

# 华宝量化选股混合型发起式证券投资基金 2023 年中期报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：华宝基金管理有限公司

基金托管人：中信证券股份有限公司

送出日期：2023 年 8 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中信证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 08 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 2 月 20 日起至 2023 年 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b>	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§2 基金简介</b>	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b>	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
<b>§4 管理人报告</b>	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
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	12
<b>§5 托管人报告</b>	12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	12
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	12
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	13
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	17
<b>§7 投资组合报告</b>	42
7.1 期末基金资产组合情况	42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	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	49
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	50
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	50

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 .....	50
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 .....	50
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 .....	50
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	50
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	50
7.12 投资组合报告附注 .....	51
<b>§8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>51</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	51
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	52
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 .....	52
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况 .....	52
<b>§9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>53</b>
<b>§10 重大事件揭示 .....</b>	<b>53</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	53
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 .....	53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	53
10.4 基金投资策略的改变 .....	53
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 .....	55
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>56</b>
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 .....	56
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	56
<b>§12 备查文件目录 .....</b>	<b>56</b>
12.1 备查文件目录 .....	56
12.2 存放地点 .....	56
12.3 查阅方式 .....	56

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华宝量化选股混合型发起式证券投资基金	
基金简称	华宝量化选股混合发起式	
基金主代码	017715	
基金运作方式	契约型开放式、发起式	
基金合同生效日	2023 年 2 月 20 日	
基金管理人	华宝基金管理有限公司	
基金托管人	中信证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	77,585,177.82 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华宝量化选股混合发起式 A	华宝量化选股混合发起式 C
下属分级基金的交易代码	017715	017716
报告期末下属分级基金的份额总额	21,714,789.70 份	55,870,388.12 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制投资组合风险的前提下，通过量化投资精选股票，力争获得超越业绩比较基准的收益。
投资策略	主要考虑估值、成长、盈利质量、市场预期等基本面因子以及业绩超预期等事件驱动因子，通过实证分析和动态跟踪得到有效因子，再根据有效因子的综合评分结果，在全市场中选择股票构建股票投资组合。所选股票具备较高的市场认可度、成长水平、盈利质量等，具备对全 A 优质股的综合表征能力。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率 $\times$ 80% + 中证综合债指数收益率 $\times$ 20%
风险收益特征	本基金是一只主动投资的混合型基金，其长期平均预期风险和预期收益率理论上低于股票型基金，高于债券型基金、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	中信证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	周雷
	联系电话	021-38505888
	电子邮箱	xxpl@fsfund.com
客户服务电话	400-700-5588、400-820-5050	95548-3
传真	021-38505777	010-60834004
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	广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座
办公地址	中国（上海）自由贸易试验区世	北京市朝阳区亮马桥路 48 号中

	纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼	信证券大厦 5 层
邮政编码	200120	100125
法定代表人	黄孔威	张佑君

## 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	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	2023 年 2 月 20 日（基金合同生效日）-2023 年 6 月 30 日	
	华宝量化选股混合发起式 A	华宝量化选股混合发起式 C
本期已实现收益	298, 586. 69	588, 999. 72
本期利润	448, 232. 09	1, 112, 760. 87
加权平均基金份额本期利润	0. 0219	0. 0170
本期加权平均净值利润率	2. 19%	1. 70%
本期基金份额净值增长率	1. 86%	1. 71%
3.1.2 期末数据 和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	290, 946. 37	665, 756. 86
期末可供分配基金份额利润	0. 0134	0. 0119
期末基金资产净值	22, 119, 174. 75	56, 827, 661. 06
期末基金份额净值	1. 0186	1. 0171

值		
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	1.86%	1.71%

注：1. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润等于本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2. 所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3. 净值相关数据计算中涉及天数的，包括所有交易日以及季末最后一自然日（如非交易日）。

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

5. 本基金合同在当期生效。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华宝量化选股混合发起式 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	2.66%	0.82%	-0.54%	0.74%	3.20%	0.08%
过去三个月	0.34%	0.74%	-3.96%	0.66%	4.30%	0.08%
过去六个月	-	-	-	-	-	-
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	1.86%	0.68%	-2.58%	0.64%	4.44%	0.04%

华宝量化选股混合发起式 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	2.62%	0.82%	-0.54%	0.74%	3.16%	0.08%
过去三个月	0.24%	0.74%	-3.96%	0.66%	4.20%	0.08%
过去六个月	-	-	-	-	-	-

过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起 至今	1. 71%	0. 68%	-2. 58%	0. 64%	4. 29%	0. 04%

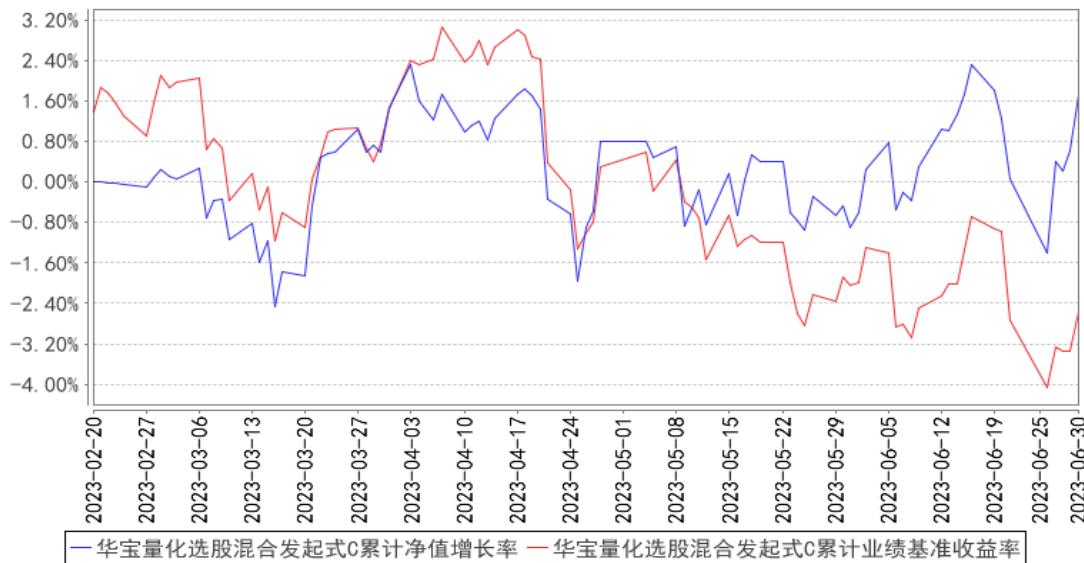
- 注: (1) 基金业绩基准: 中证 500 指数收益率  $\times$  80% + 中证综合债指数收益率  $\times$  20%;
- (2) 净值以及比较基准相关数据计算中涉及天数的, 包括所有交易日以及季末最后一自然日(如非交易日);
- (3) 本基金成立于 2023 年 02 月 20 日。

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华宝量化选股混合发起式 A 累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



