

华宝量化对冲策略混合型发起式证券投资 基金 2021 年中期报告

2021 年 6 月 30 日

基金管理人：华宝基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2021 年 8 月 27 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 月 25 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 2021 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	7
2.5 其他相关资料	7
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 其他指标	10
§ 4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	16
§ 5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
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	16
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	16
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表	16
6.2 利润表	18
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	19
6.4 报表附注	20
§ 7 投资组合报告	50
7.1 期末基金资产组合情况	50
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	50
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	51
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	55
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	57

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	57
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	57
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	58
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.....	58
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	58
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	58
7.12 投资组合报告附注.....	59
§ 8 基金份额持有人信息	60
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	60
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	61
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.....	61
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....	62
§ 9 开放式基金份额变动	62
§ 10 重大事件揭示	63
10.1 基金份额持有人大会决议.....	63
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.....	63
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	63
10.4 基金投资策略的改变.....	63
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	63
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.....	63
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	64
10.8 其他重大事件.....	67
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	68
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	68
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	68
§ 12 备查文件目录	68
12.1 备查文件目录.....	68
12.2 存放地点.....	69
12.3 查阅方式.....	69

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华宝量化对冲策略混合型发起式证券投资基金	
基金简称	华宝量化对冲混合	
基金主代码	000753	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2014 年 9 月 17 日	
基金管理人	华宝基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,618,513,484.05 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华宝量化对冲混合 A	华宝量化对冲混合 C
下属分级基金的交易代码	000753	000754
报告期末下属分级基金的份额总额	1,153,658,890.27 份	464,854,593.78 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在有效控制风险的基础上，运用股指期货等衍生工具对冲市场系统风险，追求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	<p>1、资产配置策略</p> <p>在资产配置方面，本基金主要运用股指期货等空头工具对持有的股票等权益类多头组合进行对冲操作，规避权益类多头组合的市场系统性风险；同时预留必要的现金，以应对保证金的增加要求或投资者的赎回申请。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>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。</p> <p>量化行业配置模型在参考相关指数的行业权重分布的基础上，结合行业景气度、投资时钟、行业动量和行业超跌偏离度等基本面和技术面模型，在整体风险水平可控的前提下，实现各行业权重的优化配置。</p> <p>根据对中国证券市场运行特征的长期研究、投研团队的长期投资实践和大量历史数据的实证检验，基金管理人量化投资团队开发了量化 Alpha 选股模型。该模型现阶段主要考虑估值、成长、盈利质量、市场预期等基本面因子以及股权激励、并购、重要股东投资行为、业绩超预期等事件驱动因子，通过实证分析和动态跟踪，以超额收益的水平和稳定性为目标确定各因子的优化权重，根据该模型的综合评分结果，在各行业中选择股票构建股票投资组合。</p>

	<p>当股票投资组合构建完成后，本基金将进一步根据组合内个股价格波动、风险收益变化、特殊事件等实际情况，动态优化个股权重，使股票组合的整体风险处于可控范围内。</p> <p>3、空头工具投资策略</p> <p>现阶段，本基金主要运用股指期货合约进行套期保值操作，规避市场系统性风险。在完全套保的理念下，本基金根据股票多头组合的市值计算股指期货合约卖单量，并根据市场变化对股指期货合约卖单量进行动态跟踪并适时调整。同时，综合考虑定价关系、套利机会、流动性以及保证金要求等因素，在不同股指期货合约之间进行动态配置，并适时进行合约展期操作，以求提高组合收益和套期保值的效果。</p> <p>未来，在基金参与融资融券、转融通业务及投资期权等其他金融工具的相关规定颁布后，基金管理人将按照中国证监会的规定及其他相关法律法规的要求，根据市场情况选择合适的空头工具对冲市场系统风险。</p> <p>4、其他绝对收益策略</p> <p>在主要利用市场中性策略获取 Alpha 收益的同时，本基金可根据市场情况的变化，适时运用其他绝对收益策略（如定向增发套利策略、并购套利策略、股指期货期现套利策略、股指期货跨期套利策略等），以求在控制市场系统性风险的前提下，进一步增强收益水平，降低收益波动性。</p> <p>5、固定收益类投资工具投资策略</p> <p>本基金基于流动性管理及策略性投资的需要，将投资于债券、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。</p> <p>6、其他金融工具投资策略</p> <p>在法律法规许可的前提下，本基金可基于谨慎原则运用权证等相关金融衍生工具对基金投资组合进行管理，以更好地实现本基金的投资目标。</p>
业绩比较基准	一年期银行定期存款利率（税后）
风险收益特征	<p>本基金为特殊类型的混合型基金，主要采用追求绝对收益的市场中性策略，与股票市场表现的相关性较低。相对股票型基金和一般的混合型基金，其预期风险较小。本基金实际的收益和风险主要取决于基金投资策略的有效性，因此收益不一定能超越业绩比较基准。</p>

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华宝基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	周雷	许俊
	联系电话	021-38505888	010-66594319
	电子邮箱	xxpl@fsfund.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-700-5588、400-820-5050、	95566

	021-38924558	
传真	021-38505777	010-66594942
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码	200120	100818
法定代表人	XIAOYI HELEN HUANG	刘连舸

