00	0.08
71	300760	迈瑞医疗	100	30,570.00	0.08
72	002859	洁美科技	1,000	29,980.00	0.08
73	300548	博创科技	500	29,900.00	0.08
74	603609	禾丰牧业	2,000	29,800.00	0.08
75	300759	康龙化成	300	29,520.00	0.08
76	600660	福耀玻璃	1,400	29,218.00	0.08
77	002146	荣盛发展	3,200	25,920.00	0.07
78	601222	林洋能源	4,700	25,662.00	0.07
79	601633	长城汽车	3,300	25,476.00	0.07
80	002675	东诚药业	1,200	25,140.00	0.07
81	600452	涪陵电力	1,680	24,242.40	0.07
82	603118	共进股份	1,900	22,591.00	0.06
83	300352	北信源	3,200	22,560.00	0.06
84	300662	科锐国际	500	22,250.00	0.06
85	603313	梦百合	900	21,177.00	0.06
86	601238	广汽集团	2,300	20,700.00	0.06
87	600919	江苏银行	3,600	20,412.00	0.06
88	601818	光大银行	5,000	17,900.00	0.05
89	600690	海尔智家	1,000	17,700.00	0.05
90	000069	华侨城 A	2,800	16,968.00	0.05
91	001965	招商公路	2,500	16,825.00	0.05
92	605166	聚合顺	1,004	15,913.40	0.04

93	002202	金风科技	1,400	13,958.00	0.04
94	300842	帝科股份	319	12,989.68	0.04
95	603087	甘李药业	107	10,732.10	0.03
96	601006	大秦铁路	1,400	9,856.00	0.03
97	300839	博汇股份	368	8,614.88	0.02
98	300843	胜蓝股份	639	6,396.39	0.02
99	600956	新天绿能	1,114	5,614.56	0.02
100	300845	捷安高科	298	5,253.74	0.01
101	300840	酷特智能	675	4,009.50	0.01
102	300846	首都在线	1,131	3,811.47	0.01

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	002203	海亮股份	560,970.79	1.27
2	600216	浙江医药	511,535.00	1.16
3	600373	中文传媒	510,535.00	1.16
4	000878	云南铜业	504,959.00	1.14
5	603517	绝味食品	491,738.00	1.11
6	601233	桐昆股份	490,841.00	1.11
7	601865	福莱特	488,763.00	1.11
8	002925	盈趣科技	474,985.00	1.08
9	002745	木林森	455,604.00	1.03
10	002174	游族网络	455,514.00	1.03
11	300459	金科文化	437,264.00	0.99
12	000807	云铝股份	429,700.00	0.97
13	600673	东阳光	422,038.00	0.96
14	600273	嘉化能源	415,083.00	0.94
15	300418	昆仑万维	409,255.00	0.93
16	300115	长盈精密	408,870.00	0.93
17	002670	国盛金控	401,472.00	0.91
18	601811	新华文轩	392,041.00	0.89
19	600970	中材国际	384,856.67	0.87
20	600143	金发科技	377,959.00	0.86

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	600745	闻泰科技	621,382.00	1.41

2	600373	中文传媒	572,434.70	1.30
3	603517	绝味食品	567,387.00	1.29
4	300014	亿纬锂能	556,242.00	1.26
5	600763	通策医疗	550,781.00	1.25
6	601231	环旭电子	511,734.00	1.16
7	601811	新华文轩	500,625.00	1.13
8	002384	东山精密	472,788.00	1.07
9	600143	金发科技	470,571.76	1.07
10	600584	长电科技	459,306.00	1.04
11	000066	中国长城	450,782.00	1.02
12	000878	云南铜业	449,514.00	1.02
13	600273	嘉化能源	446,954.00	1.01
14	600073	上海梅林	446,799.69	1.01
15	000988	华工科技	444,967.00	1.01
16	000686	东北证券	443,055.00	1.00
17	300418	昆仑万维	428,545.00	0.97
18	600216	浙江医药	425,493.00	0.96
19	300459	金科文化	418,616.00	0.95
20	600325	华发股份	415,087.00	0.94

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	86,294,280.21
卖出股票收入（成交）总额	98,825,751.15

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

本基金本报告期末未投资股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金主要利用股指期货提高投资效率,以更好地实现本基金的投资目标,降低跟踪误差。此外,在预期大额申购赎回、大额分红等情形发生时,本基金可以通过股指期货进行有效的现金头寸管理。

本基金投资于股指期货,对基金总体风险的影响很小,并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 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 市场中性策略执行情况

7.13 投资组合报告附注

7.13.1

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。

7.13.2

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	11,539.44
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	306.91
5	应收申购款	341,249.76
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	353,096.11

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

7.13.5.1 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。

7.13.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五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	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