华宝量化选股混合发起式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：1、本基金基金合同生效于 2023 年 02 月 20 日，截止报告日本基金基金合同生效未满一年。  
 2、按照基金合同的约定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定，截至本报告期末，本基金尚处于建仓期。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

华宝基金管理有限公司（公司原名“华宝兴业基金管理有限公司”）于 2003 年 2 月 12 日经中国证监会批准设立，2003 年 3 月 7 日在国家工商总局注册登记并正式开业，是国内首批中外合资基金管理公司。成立之初，公司注册资本为 1 亿元人民币，2007 年经中国证监会批准，公司注册资本增加至 1.5 亿元人民币。2017 年公司名称变更为“华宝基金管理有限公司”。目前公司股东为华宝信托有限责任公司、美国华平资产管理有限公司（Warburg Pincus Asset Management, L.P.）和江苏省铁路集团有限公司，持有股权占比分别为 51%、29%、20%。公司在北京和深圳设有分公司，在香港设有子公司——华宝资产管理（香港）有限公司。截至本报告期末（2023 年 06 月 30 日），本公司正在管理运作的公开募集证券投资基金额共 139 只。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 (助理)期限		证券从 业年限	说明
		任职日期	离任日期		
喻银	本基金基	2023-02-	-	7 年	硕士。曾在中信建投证券股份有限公司从

尤	基金经理	20			事量化研究工作，2018 年 9 月加入华宝基金管理有限公司，历任量化分析师、投资经理等职务。2022 年 7 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，2023 年 2 月起任华宝量化选股混合型发起式证券投资基金基金经理。
徐林明	本基金基金经理、量化投资总监、量化投资部总经理	2023-02-20	-	21 年	硕士。曾在兴业证券、凯龙财经（上海）有限公司、中原证券从事金融工程研究工作。2005 年 8 月加入华宝基金管理有限公司，先后担任金融工程部数量分析师、金融工程部副总经理等职务，现任量化投资总监、量化投资部总经理。2009 年 9 月至 2015 年 11 月任华宝中证 100 指数证券投资基金基金经理，2010 年 4 月至 2015 年 11 月任上证 180 价值交易型开放式指数证券投资基金、华宝上证 180 价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，2014 年 9 月起任华宝量化对冲策略混合型发起式证券投资基金基金经理，2015 年 4 月至 2020 年 2 月任华宝事件驱动混合型证券投资基金基金经理，2016 年 12 月起任华宝沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金基金经理，2019 年 2 月至 2022 年 10 月任华宝科技先锋混合型证券投资基金基金经理，2021 年 12 月起任华宝中证稀有金属主题指数增强型发起式证券投资基金基金经理，2022 年 8 月起任华宝高端装备股票型发起式证券投资基金基金经理，2023 年 2 月起任华宝量化选股混合型发起式证券投资基金基金经理。

注：1、任职日期以及离任日期均以基金公告为准。

2、证券从业含义遵从《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期内，本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作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》及其各项实施细则、《华宝量化选股混合型发起式证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋取最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，基金管理人通过严格执行投资决策委员会议事规则、公司股票库管理制度、中央交易室制度、防火墙机制、系统中的公平交易程序、每日交易日结报告、定期基金投资绩效评价等机制，确保所管理的所有投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。同时，基金管理人严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定和公司内部制度要求，分析了本公司旗下所有投资组合之间的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异以及连续四个季度期间内、不同时间窗下同向交易的交易价差；分析结果未发现异常情况。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，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，本基金没有发现异常交易行为。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2023 年上半年，A 股市场表现总体平稳。经济复苏和政策利好的推动下，股指呈现上涨趋势，投资者信心逐渐恢复。经济复苏是 A 股市场表现良好的重要原因之一。随着全球疫情逐渐得到控制，国内经济逐渐恢复增长势头，企业盈利能力得到提升，这对于股市的推动起到了积极作用。政策利好也是 A 股市场上半年表现不错的原因之一。政府出台了一系列支持经济发展的政策，包括减税降费、扩大内需、推动科技创新等，这些政策的实施对于相关行业和企业有着积极的影响，进一步提振了投资者的信心。然而，市场仍然面临一些不确定因素和挑战，投资者需要保持警惕并做好风险管理。

本基金采取多策略模型，不赌风格、不押赛道、不追热点，全市场均衡量化选股策略。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金份额 A 类净值增长率为 1.86%，本报告期基金份额 C 类净值增长率为 1.71%；同期业绩比较基准收益率为-2.58%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年企业盈利大概率是周期低点，未来企业盈利将触底回升，市场对于 A 股的投资热情将增加，股市将有望表现良好。同时利好政策大概率更多推出，政府将加大对资本市场的支持力度，有助于提振市场信心，推动 A 股市场的表现。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。

本基金管理人设有估值委员会，定期评价现行估值政策和程序，在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况后及时修订估值方法。基金在投资新品种时，由估值委员会评价现有估值政策和程序的适用性。参与估值的人员均具备估值业务所需的专业胜任能力，参与估值各方之间不存在重大利益冲突。

本基金的估值由基金会计负责，基金会计以本基金为会计核算主体，基金会计核算独立于公司会计核算，独立建账、独立核算。基金会计采用专用的财务核算软件系统进行基金核算及账务处理；每日按时接收成交数据及权益数据，进行基金估值。基金会计核算采用基金管理人与托管银行双人同步独立核算、相互核对的方式进行；基金会计每日就基金的会计核算、基金估值等与托管银行进行核对，每日估值结果必须与托管行核对一致后才能对外公告。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中债金融估值中心有限公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金为发起式基金，且截至本报告期末，本基金基金合同生效未满 3 年，暂不适用《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条第一款的规定。

### § 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，中信证券股份有限公司（以下称“本托管人”）在对华宝量化选股混合型发起式证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

#### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期，由华宝基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关华宝量化选股混合型发起式证券投资基金的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：华宝量化选股混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日
<b>资产：</b>		
银行存款	6.4.7.1	3,116,348.74
结算备付金		1,598,839.80
存出保证金		—
交易性金融资产	6.4.7.2	74,632,985.29
其中：股票投资		74,632,985.29
基金投资		—
债券投资		—
资产支持证券投资		—
贵金属投资		—
其他投资		—
衍生金融资产	6.4.7.3	—
买入返售金融资产	6.4.7.4	—
债权投资	6.4.7.5	—
其中：债券投资		—
资产支持证券投资		—
其他投资		—
其他债权投资	6.4.7.6	—
其他权益工具投资	6.4.7.7	—
应收清算款		—
应收股利		—
应收申购款		—
递延所得税资产		—
其他资产	6.4.7.8	—
资产总计		79,348,173.83
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末</b>

		2023 年 6 月 30 日
<b>负债:</b>		
短期借款		—
交易性金融负债		—
衍生金融负债	6. 4. 7. 3	—
卖出回购金融资产款		—
应付清算款		—
应付赎回款		228,655.34
应付管理人报酬		80,887.35
应付托管费		13,481.22
应付销售服务费		14,122.26
应付投资顾问费		—
应交税费		—
应付利润		—
递延所得税负债		—
其他负债	6. 4. 7. 9	64,191.85
负债合计		401,338.02
<b>净资产:</b>		
实收基金	6. 4. 7. 10	77,585,177.82
其他综合收益	6. 4. 7. 11	—
未分配利润	6. 4. 7. 12	1,361,657.99
净资产合计		78,946,835.81
负债和净资产总计		79,348,173.83