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.fsfund.com
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	基金管理人	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021 年 1 月 1 日-2021 年 6 月 30 日)	
	华宝量化对冲混合 A	华宝量化对冲混合 C
本期已实现收益	-19,751,380.54	-7,303,194.68
本期利润	2,902,741.47	605,536.85
加权平均基金份额本期利润	0.0015	0.0013
本期加权平均净值利润率	0.13%	0.11%
本期基金份额净	0.42%	0.23%

值增长率		
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2021 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	208,631,077.10	74,774,556.56
期末可供分配基金份额利润	0.1808	0.1609
期末基金资产净值	1,362,289,967.37	539,629,150.34
期末基金份额净值	1.1808	1.1609
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2021 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	45.09%	42.68%

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、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华宝量化对冲混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	1.14%	0.30%	0.12%	0.00%	1.02%	0.30%
过去三个月	0.39%	0.21%	0.37%	0.00%	0.02%	0.21%
过去六个月	0.42%	0.27%	0.74%	0.00%	-0.32%	0.27%

过去一年	3.68%	0.22%	1.50%	0.00%	2.18%	0.22%
过去三年	16.08%	0.25%	4.50%	0.00%	11.58%	0.25%
自基金合同生效起 至今	45.09%	0.27%	11.21%	0.01%	33.88%	0.26%

华宝量化对冲混合 C

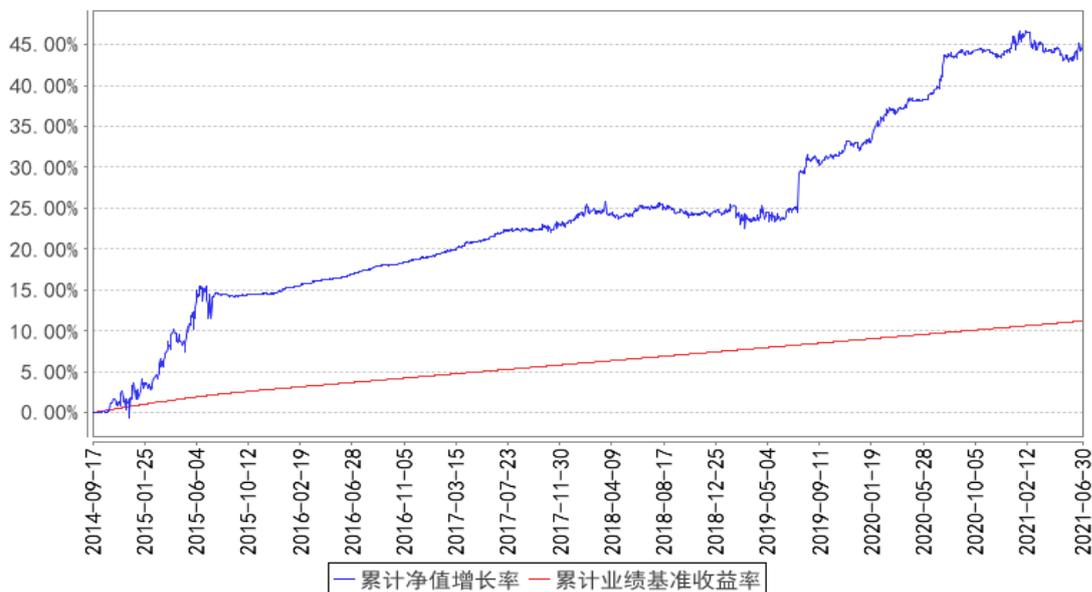
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	1.11%	0.30%	0.12%	0.00%	0.99%	0.30%
过去三个月	0.30%	0.21%	0.37%	0.00%	-0.07%	0.21%
过去六个月	0.23%	0.27%	0.74%	0.00%	-0.51%	0.27%
过去一年	3.27%	0.22%	1.50%	0.00%	1.77%	0.22%
过去三年	14.70%	0.25%	4.50%	0.00%	10.20%	0.25%
自基金合同生效起 至今	42.68%	0.27%	11.21%	0.01%	31.47%	0.26%

注：1、本基金的业绩比较基准为一年期银行定期存款利率（税后）

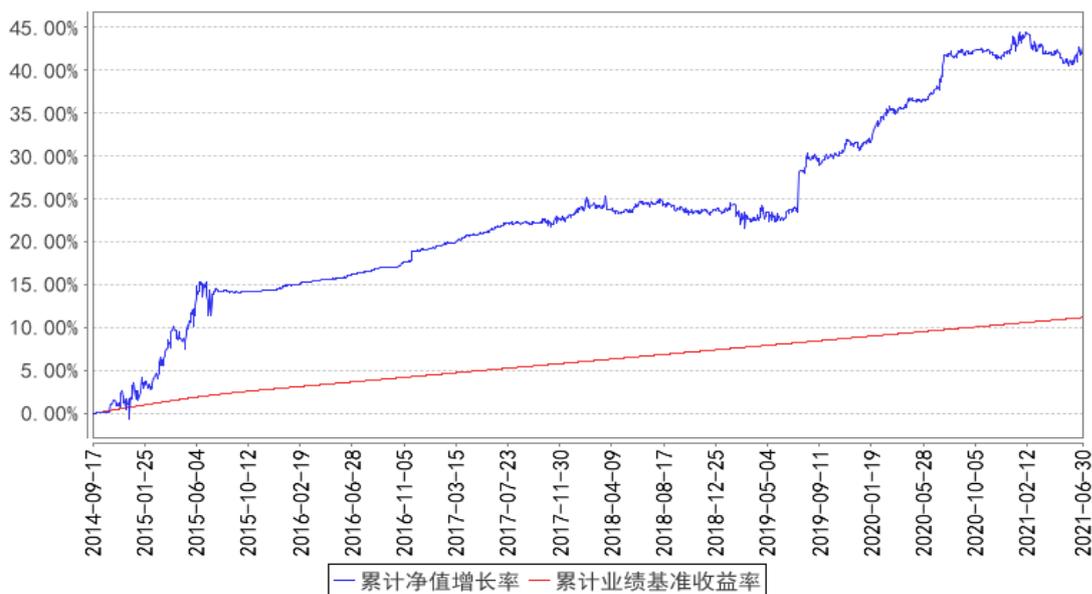
2、净值以及业绩比较基准相关数据计算中涉及天数的，包括所有交易日以及季末最后一个自然日（如非交易日）。