级别			持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
华宝中证 500 增强 A	1,337	16,812.59	10,000,450.05	44.49	12,477,982.38	55.51
华宝中证 500 增强 C	1,651	6,977.78	0	0.00	11,520,306.77	100.00
合计	2,988	11,378.43	10,000,450.05	29.41	23,998,289.15	70.59

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	华宝中证 500 增强 A	288,104.06	1.2817
	华宝中证 500 增强 C	64,142.25	0.5568
	合计	352,246.31	1.0361

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	华宝中证 500 增强 A	0
	华宝中证 500 增强 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	华宝中证 500 增强 A	0~10
	华宝中证 500 增强 C	0~10
	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	10,000,450.05	29.41	10,000,450.05	29.41	不少于三年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,000,450.05	29.41	10,000,450.05	29.41	-

注：1、本基金募集期间，本基金管理人运用固有资金作为发起资金总计 10,001,000.00 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 2018 年 4 月 16 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。符合基金合同和招募说明书等法律文件的约定。

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华宝中证 500 增强 A	华宝中证 500 增强 C
基金合同生效日 (2018 年 4 月 19 日) 基金份额总额	21,918,920.54	33,238,419.67
本报告期期初基金份额总额	31,232,018.04	15,417,867.11
本报告期基金总申购份额	7,417,480.27	14,653,419.67
减：本报告期基金总赎回份额	16,171,065.88	18,550,980.01
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	22,478,432.43	11,520,306.77

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

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

2020 年 5 月 20 日,基金管理人发布高级管理人员变更公告,经公司董事会审议通过,聘任周雷为公司督察长。公司总经理黄小慧自 2020 年 5 月 20 日起不再代任督察长职务。

2、报告期内基金托管人未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产和基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未发生变更。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

基金管理人为本基金聘任的会计师事务所向本基金提供的审计服务持续期限为:2019 年 11 月 20 日至本报告期末。

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	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	
东方证券	1	92,523,930.29	50.13%	84,317.16	49.58%	-

中信证券	2	88,825,944.17	48.12%	82,724.88	48.65%	-
广发证券	1	3,228,027.58	1.75%	3,006.29	1.77%	-

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： 资质雄厚，信誉良好，注册资本不少于 5 亿元人民币；财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；经营行为规范，最近两年未因重大违规行为受到中国证监会和中国人民银行处罚；内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；具备基金运作所需要的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要，并能为本基金提供全面的信息服务；研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告；适当的地域分散化。

(2) 选择程序：(a) 服务评价；(b) 拟定备选交易单元；(c) 签约。

2. 本基金本报告期券商交易单元新增广发证券。

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
东方证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

注：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	华宝中证 500 指数增强型发起式证券投资基金 2019 年第 4 季度报告	基金管理人网站	2020-01-21
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、基金管理人网站	2020-01-21
3	华宝中证 500 指数增强型发起式证券投资基金暂停大额申购（含定投及转换转入）业务的公告	中国证券报、基金管理人网站	2020-03-05
4	华宝基金关于旗下部分开放式基金新	上海证券报、证券日报、	2020-03-06

	增东方财富证券为代销机构的公告	证券时报、中国证券报、基金管理人网站	
5	华宝中证 500 指数增强型发起式证券投资基金 2019 年年度报告	基金管理人网站	2020-03-30
6	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、基金管理人网站	2020-03-30
7	关于华宝现金宝货币基金 E 类份额转换、赎回转申购、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	2020-04-14
8	华宝中证 500 指数增强型发起式证券投资基金 2020 年第 1 季度报告	基金管理人网站	2020-04-21
9	华宝中证 500 指数增强型发起式证券投资基金招募说明书（更新）	基金管理人网站	2020-05-07
10	华宝中证 500 指数增强型发起式证券投资基金招募说明书（更新）摘要	基金管理人网站	2020-05-07
11	华宝基金关于旗下部分基金新增陆享基金公司为代销机构的公告	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	2020-05-18

§ 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20200101-20200630	10,000,450.05	-	-	10,000,450.05	29.41

产品特有风险

报告期内本基金出现单一投资者持有基金份额比例超过 20%的情况。在单一投资者持有基金份额比例较高的情况下，如该投资者集中赎回，可能会增加基金的流动性风险。此外，由于基金在遇到大额赎回的时候可能需要变现部分资产，可能对持有资产的价格形成冲击，增加基金的市场风险。基金管理人将专业审慎、勤勉尽责地运作基金资产，加强防范流动性风险、市场风险，保护持有人利益。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 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；
华宝中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金合同；
华宝中证 500 指数增强型发起式证券投资基金招募说明书；
华宝中证 500 指数增强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及基金托管人住所备投资者查阅。

12.3 查阅方式

投资者可以通过基金管理人网站，查阅或下载基金合同、招募说明书、托管协议及基金的各种定期和临时公告。

华宝基金管理有限公司

2020 年 8 月 31 日