注: 1. 本基金合同生效日为 2023 年 02 月 20 日, 本报告期自基金合同生效日 2023 年 02 月 20 日起至 2023 年 06 月 30 日止。

2. 报告截止日 2023 年 06 月 30 日, 基金份额总额 77,585,177.82 份, 其中华宝量化选股混合发起式 A 基金份额总额 21,714,789.70 份, 基金份额净值 1.0186 元; 华宝量化选股混合发起式 C 基金份额总额 55,870,388.12 份, 基金份额净值 1.0171 元。

## 6.2 利润表

会计主体: 华宝量化选股混合型发起式证券投资基金

本报告期: 2023 年 2 月 20 日 (基金合同生效日) 至 2023 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 2 月 20 日 (基金合同 生效日) 至 2023 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		2,250,938.83
1. 利息收入		80,301.07
其中: 存款利息收入	6. 4. 7. 13	22,339.97
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		57,961.10
证券出借利息收入		—
其他利息收入		—
2. 投资收益（损失以“-”填列）		1,491,986.09
其中：股票投资收益	6.4.7.14	877,176.01
基金投资收益		—
债券投资收益	6.4.7.15	2,425.52
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	—
贵金属投资收益	6.4.7.17	—
衍生工具收益	6.4.7.18	—
股利收益	6.4.7.19	612,384.56
以摊余成本计量的金融资产 终止确认产生的收益		—
其他投资收益		—
3. 公允价值变动收益（损失以“-” 号填列）	6.4.7.20	673,406.55
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		—
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	5,245.12
<b>减：二、营业总支出</b>		689,945.87
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	459,336.47
2. 托管费	6.4.10.2.2	76,556.10
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	93,267.54
4. 投资顾问费		—
5. 利息支出		—
其中：卖出回购金融资产支出		—
6. 信用减值损失	6.4.7.22	—
7. 税金及附加		—
8. 其他费用	6.4.7.23	60,785.76
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号 填列）</b>		1,560,992.96
减：所得税费用		—
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		1,560,992.96
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		—
<b>六、综合收益总额</b>		1,560,992.96

注：本产品成立于 2023 年 02 月 20 日，故无上年度可比期间。

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：华宝量化选股混合型发起式证券投资基金

本报告期：2023 年 2 月 20 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期			
	2023 年 2 月 20 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日			
实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计	

一、上期期末净资产(基金净值)	-	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	93,965,302.33	-	-	93,965,302.33
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-16,380,124.51	-	1,361,657.99	-15,018,466.52
(一)、综合收益总额	-	-	1,560,992.96	1,560,992.96
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-16,380,124.51	-	-199,334.97	-16,579,459.48
其中：1. 基金申购款	25,283,333.89	-	67,445.52	25,350,779.41
2. 基金赎回款	-41,663,458.40	-	-266,780.49	-41,930,238.89
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	77,585,177.82	-	1,361,657.99	78,946,835.81

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

向辉

向辉

张幸骏

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

华宝量化选股混合型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2022]3112 号文《关于准予华宝量化选股混合型发起式证券投资基金注册的批复》准予注册，由华宝基金管理有限公司于 2023 年 2 月 15 日至 2023 年 2 月 16 日止期间向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具安永华明（2022）验字第 61471289\_B03 号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2023 年 2 月 20 日生效。本基金为契约型开放式、发起式，存续期限不定。设立时募集扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 93,956,514.37 元，其中 A 类基金份额的净认购金额为人民币 19,740,148.53 元；C 类基金份额的净认购金额为人民币 74,216,365.84 元。在募集期间产生利息为人民币 8,787.96 元，其中 A 类基金份额的有效认购资金在初始销售期内产生的利息为人民币 2,031.92 元；C 类基金份额的有效认购资金在初始销售期内产生的利息为人民币 6,756.04 元。以上收到的实收资金（本息）共计人民币 93,965,302.33 元，折合 93,965,302.33 份基金份额。本基金的基金管理人与注册登记机构为华宝基金管理有限公司，基金托管人为中信证券股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华宝量化选股混合型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（包括创业板、存托凭证及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、债券（包括国债、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（含分离交易可转换债）、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、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、股指期货、国债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的相关规定。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：基金资产的 60%-95%；每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金保留的现金（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不低于基金资产净值的 5%。

本基金的业绩比较基准为：中证 500 指数收益率  $\times$  80%+中证综合债指数收益率  $\times$  20%。

本财务报表已于 2023 年 8 月 29 日经本基金的基金管理人批准。

## 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《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员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 3 号《半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<年度报告和中期报告>》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

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 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及 2023 年 2 月 20 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

## 6.4.4 重要会计政策和会计估计

### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年，即每年自 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间系 2023 年 2 月 20 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日止。

### 6.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

#### （1）金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

#### （2）金融负债分类

除由于金融资产转移不符合终止确认条件或继续涉入被转移金融资产所形成的金融负债以外，本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊

余成本计量的金融负债。

#### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

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和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映

公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

#### 6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面

已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或内含票面利率或合同利率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(3) 股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

(4) 处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(5) 买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

(6) 公允价值变动收益系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、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(7) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时确认。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 20%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配。

(2) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

(3) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减

去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

（4）本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权，但由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，而 C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同；

（5）法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 6.4.4.12 外币交易

无。

#### 6.4.4.13 分部报告

无。

#### 6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

##### （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

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，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金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，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对证券投资基金在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

### （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 2023 年 6 月 30 日
活期存款	3,116,348.74
等于： 本金	3,115,076.94
加： 应计利息	1,271.80
减： 坏账准备	-
定期存款	-
等于： 本金	-
加： 应计利息	-
减： 坏账准备	-
其中： 存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-

其他存款				
等于：本金				
加：应计利息				
减：坏账准备				
合计				3,116,348.74

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	73,959,578.74	—	74,632,985.29	673,406.55
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	73,959,578.74	—	74,632,985.29	673,406.55

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

##### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

##### 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

#### 6.4.7.5 债权投资

##### 6.4.7.5.1 债权投资情况

##### 6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

#### 6.4.7.6 其他债权投资

##### 6.4.7.6.1 其他债权投资情况

##### 6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

#### 6.4.7.7 其他权益工具投资

##### 6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

##### 6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

#### 6.4.7.8 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	448.09
应付证券出借违约金	—
应付交易费用	—
其中：交易所市场	—
银行间市场	—
应付利息	—
预提费用	60,385.76
其他	3,358.00
合计	64,191.85

#### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

华宝量化选股混合发起式 A

项目	本期 2023 年 2 月 20 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	19,742,180.45	19,742,180.45
本期申购	3,925,223.93	3,925,223.93
本期赎回（以“-”号填列）	-1,952,614.68	-1,952,614.68
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	21,714,789.70	21,714,789.70