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

华宝量化对冲混合A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



华宝量化对冲混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：按照基金合同的约定，自基金成立日期的 6 个月内达到规定的资产组合，截至 2014 年 11 月 17 日，本基金已达到合同规定的资产配置比例。

3.3 其他指标

无

§ 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，公司注册资本为人民币 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与美国华平资产管理有限合伙（Warburg Pincus Asset Management, L.P.），持有股权占比分别为 51%和 49%。公司在北京、深圳等地设有分公司，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（2021 年 6 月 30 日），本公司正在管理运作的证券投资基金包括：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、华宝可转债债券型证券投资基金、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、华宝创新优选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、华宝标普中国 A 股红利机会指数证券投资基金 (LOF)、华宝中证银行交易型开放式指数证券投资基金、华宝绿色主题混合型证券投资基金、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、华宝致远混合型证券投资基金 (QDII)、华宝中证消费龙头指数证券投资基金 (LOF) 等共 108 只基金。

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		
王正	本基金基	2020 年	-	8 年	硕士。2012 年 7 月加入华宝基金管理有限

	金经理	1月2日			公司,先后担任助理量化分析师、分析师、基金经理助理等职务。2020年1月起任华宝量化对冲策略混合型发起式证券投资基金、华宝沪深300指数增强型发起式证券投资基金基金经理。2021年1月起任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500指数增强型发起式证券投资基金基金经理。2021年6月起任华宝安盈混合型证券投资基金基金经理。
徐林明	本基金基金经理、量化投资部总经理、量化投资总监、董事总经理	2014年9月17日	-	18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、投资副总监、量化投资部总经理等职务。现任量化投资部总经理、量化投资总监、董事总经理。2009年9月至2015年11月任华宝中证100指数型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月起任华宝科技先锋混合型证券投资基金基金经理。
唐雪倩	本基金的基金经理助理	2018年1月23日	-	5年	硕士。2015年加入华宝基金管理有限公司,先后担任助理量化分析师、分析师、基金经理助理等。2018年1月至2018年6月任华宝新动力一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理。2018年1月至2018年7月任华宝新回报一年定期开放混合型证券投资基金基金经理助理。2018年1月至2018年8月任华宝新优选一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理。2018年1月起任华宝量化对冲策略混合型发起式证券投资基金、华宝沪深300指数增强型发起式证券投资基金、华宝新价值灵活配置混合型证券投资基金、华宝新机遇灵活配置

					混合型证券投资基金（LOF）、华宝新起点灵活配置混合型证券投资基金、华宝新飞跃灵活配置混合型证券投资基金。2019 年 2 月起任华宝科技先锋混合型证券投资基金基金经理助理。2019 年 7 月起任华宝新活力灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理。
--	--	--	--	--	--

注：1、任职日期以及离任日期均以基金公告为准。

2、证券从业含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《华宝量化对冲策略混合型发起式证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋取最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，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

宏观环境来看，随着疫苗接种的推进新冠疫情逐渐得到控制，上半年全球经济持续复苏，国内工业生产及出口较为景气，但疫情期间扩张的流动性导致大宗商品普遍上涨，以 PPI 为代表的通胀指标快速上升。市场方面，上半年大盘整体表现不俗，沪深 300 指数累计上涨 0.24%，中证 500 指数上涨 6.93%，创业板指上涨 17.22%，但波动加剧。在经济复苏和通胀压力、流动性收紧预期的矛盾中市场呈现了较大的结构性调整，风格出现了明显切换。行业层面，与碳中和及国产替代相关的电气设备、电子等高景气行业以及与大宗商品涨价相关的钢铁、煤炭、有色、化工等周期性行业涨幅居前，而景气度弱的家用电器、保险、农林牧渔、房地产等板块跌幅居前。风格层面，上半年整体成长因子强于价值因子，尤其是二季度以来成长、分析师预期因子等持续强势，另外大小盘风格的切换也反映了市值下沉的资金趋势。总体而言，当前市场分化较为极致，景气度及业绩的变化趋势、成长的持续性和确定性是市场非常看重的要素，同时更加关注估值层面的约束，合理估值下的盈利能力和成长性仍然是判断股票投资价值的重要方向。