## 华宝量化选股混合发起式 C

项目	本期	
	2023 年 2 月 20 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日	账面金额
基金合同生效日	74,223,121.88	74,223,121.88
本期申购	21,358,109.96	21,358,109.96
本期赎回（以“-”号填列）	-39,710,843.72	-39,710,843.72
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	55,870,388.12	55,870,388.12

注：申购含红利再投以及转换入份(金)额，赎回含转换出份(金)额。

## 6.4.7.11 其他综合收益

## 6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

## 华宝量化选股混合发起式 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	298,586.69	149,645.40	448,232.09
本期基金份额交易产生的变动数	-7,640.32	-36,206.72	-43,847.04
其中：基金申购款	6,148.81	-27,079.60	-20,930.79
基金赎回款	-13,789.13	-9,127.12	-22,916.25
本期已分配利润	-	-	-
本期末	290,946.37	113,438.68	404,385.05

## 华宝量化选股混合发起式 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	588,999.72	523,761.15	1,112,760.87
本期基金份额交易产生的变动数	76,757.14	-232,245.07	-155,487.93
其中：基金申购款	183,831.13	-95,454.82	88,376.31
基金赎回款	-107,073.99	-136,790.25	-243,864.24
本期已分配利润	-	-	-
本期末	665,756.86	291,516.08	957,272.94

## 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 2 月 20 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	17,226.62
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	5,113.35
其他	—
合计	22,339.97

#### 6.4.7.14 股票投资收益

##### 6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

##### 6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 2 月 20 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	239,700,567.19
减：卖出股票成本总额	238,128,515.67
减：交易费用	694,875.51
买卖股票差价收入	877,176.01

##### 6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

#### 6.4.7.15 债券投资收益

##### 6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 2 月 20 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
债券投资收益——利息收入	1,635.54
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	789.98
债券投资收益——赎回差价收入	—
债券投资收益——申购差价收入	—
合计	2,425.52

##### 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 2 月 20 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,106,487.29
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成	1,098,592.00

本总额	
减: 应计利息总额	6,663.29
减: 交易费用	442.02
买卖债券差价收入	789.98

#### 6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

#### 6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

#### 6.4.7.16 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

##### 6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

##### 6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

##### 6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

#### 6.4.7.17 贵金属投资收益

##### 6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

##### 6.4.7.17.2 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。

##### 6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

##### 6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

#### 6.4.7.18 衍生工具收益

##### 6.4.7.18.1 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。

##### 6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

#### 6.4.7.19 股利收益

单位: 人民币元

项目	本期
	2023 年 2 月 20 日 (基金合同生效日) 至 2023 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	612,384.56
其中: 证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	612,384.56

#### 6.4.7.20 公允价值变动收益

单位: 人民币元

项目名称	本期
------	----

	2023 年 2 月 20 日 (基金合同生效日) 至 2023 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	673,406.55
股票投资	673,406.55
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	673,406.55

#### 6.4.7.21 其他收入

单位: 人民币元

项目	本期 2023 年 2 月 20 日 (基金合同生效日) 至 2023 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	5,245.12
合计	5,245.12

注: 本基金的赎回费率按持有期间递减, 不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

#### 6.4.7.22 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

#### 6.4.7.23 其他费用

单位: 人民币元

项目	本期 2023 年 2 月 20 日 (基金合同生效日) 至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	14,639.25
信息披露费	45,746.51
证券出借违约金	—
其他	400.00
合计	60,785.76

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日, 本基金并无需要披露的或有事项。

### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

### 6.4.9 关联方关系

#### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

#### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华宝基金管理有限公司（“华宝基金”）	基金管理人, 注册登记机构, 基金销售机构
中信证券股份有限公司（“中信证券”）	基金托管人, 基金销售机构
华宝信托有限责任公司（“华宝信托”）	基金管理人的股东
华平资产管理有限合伙 (Warburg Pincus Asset Management. L. P.)	基金管理人的股东
江苏省铁路集团有限公司（“江苏铁集”）	基金管理人的股东
中国宝武钢铁集团有限公司（“宝武集团”）	华宝信托的最终控制人
华宝证券股份有限公司（“华宝证券”）	受宝武集团控制的公司, 基金销售机构
华宝投资有限公司（“华宝投资”）	受宝武集团控制的公司
宝武集团财务有限责任公司（“宝武财务”）	受宝武集团控制的公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 2 月 20 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例（%）
中信证券	551,788,661.60	100.00

###### 6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 2 月 20 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例（%）
中信证券	2,210,107.04	100.00

###### 6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 2 月 20 日 (基金合同生效日) 至 2023 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 (%)
中信证券	317,803,000.00	100.00

#### 6.4.10.1.4 权证交易

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 2 月 20 日 (基金合同生效日) 至 2023 年 6 月 30 日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
中信证券	419,026.37	100.00	-	-

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 2 月 20 日 (基金合同生效日) 至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	459,336.47
其中：支付销售机构的客户维护费	82,565.37

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.50%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 2 月 20 日 (基金合同生效日) 至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	76,556.10

注：基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2023 年 2 月 20 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日		
	华宝量化选股混合发起式 A	华宝量化选股混合发起式 C	合计
华宝基金	—	425.02	425.02
中信证券	—	91,842.96	91,842.96
合计	—	92,267.98	92,267.98

注：销售服务费每日计提，按月支付。A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.4% 年费率计提。本基金 C 类基金份额销售服务费计提的计算方法如下： $H=E \times 0.4\% \div \text{当年天数}$ ，H 为 C 类基金份额每日应计提的基金销售服务费 E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值。

### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

#### 6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期内无转融通证券出借业务。

#### 6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

#### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	本期
	2023 年 2 月 20 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日	2023 年 2 月 20 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
华宝量化选股混合发起式 A	—	华宝量化选股混合发起式 C
基金合同生效日（2023 年 2 月 20 日）持有的基金份额	9,901,031.35	100,010.42
报告期初持有的基金份额	—	—
报告期内申购/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	9,901,031.35	100,010.42
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	45.60%	0.18%

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

本报告期末除基金管理人外其他关联方未投资本基金。

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位: 人民币元

关联方名称	本期 2023年2月20日(基金合同生效日)至2023年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中信证券	3,116,348.74	17,226.62

注: 本基金的银行存款由基金托管人中信证券保管, 按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内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

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末(2023年6月30日)本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期内未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期内未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期内无银行间市场债券正回购, 因此没有在银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购，因此没有在交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