本报告期，基金仍然坚持稳健的市场中性投资策略，利用股指期货对股票组合进行对冲，剥离系统性风险。期间沪深 300 股指期货基差波动较大，一季度贴水持续扩大，二季度逐渐收敛。市场风格的切换及基差的大幅波动对基金净值造成一定扰动，但随着基差的修复，当前及未来一段时间预计是近年来较好的对冲环境。选股方面沿用此前的量化 Alpha 多因子选股模型，在沪深 300 成分股及各选成分股中精选估值和业绩相匹配、基本面优质、经营稳健、具有核心竞争力及性价比的标的，我们相信符合长期投资逻辑的成长、盈利、超预期等因子仍是未来超额收益的关键，基金整体的持仓风格较为均衡，在风控方面也较为严格。

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 0.42%；本报告期基金份额 C 净值增长率为 0.23%；同期业绩比较基准收益率为 0.74%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，中国仍然是疫情控制最好、经济复苏最快的经济体，国内经济仍将保持较强的活力与韧性，A 股的优质资产在全球横向比较来看仍有极强的配置吸引力，我们对市场的长期前景保持乐观态度。但另一方面，尽管货币政策大概率保持平稳，但通胀的压制依然存在，市场会容忍部分高景气板块的高估值，但不会有全面的估值扩张。风格的切换可能仍会往极端的方向演绎，市场波动也会随之加剧，在这种背景下我们将更加重视盈利的确定性、估值的合理性和成长的可持续性。在行业方面，一方面符合经济结构化转型及政策鼓励方向的电气设备新能源、半导

体、高端制造等长逻辑板块仍然有望保持较高的景气度；另一方面，前期调整充分、基本面预期边际改善的传统经济板块可能存在估值修复的机会，我们对此保持密切关注。

基金将继续保持稳健的市场中性操作思路，关注符合常识和逻辑的因子，在投资过程中注重对个股基本面质地的考察，利用量化模型甄选出具备良好经营能力、估值与成长匹配的优质公司来获取超额收益。

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、适用性的情况后及时修订估值方法。基金在投资新品种时，由估值委员会评价现有估值政策和程序的适用性。

(1) 日常估值流程

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

(2) 特殊业务估值流程

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人低于二百人或基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华宝量化对冲策略混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	163,449,782.48	13,025,258.54
结算备付金		148,892,821.75	274,187,961.83
存出保证金		161,265,925.33	211,153,710.36
交易性金融资产	6.4.7.2	1,504,489,249.70	2,017,669,975.20
其中：股票投资		1,385,215,018.86	1,809,823,361.30
基金投资		-	-
债券投资		119,274,230.84	207,846,613.90
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	95,900,000.00	748,200,000.00
应收证券清算款		27,078,662.05	54,523,133.48
应收利息	6.4.7.5	2,562,680.54	3,772,564.46
应收股利		-	-
应收申购款		1,964,575.61	4,366,236.81
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		2,105,603,697.46	3,326,898,840.68
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 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		33,344,437.83	66,174,131.09
应付赎回款		161,288,045.73	68,947,730.64
应付管理人报酬		1,779,708.35	2,667,597.13
应付托管费		355,941.68	533,519.44
应付销售服务费		176,880.48	179,739.77
应付交易费用	6.4.7.7	6,572,387.36	3,070,353.22
应交税费		7.05	1,210.08
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	167,171.27	333,980.59
负债合计		203,684,579.75	141,908,261.96
所有者权益：			

实收基金	6.4.7.9	1,618,513,484.05	2,715,539,269.24
未分配利润	6.4.7.10	283,405,633.66	469,451,309.48
所有者权益合计		1,901,919,117.71	3,184,990,578.72
负债和所有者权益总计		2,105,603,697.46	3,326,898,840.68

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额总额 1,618,513,484.05 份，其中华宝量化对冲混合 A 基金份额总额 1,153,658,890.27 份，基金份额净值 1.1808；华宝量化对冲混合 C 基金份额总额 464,854,593.78 份，基金份额净值 1.1609。

6.2 利润表

会计主体：华宝量化对冲策略混合型发起式证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		32,491,635.08	35,503,692.02
1. 利息收入		11,595,407.88	3,527,427.15
其中：存款利息收入	6.4.7.11	3,306,023.24	1,706,375.33
债券利息收入		2,415,010.58	546,100.42
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		5,874,374.06	1,274,951.40
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-11,896,957.55	34,171,224.18
其中：股票投资收益	6.4.7.12	86,004,970.03	29,643,994.97
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	463,488.24	93,586.67
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-110,290,079.37	2,332,263.10
股利收益	6.4.7.16	11,924,663.55	2,101,379.44
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	30,562,853.54	-3,447,860.58
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	2,230,331.21	1,252,901.27
减：二、费用		28,983,356.76	6,285,082.77

1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	14,152,456.94	3,125,810.82
2. 托管费	6.4.10.2.2	2,830,491.33	625,162.21
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	1,110,826.29	700,454.88
4. 交易费用	6.4.7.19	10,746,420.46	1,705,088.12
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		402.76	22,586.41
7. 其他费用	6.4.7.20	142,758.98	105,980.33
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		3,508,278.32	29,218,609.25
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		3,508,278.32	29,218,609.25

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华宝量化对冲策略混合型发起式证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 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）	2,715,539,269.24	469,451,309.48	3,184,990,578.72
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	3,508,278.32	3,508,278.32
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）	-1,097,025,785.19	-189,553,954.14	-1,286,579,739.33
其中：1. 基金申购款	777,878,277.86	135,016,120.52	912,894,398.38
2. 基金赎回款	-1,874,904,063.05	-324,570,074.66	-2,199,474,137.71
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)	1,618,513,484.05	283,405,633.66	1,901,919,117.71
项目	上年度可比期间 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)	370,194,344.82	44,416,625.38	414,610,970.20
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	29,218,609.25	29,218,609.25
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)	594,409,944.47	102,121,534.63	696,531,479.10
其中：1. 基金申购款	889,148,928.21	146,964,688.68	1,036,113,616.89
2. 基金赎回款	-294,738,983.74	-44,843,154.05	-339,582,137.79
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)	964,604,289.29	175,756,769.26	1,140,361,058.55

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

华宝量化对冲策略混合型发起式证券投资基金(原名为华宝兴业量化对冲策略混合型发起式证券投资基金,以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2014]第737号《关于核准华宝兴业量化对冲策略混合型发起式证券投资基金募集的批复》核准,由华宝基金管理有限公司(原华宝兴业基金管理有限公司,已于2017年10月17日办理完

成工商变更登记)依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华宝兴业量化对冲策略混合型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式, 存续期限不定, 首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 606,936,516.77 元, 业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2014)第 536 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华宝兴业量化对冲策略混合型发起式证券投资基金基金合同》于 2014 年 9 月 17 日生效, 基金合同生效日的基金份额总额为 607,038,069.95 份基金份额(A 类基金份额 539,601,058.43 份, C 类基金份额 67,437,011.52 份), 其中认购资金利息折合 101,553.18 份基金份额。本基金的基金管理人为华宝基金管理有限公司, 基金托管人为中国银行股份有限公司。

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

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华宝量化对冲策略混合型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定, 本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具, 包括国内依法发行上市的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金权益类空头头寸的价值占本基金权益类多头头寸的价值的比例范围在 80%-120%之间。其中: 权益类空头头寸的价值是指融券卖出的股票市值、卖出股指期货的合约价值及持有的其他可投资的权益类空头工具价值的合计值; 权益类多头头寸的价值是指买入持有的股票市值、买入股指期货的合约价值及持有的其他可投资的权益类多头工具价值的合计值。每个交易日日终, 持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和, 不得超过基金资产净值的 95%。其中: 有价证券指股票、债券(不含到期日在一年以内的政府债券)、权证、资产支持证券、买入返售金融资产(不含质押式回购)等。在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后, 基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为: 一年期银行定期存款利率(税后)。

本财务报表由本基金的基金管理人华宝基金管理有限公司于 2021 年 8 月 27 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华宝量化对冲策略混合型发起式证券投资基金基金合同》和在财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 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

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
活期存款	163,449,782.48
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	163,449,782.48
----	----------------

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,269,385,993.46	1,385,215,018.86	115,829,025.40
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	118,769,763.31	119,274,230.84
	银行间市场	-	-
	合计	118,769,763.31	119,274,230.84
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	1,388,155,756.77	1,504,489,249.70	116,333,492.93

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	-1,324,297,311.28	-	-	
其中：股指期货投资	-1,324,297,311.28	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	-1,324,297,311.28	-	-	

注：衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为0。于2021年06月30日，本基金持有527手IF2107空头持仓，合约市值-820,728,720.00元，公允价值变动1,432,731.28元；335手IF2109空头持仓，合约市值-519,223,200.00元，公允价值变动-17,087,340.00元。上述股指期货投资合约市值合计-1,339,951,920.00元，公允价值变动合计-15,654,608.72元，抵销相关期货暂收款15,654,608.72元后的净额为0。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	95,900,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	95,900,000.00	-

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 2021年6月30日
应收活期存款利息	2,964.83
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	86,239.40
应收债券利息	2,473,264.11
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	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	212.20
合计	2,562,680.54

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 2021年6月30日
交易所市场应付交易费用	6,572,387.36

银行间市场应付交易费用	-
合计	6,572,387.36

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	63,032.92
应付证券出借违约金	-
预提费用	104,138.35
合计	167,171.27

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

华宝量化对冲混合 A

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,256,292,463.92	2,256,292,463.92
本期申购	443,786,665.48	443,786,665.48
本期赎回（以“-”号填列）	-1,546,420,239.13	-1,546,420,239.13
-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	1,153,658,890.27	1,153,658,890.27

华宝量化对冲混合 C

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	459,246,805.32	459,246,805.32
本期申购	334,091,612.38	334,091,612.38
本期赎回（以“-”号填列）	-328,483,823.92	-328,483,823.92
-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	464,854,593.78	464,854,593.78

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。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

华宝量化对冲混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	468,363,117.69	-71,579,724.42	396,783,393.27
本期利润	-19,751,380.54	22,654,122.01	2,902,741.47
本期基金份额交易产生的变动数	-226,704,143.06	35,649,085.42	-191,055,057.64
其中：基金申购款	84,041,381.85	-2,735,552.06	81,305,829.79
基金赎回款	-310,745,524.91	38,384,637.48	-272,360,887.43
本期已分配利润	-	-	-
本期末	221,907,594.09	-13,276,516.99	208,631,077.10