## 6.4.13 金融工具风险及管理

### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只混合型的证券投资基金，其长期平均预期风险和预期收益率低于股票型基金，高于债券型基金、货币市场基金。本基金投资的金融工具主要包括股票、债券等。本基金在日常经营活动面临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建设，公司内部监督和反馈系统包括内部控制委员会、督察长、合规审计部、风险管理部、各部门负责人和风险控制联络人、各业务岗位。内部控制委员会负责对公司在经营管理和基金运作中的风险进行评估并研究制订相应的控制制度。督察长向董事会负责，总管公司的内控事务并独立地就内控制度的执行情况履行检查、评价、报告和建议职能。风险管理部在督察长指导下对公司内部控制运行情况进行监控，主要针对公司内部控制制度的总体构架和内部控制的目标进行评估并提出改进意见；合规审计部在督察长的领导下对各部门和岗位的内部控制执行情况进行监督和核查，同时对内控的失控点进行查漏并责令改正。

本基金的基金管理人根据自身经营特点设立顺序递进、权责统一、严密有效的四层监控防线。第一层监控防线为一线岗位自控与互控；第二层防线为大业务板块内部各部门和部门之间的自控和互控；第三层监控防线为风险管理部和合规审计部对各岗位、各部门、各项业务全面实施的监督反馈；最后是以内部控制委员会为主体的第四层防线，实施对公司各类业务和风险的总体监督、控制，并对风险管理部和合规审计部的工作予以直接指导。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法是通过结合定性分析和定量分析方法，估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具的特征，通过特定的风险量化指标、模型、日常的量化报告，确定相应置信程度和风险损失的限度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，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。

于本报告期末，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券和资产支持证券占基金资产净值的比例较低（含债券投资比例为零），因此无重大信用风险。

#### 6.4.13.2.1 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

#### 6.4.13.2.3 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

#### 6.4.13.2.5 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

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于本报告期末，除附注中列示的卖出回购金融资产款将在一个月以内到期且计息（该利息金额不重大）外，本基金所承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金管理办法》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时间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发行的证券不得超过该证券的 10%, 本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%, 本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票, 不得超过该上市公司可流通股票的 30% (完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市, 其余亦可在银行间同业市场交易, 部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注。此外, 本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求, 其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算, 确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

本报告期内, 基金管理人坚持组合管理、分散投资的基本原则, 严格按照法律法规的有关规定和基金合同约定的投资范围与比例限制实施投资管理。本基金所持大部分证券在证券交易所上市或银行间同业市场交易, 不存在具有重大流动性风险的投资品种。

同时, 本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度, 按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理, 以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外, 本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度: 根据质押品的资质确定质押率水平; 持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额; 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、结算备付金和存出保证金等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
<b>资产</b>					
银行存款	3,116,348.74	-	-	-	3,116,348.74
结算备付金	1,598,839.80	-	-	-	1,598,839.80
交易性金融资产	-	-	-	74,632,985.29	74,632,985.29
<b>资产总计</b>	<b>4,715,188.54</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>74,632,985.29</b>	<b>79,348,173.83</b>
<b>负债</b>					
应付赎回款	-	-	-	228,655.34	228,655.34
应付管理人报酬	-	-	-	80,887.35	80,887.35
应付托管费	-	-	-	13,481.22	13,481.22
应付销售服务费	-	-	-	14,122.26	14,122.26
其他负债	-	-	-	64,191.85	64,191.85
<b>负债总计</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>401,338.02</b>	<b>401,338.02</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>4,715,188.54</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>74,231,647.27</b>	<b>78,946,835.81</b>

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

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或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金的股票投资比例为基金资产的 60%-95%；每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金保留的现金（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不低于基金资产净值的 5%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR (Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	74,632,985.29	94.54
交易性金融资产—基金投资	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-
其他	-	-
合计	74,632,985.29	94.54

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于报告期末，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 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 6 月 30 日
第一层次	74,632,985.29
第二层次	—
第三层次	—
合计	74,632,985.29

###### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的证券等，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关证券等的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关证券公允价值应属第二层次或第三层次。

##### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本报告期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

##### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	74,632,985.29	94.06
	其中：股票	74,632,985.29	94.06
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	4,715,188.54	5.94
8	其他各项资产	—	—
9	合计	79,348,173.83	100.00

注：本基金本报告期末“固定收益投资”、“买入返售金融资产”、“银行存款和结算备付金合计”等项目的列报金额已包含对应的“应计利息”和“减值准备”（若有），“其他资产”中的“应收利息”指本基金截至本报告期末已过付息期但尚未收到的利息金额（下同）。

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	1,027,813.68	1.30
B	采矿业	3,316,761.00	4.20
C	制造业	44,186,280.79	55.97
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	650,980.00	0.82
E	建筑业	1,845,276.00	2.34
F	批发和零售业	6,998,067.84	8.86
G	交通运输、仓储和邮政业	569,869.00	0.72
H	住宿和餐饮业	231,744.00	0.29
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,394,086.90	4.30
J	金融业	5,568,388.00	7.05
K	房地产业	1,577,793.00	2.00
L	租赁和商务服务业	1,627,664.00	2.06

M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	983,992.08	1.25
O	居民服务、修理和其他服务业	454,687.00	0.58
P	教育	446,966.00	0.57
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	1,752,616.00	2.22
S	综合	-	-
	合计	74,632,985.29	94.54

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600120	浙江东方	212,600	814,258.00	1.03
2	300511	雪榕生物	106,800	811,680.00	1.03
3	000921	海信家电	29,100	784,245.00	0.99
4	600397	安源煤业	270,000	783,000.00	0.99
5	688516	奥特维	4,154	782,613.60	0.99
6	600329	达仁堂	17,300	776,597.00	0.98
7	688599	天合光能	17,999	766,937.39	0.97
8	600729	重庆百货	21,800	685,392.00	0.87
9	300246	宝莱特	54,000	672,300.00	0.85
10	603283	赛腾股份	14,300	636,350.00	0.81
11	300063	天龙集团	146,200	633,046.00	0.80
12	301116	益客食品	40,700	626,780.00	0.79
13	601003	柳钢股份	155,100	626,604.00	0.79
14	000686	东北证券	90,200	625,988.00	0.79
15	002419	天虹股份	106,200	621,270.00	0.79
16	600060	海信视像	24,900	616,275.00	0.78
17	301004	嘉益股份	15,500	601,400.00	0.76
18	603939	益丰药房	16,200	599,400.00	0.76
19	300866	安克创新	6,800	595,000.00	0.75
20	300856	科思股份	7,500	590,775.00	0.75
21	000951	中国重汽	34,800	586,380.00	0.74
22	300274	阳光电源	5,000	583,150.00	0.74
23	600583	海油工程	99,400	581,490.00	0.74
24	688556	高测股份	10,855	576,834.70	0.73
25	300811	铂科新材	9,700	576,568.00	0.73
26	601318	中国平安	12,400	575,360.00	0.73
27	002459	晶澳科技	13,700	571,290.00	0.72
28	600998	九州通	54,078	561,329.64	0.71