华宝量化对冲混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	87,502,565.60	-14,834,649.39	72,667,916.21
本期利润	-7,303,194.68	7,908,731.53	605,536.85
本期基金份额交易产生的变动数	341,579.53	1,159,523.97	1,501,103.50
其中：基金申购款	58,567,865.39	-4,857,574.66	53,710,290.73
基金赎回款	-58,226,285.86	6,017,098.63	-52,209,187.23
本期已分配利润	-	-	-
本期末	80,540,950.45	-5,766,393.89	74,774,556.56

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
活期存款利息收入	139,302.83
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	3,157,203.24
其他	9,517.17
合计	3,306,023.24

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 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	86,004,970.03
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	86,004,970.03

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 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出股票成交总额	3,633,147,240.66
减：卖出股票成本总额	3,547,142,270.63
买卖股票差价收入	86,004,970.03

6.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无

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

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	463,488.24
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	463,488.24

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	177,248,786.17
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	173,076,692.85
减：应收利息总额	3,708,605.08
买卖债券差价收入	463,488.24

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

无

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

无

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

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

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2021年1月1日至2021年6月30日
股指期货投资收益	-110,290,079.37

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	11,924,663.55
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	11,924,663.55

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
1. 交易性金融资产	-35,413,625.83
股票投资	-36,514,053.12
债券投资	1,100,427.29
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	65,976,479.37
权证投资	-
期货投资	65,976,479.37
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	30,562,853.54

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
基金赎回费收入	2,167,445.65
基金转换费收入	62,885.56
合计	2,230,331.21

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 50% 归入基金资产。

2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中不低于转出基金的赎回费的 50% 归入转出基金的基金资产。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
交易所市场交易费用	10,514,052.59
银行间市场交易费用	-
股指期货交易费用	232,367.87
合计	10,746,420.46

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
审计费用	44,630.98
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	20,020.63
账户维护费	18,000.00
上清所 CFCA 证书服务费	600.00
合计	142,758.98

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，本基金无需要披露的重大或有事项。

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（“华宝基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人、基金销售机构
华宝信托有限责任公司（“华宝信托”）	基金管理人的股东
华平资产管理有限合伙（Warburg Pincus Asset Management, L.P.）	基金管理人的股东
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 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比例(%)
华宝证券	75,125,109.13	1.11	-	-

6.4.10.1.2 债券交易

6.4.10.1.3 债券回购交易

6.4.10.1.4 权证交易

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
华宝证券	68,461.68	1.10	68,461.68	1.04
关联方名称	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
-	-	-	-	-

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

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

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	14,152,456.94	3,125,810.82
其中: 支付销售机构的客户维护费	2,343,087.42	1,007,556.63

注: 支付基金管理人华宝基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.00% 的年费率计提, 逐日累计至每月月底, 按月支付。其计算公式为:

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.00\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.2.2 基金托管费

单位: 人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	2,830,491.33	625,162.21

注: 支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.2% 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:

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.2\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.2.3 销售服务费

单位: 人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华宝量化对冲混合 A	华宝量化对冲混合 C	合计
中国银行	-	216,793.32	216,793.32
华宝证券	-	129.63	129.63
华宝基金	-	36,642.82	36,642.82
合计	-	253,565.77	253,565.77
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		

	华宝量化对冲混合 A	华宝量化对冲混合 C	合计
中国银行	-	10,390.58	10,390.58
华宝基金	-	102,879.20	102,879.20
合计	-	113,269.78	113,269.78

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

本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期内及上年度可比期间均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

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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
	华宝量化对冲混合 A	华宝量化对冲混合 C
基金合同生效日（2014 年 9 月 17 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	21,989,995.33	2,947,386.26
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	21,989,995.33	2,947,386.26
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.91%	0.63%
项目	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日
	华宝量化对冲混合 A	华宝量化对冲混合 C
基金合同生效日（2014年9月17日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	13,480,208.10	2,947,386.26
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	13,480,208.10	2,947,386.26
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	2.14%	0.88%

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

份额单位：份

华宝量化对冲混合 A

关联方名称	本期末 2021年6月30日		上年度末 2020年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例 (%)	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例 (%)
交通银行股份有限公司—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）	-	-	1,726,732.45	0.0800

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 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入

中国银行股份有限公司	163,449,782.48	139,302.83	95,170,581.25	54,995.11
------------	----------------	------------	---------------	-----------

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末(2021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
300614	百川畅银	2021年5月18日	2021年11月25日	新股锁定	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02	-
300919	中伟股份	2020年12月15日	2021年07月02日	新股锁定	24.6	163	610	15,006.00	99,430.00	-
300926	博俊科技	2020年12月29日	2021年07月12日	新股锁定	10.76	22.20	359	3,862.84	7,969.80	-
300927	江天化学	2020年12月29日	2021年7月7日	新股锁定	13.39	30.10	217	2,905.63	6,531.70	-
300929	华骐环保	2021年1月	2021年07	新股锁定	13.87	29.55	183	2,538.21	5,407.65	-

		12日	月21日							
300930	屹通新材	2021年1月13日	2021年7月21日	新股锁定	13.11	24.48	322	4,221.42	7,882.56	-
300931	通用电梯	2021年1月13日	2021年7月21日	新股锁定	4.31	13.11	672	2,896.32	8,809.92	-
300933	中辰股份	2021年1月15日	2021年7月22日	新股锁定	3.37	10.44	1,112	3,747.44	11,609.28	-
300937	药易购	2021年1月20日	2021年7月27日	新股锁定	12.25	53.71	244	2,989.00	13,105.24	-
300940	南极光	2021年1月27日	2021年8月3日	新股锁定	12.76	43.38	307	3,917.32	13,317.66	-
300942	易瑞生物	2021年2月2日	2021年8月9日	新股锁定	5.31	28.52	443	2,352.33	12,634.36	-
300943	春晖智控	2021年2月3日	2021年8月10日	新股锁定	9.79	23.01	255	2,496.45	5,867.55	-
300945	曼卡龙	2021年2月3日	2021年8月10日	新股锁定	4.56	18.88	474	2,161.44	8,949.12	-
300948	冠中生态	2021年2月18日	2021年8月25日	新股锁定	13.00	27.42	324	2,808.00	8,884.08	-
300950	德固特	2021年2月24日	2021年9月3日	新股锁定	8.41	39.13	219	1,841.79	8,569.47	-
300952	恒辉安防	2021年3月3日	2021年9月13日	新股锁定	11.72	27.08	340	3,984.80	9,207.20	-
300953	震裕	2021	2021	新股锁	28.77	99.85	240	6,904.80	23,964.00	-

	科技	年 3 月 11 日	年 9 月 22 日	定							
300955	嘉亨 家化	2021 年 3 月 16 日	2021 年 9 月 24 日	新股锁 定	16.53	46.07	232	3,834.96	10,688.24		-
300956	英力 股份	2021 年 3 月 16 日	2021 年 9 月 27 日	新股锁 定	12.85	25.80	371	4,767.35	9,571.80		-
300957	贝泰 妮	2021 年 3 月 18 日	2021 年 9 月 27 日	新股锁 定	47.33	251.96	853	40,372.49	214,921.88		-
300958	建工 修复	2021 年 3 月 18 日	2021 年 9 月 29 日	新股锁 定	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00		-
300960	通业 科技	2021 年 3 月 22 日	2021 年 9 月 29 日	新股锁 定	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04		-
300961	深水 海纳	2021 年 3 月 23 日	2021 年 9 月 30 日	新股锁 定	8.48	22.07	394	3,341.12	8,695.58		-
300962	中金 辐照	2021 年 3 月 29 日	2021 年 10 月 11 日	新股锁 定	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12		-
300963	中洲 特材	2021 年 3 月 30 日	2021 年 10 月 11 日	新股锁 定	12.13	22.49	283	3,432.79	6,364.67		-
300966	共同 药业	2021 年 3 月 31 日	2021 年 10 月 11 日	新股锁 定	8.24	31.54	286	2,356.64	9,020.44		-
300967	晓鸣 股份	2021 年 4 月 2 日	2021 年 10 月 13 日	新股锁 定	4.54	11.54	507	2,301.78	5,850.78		-
300968	格林	2021	2021	新股锁	6.87	12.07	1,162	7,982.94	14,025.34		-

	精密	年 4 月 6 日	年 10 月 15 日	定							
300971	博亚精工	2021 年 4 月 7 日	2021 年 10 月 15 日	新股锁定	18.24	28.29	245	4,468.80	6,931.05		-
300972	万辰生物	2021 年 4 月 8 日	2021 年 10 月 19 日	新股锁定	7.19	12.65	430	3,091.70	5,439.50		-
300973	立高食品	2021 年 4 月 8 日	2021 年 10 月 15 日	新股锁定	28.28	115.71	360	10,180.80	41,655.60		-
300975	商络电子	2021 年 4 月 14 日	2021 年 10 月 21 日	新股锁定	5.48	13.03	492	2,696.16	6,410.76		-
300978	东箭科技	2021 年 4 月 15 日	2021 年 10 月 26 日	新股锁定	8.42	13.60	593	4,993.06	8,064.80		-
300979	华利集团	2021 年 4 月 15 日	2021 年 10 月 26 日	新股锁定	33.22	87.50	925	30,728.50	80,937.50		-
300981	中红医疗	2021 年 4 月 19 日	2021 年 10 月 27 日	新股锁定	48.59	90.39	601	29,202.59	54,324.39		-
300982	苏文电能	2021 年 4 月 19 日	2021 年 10 月 27 日	新股锁定	15.83	45.29	317	5,018.11	14,356.93		-
300985	致远新能	2021 年 4 月 21 日	2021 年 10 月 29 日	新股锁定	24.90	24.81	295	7,345.50	7,318.95		-
300986	志特新材	2021 年 4 月 21 日	2021 年 11 月 1 日	新股锁定	14.79	30.57	264	3,904.56	8,070.48		-
300987	川网传媒	2021 年 4 月	2021 年 11	新股锁定	6.79	26.81	301	2,043.79	8,069.81		-