29	300736	百邦科技	37,300	454,687.00	0.58
30	002535	林州重机	106,300	444,334.00	0.56
31	000705	浙江震元	53,800	433,090.00	0.55
32	600307	酒钢宏兴	277,300	429,815.00	0.54
33	000949	新乡化纤	133,400	428,214.00	0.54
34	600512	腾达建设	158,900	425,852.00	0.54
35	300332	天壕能源	37,000	424,390.00	0.54
36	002605	姚记科技	9,100	422,513.00	0.54
37	300232	洲明科技	45,600	416,784.00	0.53
38	002489	浙江永强	102,600	415,530.00	0.53
39	688080	映翰通	8,489	415,112.10	0.53
40	300538	同益股份	23,900	414,665.00	0.53
41	000063	中兴通讯	9,100	414,414.00	0.52
42	600398	海澜之家	60,100	413,488.00	0.52
43	300132	青松股份	72,800	412,776.00	0.52
44	301139	元道通信	14,100	407,349.00	0.52
45	300389	艾比森	19,800	403,326.00	0.51
46	002983	芯瑞达	16,300	402,121.00	0.51
47	688299	长阳科技	25,477	399,224.59	0.51
48	603878	武进不锈	47,200	398,840.00	0.51
49	603086	先达股份	58,200	398,670.00	0.50
50	000425	徐工机械	58,700	397,399.00	0.50
51	600582	天地科技	68,100	397,023.00	0.50
52	001332	锡装股份	10,200	396,882.00	0.50
53	000166	申万宏源	85,900	396,858.00	0.50
54	300041	回天新材	33,600	396,480.00	0.50
55	688029	南微医学	4,858	396,218.48	0.50
56	600908	无锡银行	73,900	396,104.00	0.50
57	002269	美邦服饰	252,100	395,797.00	0.50
58	002154	报喜鸟	71,700	395,784.00	0.50
59	002668	奥马电器	45,800	395,712.00	0.50
60	003002	壶化股份	25,000	395,500.00	0.50
61	603096	新经典	19,400	394,984.00	0.50
62	002706	良信股份	35,100	394,875.00	0.50
63	600373	中文传媒	29,600	394,272.00	0.50
64	300753	爱朋医疗	21,500	394,095.00	0.50
65	600351	亚宝药业	55,500	394,050.00	0.50
66	002062	宏润建设	72,800	393,848.00	0.50
67	300368	汇金股份	59,300	393,752.00	0.50
68	000404	长虹华意	56,900	393,748.00	0.50
69	002563	森马服饰	63,300	393,726.00	0.50
70	002004	华邦健康	78,700	393,500.00	0.50
71	300731	科创新源	18,800	393,484.00	0.50

72	300096	易联众	64,000	392,960.00	0.50
73	300147	香雪制药	74,500	392,615.00	0.50
74	300198	纳川股份	152,500	391,925.00	0.50
75	002697	红旗连锁	67,000	391,280.00	0.50
76	002936	郑州银行	169,900	390,770.00	0.49
77	603179	新泉股份	8,900	390,621.00	0.49
78	603071	物产环能	23,500	389,865.00	0.49
79	300760	迈瑞医疗	1,300	389,740.00	0.49
80	603323	苏农银行	92,500	389,425.00	0.49
81	600056	中国医药	30,000	389,400.00	0.49
82	600064	南京高科	58,900	389,329.00	0.49
83	688004	博汇科技	11,119	388,831.43	0.49
84	600971	恒源煤电	49,800	387,942.00	0.49
85	600757	长江传媒	45,100	387,860.00	0.49
86	002807	江阴银行	105,100	387,819.00	0.49
87	002377	国创高新	161,400	387,360.00	0.49
88	601168	西部矿业	36,800	386,768.00	0.49
89	601187	厦门银行	77,000	386,540.00	0.49
90	600057	厦门象屿	44,400	386,280.00	0.49
91	603197	保隆科技	7,100	385,175.00	0.49
92	002223	鱼跃医疗	10,700	385,093.00	0.49
93	600927	永安期货	23,600	383,736.00	0.49
94	000014	沙河股份	33,500	383,240.00	0.49
95	300783	三只松鼠	19,600	382,984.00	0.49
96	002371	北方华创	1,200	381,180.00	0.48
97	603758	秦安股份	35,800	380,912.00	0.48
98	600129	太极集团	6,400	380,736.00	0.48
99	601098	中南传媒	32,600	378,160.00	0.48
100	000568	泸州老窖	1,800	377,226.00	0.48
101	600256	广汇能源	51,800	355,348.00	0.45
102	605098	行动教育	6,400	253,376.00	0.32
103	002952	亚世光电	13,900	246,447.00	0.31
104	300852	四会富仕	5,900	244,614.00	0.31
105	002788	鹭燕医药	25,600	243,968.00	0.31
106	603629	利通电子	10,600	240,196.00	0.30
107	002388	新亚制程	33,700	239,944.00	0.30
108	300117	嘉寓股份	77,100	239,010.00	0.30
109	000048	京基智农	12,200	238,144.00	0.30
110	002734	利民股份	25,800	237,876.00	0.30
111	300842	帝科股份	2,600	237,744.00	0.30
112	600051	宁波联合	32,600	237,328.00	0.30
113	603613	国联股份	6,420	237,090.60	0.30
114	002295	精艺股份	34,500	237,015.00	0.30

115	300275	梅安森	17,000	236,300.00	0.30
116	002956	西麦食品	15,100	236,013.00	0.30
117	002131	利欧股份	102,400	235,520.00	0.30
118	600866	星湖科技	42,800	235,400.00	0.30
119	300047	天源迪科	28,900	235,246.00	0.30
120	300779	惠城环保	4,400	234,476.00	0.30
121	002484	江海股份	11,000	234,190.00	0.30
122	002588	史丹利	38,400	233,472.00	0.30
123	688777	中控技术	3,704	232,537.12	0.29
124	601933	永辉超市	74,200	232,246.00	0.29
125	000552	甘肃能化	69,700	232,101.00	0.29
126	601007	金陵饭店	27,200	231,744.00	0.29
127	002746	仙坛股份	29,400	231,672.00	0.29
128	300119	瑞普生物	13,000	231,400.00	0.29
129	000563	陕国投 A	74,900	228,445.00	0.29
130	600748	上实发展	57,600	227,520.00	0.29
131	600863	内蒙华电	54,600	226,590.00	0.29
132	600859	王府井	11,400	225,606.00	0.29
133	605168	三人行	2,600	223,444.00	0.28
134	688630	芯碁微装	2,576	216,435.52	0.27
135	002772	众兴菌业	19,100	215,830.00	0.27
136	300394	天孚通信	2,000	213,660.00	0.27
137	300884	狄耐克	15,700	207,868.00	0.26
138	002981	朝阳科技	8,600	207,260.00	0.26
139	603657	春光科技	11,800	207,090.00	0.26
140	603090	宏盛股份	9,300	206,925.00	0.26
141	000055	方大集团	41,700	206,415.00	0.26
142	603499	翔港科技	21,600	206,064.00	0.26
143	688466	金科环境	10,248	204,550.08	0.26
144	600847	万里股份	16,700	203,907.00	0.26
145	603955	大千生态	13,400	203,680.00	0.26
146	603611	诺力股份	7,700	202,818.00	0.26
147	002134	天津普林	19,800	202,752.00	0.26
148	301197	工大科雅	8,400	202,440.00	0.26
149	603206	嘉环科技	11,700	201,825.00	0.26
150	301032	新柴股份	22,500	201,375.00	0.26
151	002780	三夫户外	14,800	201,280.00	0.25
152	000652	泰达股份	48,800	201,056.00	0.25
153	603360	百傲化学	19,800	200,772.00	0.25
154	688120	华海清科	796	200,631.80	0.25
155	600783	鲁信创投	15,500	200,415.00	0.25
156	300621	维业股份	20,000	200,200.00	0.25
157	688309	恒誉环保	9,629	200,090.62	0.25

158	605166	聚合顺	21,400	199,448.00	0.25
159	600470	六国化工	37,100	199,227.00	0.25
160	300624	万兴科技	1,700	199,155.00	0.25
161	301158	德石股份	11,500	199,065.00	0.25
162	603987	康德莱	15,400	198,968.00	0.25
163	301359	东南电子	7,800	198,744.00	0.25
164	002076	星光股份	80,400	198,588.00	0.25
165	300316	晶盛机电	2,800	198,520.00	0.25
166	002207	准油股份	30,300	198,465.00	0.25
167	688301	奕瑞科技	702	198,265.86	0.25
168	300575	中旗股份	19,100	198,258.00	0.25
169	603093	南华期货	18,200	198,198.00	0.25
170	603596	伯特利	2,500	198,150.00	0.25
171	600836	上海易连	41,000	198,030.00	0.25
172	002177	御银股份	50,000	198,000.00	0.25
173	300162	雷曼光电	28,200	197,964.00	0.25
174	603036	如通股份	18,700	197,846.00	0.25
175	002743	富煌钢构	34,400	197,800.00	0.25
176	603150	万朗磁塑	7,500	197,700.00	0.25
177	000619	海螺新材	32,400	197,640.00	0.25
178	002752	昇兴股份	41,600	197,600.00	0.25
179	000727	冠捷科技	93,200	197,584.00	0.25
180	603279	景津装备	6,300	197,568.00	0.25
181	688669	聚石化学	10,896	197,544.48	0.25
182	001316	润贝航科	5,300	197,531.00	0.25
183	002215	诺普信	26,300	197,513.00	0.25
184	002236	大华股份	10,000	197,500.00	0.25
185	600052	东望时代	46,000	197,340.00	0.25
186	300285	国瓷材料	7,200	197,280.00	0.25
187	002172	澳洋健康	56,200	197,262.00	0.25
188	688006	杭可科技	6,472	197,201.84	0.25
189	601515	东风股份	45,000	197,100.00	0.25
190	600973	宝胜股份	40,600	196,910.00	0.25
191	300138	晨光生物	11,000	196,900.00	0.25
192	605287	德才股份	8,300	196,710.00	0.25
193	300487	蓝晓科技	3,150	196,623.00	0.25
194	600789	鲁抗医药	30,600	196,452.00	0.25
195	000078	海王生物	61,000	196,420.00	0.25
196	000521	长虹美菱	25,700	196,348.00	0.25
197	600682	南京新百	24,500	196,245.00	0.25
198	002973	侨银股份	16,900	196,040.00	0.25
199	002978	安宁股份	6,100	195,871.00	0.25
200	300157	恒泰艾普	60,800	195,776.00	0.25

201	600612	老凤祥	2,800	195,664.00	0.25
202	600965	福成股份	30,900	195,597.00	0.25
203	002852	道道全	15,100	195,243.00	0.25
204	300958	建工修复	11,000	195,140.00	0.25
205	605567	春雪食品	15,200	195,016.00	0.25
206	603787	新日股份	11,600	194,996.00	0.25
207	002103	广博股份	32,500	194,675.00	0.25
208	600531	豫光金铅	30,900	194,670.00	0.25
209	002159	三特索道	10,700	194,633.00	0.25
210	601319	中国人保	33,300	194,472.00	0.25
211	603151	邦基科技	11,900	194,446.00	0.25
212	603129	春风动力	1,200	194,280.00	0.25
213	600526	菲达环保	40,300	194,246.00	0.25
214	300146	汤臣倍健	8,100	194,238.00	0.25
215	600035	楚天高速	47,600	194,208.00	0.25
216	600073	上海梅林	26,600	194,180.00	0.25
217	688063	派能科技	979	194,086.75	0.25
218	603215	比依股份	10,800	193,752.00	0.25
219	001230	劲旅环境	7,900	193,629.00	0.25
220	002659	凯文教育	40,500	193,590.00	0.25
221	002355	兴民智通	39,500	193,550.00	0.25
222	300449	汉邦高科	29,000	193,430.00	0.25
223	605266	健之佳	2,300	192,809.00	0.24
224	688377	迪威尔	7,668	192,083.40	0.24
225	600094	大名城	61,600	190,344.00	0.24
226	000885	城发环境	14,300	190,333.00	0.24
227	002867	周大生	10,700	190,246.00	0.24
228	600415	小商品城	22,300	190,219.00	0.24
229	688390	固德威	1,133	189,052.38	0.24
230	002568	百润股份	5,200	189,020.00	0.24
231	601668	中国建筑	32,400	185,976.00	0.24
232	601333	广深铁路	46,800	185,328.00	0.23
233	603345	安井食品	1,200	176,160.00	0.22
234	300750	宁德时代	60	13,727.40	0.02
235	002919	名臣健康	80	3,608.00	0.00
236	000028	国药一致	70	3,052.70	0.00
237	603052	可川科技	80	2,588.00	0.00
238	688078	龙软科技	45	2,319.75	0.00
239	003020	立方制药	50	1,850.50	0.00
240	603201	常润股份	60	1,375.80	0.00
241	603508	思维列控	48	818.40	0.00
242	300700	岱勒新材	40	762.00	0.00
243	301321	翰博高新	48	696.48	0.00

244	300855	图南股份	10	353.20	0.00
245	300970	华绿生物	13	303.68	0.00
246	300658	延江股份	20	131.00	0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	600729	重庆百货	1,968,149.00	2.49
2	600057	厦门象屿	1,667,323.00	2.11
3	002299	圣农发展	1,642,767.96	2.08
4	688556	高测股份	1,565,485.67	1.98
5	000063	中兴通讯	1,390,698.00	1.76
6	002563	森马服饰	1,318,475.00	1.67
7	002459	晶澳科技	1,297,323.00	1.64
8	000921	海信家电	1,284,297.00	1.63
9	300511	雪榕生物	1,267,396.00	1.61
10	603768	常青股份	1,249,948.00	1.58
11	600866	星湖科技	1,234,629.00	1.56
12	600397	安源煤业	1,226,065.00	1.55
13	601003	柳钢股份	1,212,159.00	1.54
14	002103	广博股份	1,203,656.00	1.52
15	601318	中国平安	1,189,466.00	1.51
16	688777	中控技术	1,176,946.55	1.49
17	002463	沪电股份	1,115,203.00	1.41
18	600035	楚天高速	1,110,075.00	1.41
19	002807	江阴银行	1,101,125.00	1.39
20	600583	海油工程	1,093,590.00	1.39

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	603083	剑桥科技	1,642,610.00	2.08
2	300308	中际旭创	1,615,768.00	2.05
3	002299	圣农发展	1,507,380.00	1.91
4	600729	重庆百货	1,494,251.00	1.89
5	002463	沪电股份	1,456,294.20	1.84
6	603768	常青股份	1,270,662.00	1.61
7	600057	厦门象屿	1,220,541.00	1.55
8	600215	派斯林	1,096,657.00	1.39
9	003030	祖名股份	1,054,547.00	1.34

10	601567	三星医疗	1,040,720.00	1.32
11	603108	润达医疗	1,038,741.00	1.32
12	000063	中兴通讯	1,035,895.00	1.31
13	600066	宇通客车	1,033,817.00	1.31
14	002103	广博股份	1,021,067.00	1.29
15	600961	株冶集团	1,012,034.00	1.28
16	600866	星湖科技	996,769.00	1.26
17	300761	立华股份	990,576.00	1.25
18	002702	海欣食品	980,630.00	1.24
19	603201	常润股份	960,298.00	1.22
20	301030	仕净科技	960,228.00	1.22

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	312,088,094.41
卖出股票收入（成交）总额	239,700,567.19

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投资。

#### 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投资。

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金未投资股指期货。

#### 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 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 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

华宝量化选股混合发起式截止 2023 年 06 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中，天合光能股份有限公司因公司分布式业务下属子公司未来分拆上市传闻；于 2022 年 12 月 06 日收到上海证券交易所监管工作函的处罚措施。

本基金管理人通过对上述上市公司进行进一步了解和分析，认为上述处分不会对公司的投资价值构成实质性影响，因此本基金管理人对上述证券的投资判断未发生改变。报告期内，本基金投资的前十名证券的其余的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

### 7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

本基金本报告期末未持有其他资产。

### 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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### 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(%)
华宝量化选股混合发起式 A	87	249,595.28	9,901,031.35	45.60	11,813,758.35	54.40

华宝量化选股混合发起式 C	300	186,234.63	20,022,313.43	35.84	35,848,074.69	64.16
合计	387	200,478.50	29,923,344.78	38.57	47,661,833.04	61.43

## 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例(%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	华宝量化选股混合发起式 A	200,301.92	0.9224
	华宝量化选股混合发起式 C	200,000.00	0.3580
	合计	400,301.92	0.5160

## 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、基金经理投资和研究部门负责人持有本开放式基金	华宝量化选股混合发起式 A	10~50
	华宝量化选股混合发起式 C	10~50
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	华宝量化选股混合发起式 A	10~50
	华宝量化选股混合发起式 C	10~50
	合计	10~50

## 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例(%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例(%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,001,041.77	12.89	10,001,041.77	12.89	不少于 3 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	10,001,041.77	12.89	10,001,041.77	12.89	-

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 2023 年 2 月 15 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	华宝量化选股混合发起式 A	华宝量化选股混合发起式 C
基金合同生效日 (2023 年 2 月 20 日)	19,742,180.45	74,223,121.88
基金份额总额		
基金合同生效日起至 报告期期末基金总申 购份额	3,925,223.93	21,358,109.96
减：基金合同生效日 起至报告期期末基金 总赎回份额	1,952,614.68	39,710,843.72
基金合同生效日起至 报告期期末基金拆分 变动份额	-	-
本报告期期末基金份 额总额	21,714,789.70	55,870,388.12

注：本基金合同生效日于 2023 年 02 月 20 日。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、基金管理人的重大人事变动

本报告期内，基金管理人无重大人事变动。

2、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，无涉及本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产和基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未发生变更。

## 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

目前该会计师事务所向本基金提供的审计服务持续期限为：本基金合同生效之日起至本报告期末。

## 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚的情况。

### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，托管人及其高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

## 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 (%)	
中信证券	2	551,788,661. 60	100.00	419,026.37	100.00	-

注：1、基金管理人选择交易单元的标准和程序如下：

(1) 选择标准：资力雄厚，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、本报告期租用的证券公司交易单元新增的有：中信证券。

### 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(%)

中信证券	2,210,107.04	100.00	317,803,000.00	100.00	-	-
------	--------------	--------	----------------	--------	---	---

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华宝量化选股混合型发起式证券投资基金（A类份额）基金产品资料概要	基金管理人网站	2023-02-08
2	华宝量化选股混合型发起式证券投资基金（C类份额）基金产品资料概要	基金管理人网站	2023-02-08
3	华宝量化选股混合型发起式证券投资基金基金份额发售公告	基金管理人网站, 中国证券报	2023-02-08
4	华宝量化选股混合型发起式证券投资基金基金合同	基金管理人网站	2023-02-08
5	华宝量化选股混合型发起式证券投资基金基金合同及招募说明书提示性公告	null	2023-02-08
6	华宝量化选股混合型发起式证券投资基金托管协议	基金管理人网站	2023-02-08
7	华宝量化选股混合型发起式证券投资基金招募说明书	基金管理人网站	2023-02-08
8	华宝基金关于华宝量化选股混合型发起式证券投资基金新增代销机构的公告	基金管理人网站, 中国证券报	2023-02-15
9	华宝基金管理有限公司关于华宝量化选股混合型发起式证券投资基金基金提前结束募集的公告	基金管理人网站, 中国证券报	2023-02-16
10	华宝量化选股混合型发起式证券投资基金基金合同生效公告	基金管理人网站, 中国证券报	2023-02-21
11	华宝基金关于旗下部分基金新增兴业证券股份有限公司为代销机构的公告	基金管理人网站, 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2023-04-19
12	华宝基金关于旗下部分基金新增兴业银行股份有限公司（银银平台）为代销机构的公告	基金管理人网站, 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2023-04-26
13	华宝基金关于旗下部分基金新增宁波银行同业易管家平台为代销机构的公告	基金管理人网站, 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2023-04-28
14	华宝基金关于旗下部分基金新增平安银行股份有限公司为代销机构的公告	基金管理人网站, 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2023-05-05
15	华宝基金关于旗下部分基金新增麦高证券有限责任公司为代销机构的公告	基金管理人网站, 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2023-05-08
16	华宝量化选股混合型发起式证券投资基金开放日常申购、赎回及转换和定期定额投资业务的公告	基金管理人网站, 中国证券报	2023-05-16

	期定额投资业务的公告		
--	------------	--	--

## § 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	20230628~20230630	0.00	19,922,303.01	0.00	19,922,303.01	25.68
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

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

中国证监会批准基金设立的文件；  
 华宝量化选股混合型发起式证券投资基金基金合同；  
 华宝量化选股混合型发起式证券投资基金招募说明书；  
 华宝量化选股混合型发起式证券投资基金托管协议；  
 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；  
 基金管理人报告期内在指定报刊上披露的各种公告；  
 基金托管人业务资格批件和营业执照。

### 12.2 存放地点

以上文件存于基金管理人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

2023 年 8 月 31 日