		28 日	月 11 日							
300991	创益通	2021 年 5 月 12 日	2021 年 11 月 22 日	新股锁定	13.06	26.51	254	3,317.24	6,733.54	-
300992	泰福泵业	2021 年 5 月 17 日	2021 年 11 月 25 日	新股锁定	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00	-
300993	玉马遮阳	2021 年 5 月 17 日	2021 年 11 月 24 日	新股锁定	12.10	19.29	410	4,961.00	7,908.90	-
300995	奇德新材	2021 年 5 月 17 日	2021 年 11 月 26 日	新股锁定	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	-
300996	普联软件	2021 年 5 月 26 日	2021 年 12 月 3 日	新股锁定	20.81	42.23	241	5,015.21	10,177.43	-
300997	欢乐家	2021 年 5 月 26 日	2021 年 12 月 2 日	新股锁定	4.94	13.05	928	4,584.32	12,110.40	-
300998	宁波方正	2021 年 5 月 25 日	2021 年 12 月 2 日	新股锁定	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	-
301002	崧盛股份	2021 年 5 月 27 日	2021 年 12 月 7 日	新股锁定	18.71	57.62	201	3,760.71	11,581.62	-
301004	嘉益股份	2021 年 6 月 18 日	2021 年 12 月 27 日	新股锁定	7.81	21.94	312	2,436.72	6,845.28	-
301007	德迈仕	2021 年 6 月 4 日	2021 年 12 月 16 日	新股锁定	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	-
301010	晶雪节能	2021 年 6 月 9 日	2021 年 12 月 20 日	新股锁定	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	-
301011	华立科技	2021 年 6 月	2021 年 12 月	新股锁定	14.20	33.84	175	2,485.00	5,922.00	-

		9 日	月 17 日							
301012	扬电科技	2021 年 6 月 15 日	2021 年 12 月 22 日	新股锁定	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20	-
301015	百洋医药	2021 年 6 月 22 日	2021 年 12 月 30 日	新股锁定	7.64	38.83	462	3,529.68	17,939.46	-
301016	雷尔伟	2021 年 6 月 23 日	2021 年 12 月 30 日	新股锁定	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50	-
301017	漱玉平民	2021 年 6 月 23 日	2021 年 7 月 5 日	新股流通受限	8.86	8.86	4,995	44,255.70	44,255.70	-
301017	漱玉平民	2021 年 06 月 23 日	2022 年 01 月 05 日	新股锁定	8.86	8.86	555	4,917.30	4,917.30	-
301018	申菱环境	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 7 日	新股流通受限	8.29	8.29	7,029	58,270.41	58,270.41	-
301018	申菱环境	2021 年 06 月 28 日	2022 年 01 月 07 日	新股锁定	8.29	8.29	782	6,482.78	6,482.78	-
301021	英诺激光	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 6 日	新股流通受限	9.46	9.46	2,609	24,681.14	24,681.14	-
301021	英诺激光	2021 年 06 月 28 日	2022 年 01 月 06 日	新股锁定	9.46	9.46	290	2,743.40	2,743.40	-
605162	新中港	2021 年 6 月 29 日	2021 年 7 月 7 日	新股流通受限	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39	-
605287	德才股份	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 6 日	新股流通受限	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-
688070	纵横股份	2021 年 2 月 2 日	2021 年 8 月 10 日	新股锁定	23.16	34.47	2,407	55,746.12	82,969.29	-

			日								
688087	英科再生	2021年6月30日	2021年7月9日	新股流通受限	21.96	21.96	2,469	54,219.24	54,219.24		-
688092	爱科科技	2021年3月12日	2021年9月22日	新股锁定	19.11	33.21	1,137	21,728.07	37,759.77		-
688226	威腾电气	2021年6月28日	2021年7月7日	新股流通受限	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06		-
688239	航宇科技	2021年6月25日	2021年7月5日	新股流通受限	11.48	11.48	4,926	56,550.48	56,550.48		-
688260	昀冢科技	2021年3月25日	2021年10月8日	新股锁定	9.63	16.41	2,990	28,793.70	49,065.90		-
688319	欧林生物	2021年5月31日	2021年12月8日	新股锁定	9.88	27.34	3,412	33,710.56	93,284.08		-
688533	上声电子	2021年4月9日	2021年10月19日	新股锁定	7.72	19.11	3,493	26,965.96	66,751.23		-
688607	康众医疗	2021年1月25日	2021年8月2日	新股锁定	23.21	44.50	1,890	43,866.90	84,105.00		-
688656	浩欧博	2021年1月6日	2021年7月13日	新股锁定	35.26	72.60	1,371	48,341.46	99,534.60		-
688661	和林微纳	2021年3月19日	2021年9月29日	新股锁定	17.71	84.01	1,452	25,714.92	121,982.52		-
688677	海泰新光	2021年2月18日	2021年8月26日	新股锁定	35.76	103.23	1,768	63,223.68	182,510.64		-
688687	凯因科技	2021年1月29日	2021年8月9日	新股锁定	18.98	27.98	5,354	101,618.92	149,804.92		-
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券											
证券	证券	成功	可流通	流通受	认购	期末估	数量	期末	期末估值总	备注	

代码	名称	认购日	日	限类型	价格	值单价	(单位:张)	成本总额	额	
113049	长汽转债	2021年6月10日	2021年7月8日	新债未上市	100	100	1,270	127,000.00	127,000.00	-
123117	健帆转债	2021年6月23日	2021年7月12日	新债未上市	100	100	1,592	159,200.00	159,200.00	-
127038	国微转债	2021年6月10日	2021年7月14日	新债未上市	100	100	3,426	342,600.00	342,600.00	-

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

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

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

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为特殊类型的混合型基金，主要采用追求绝对收益的市场中性策略，与股票市场表现的相关性较低。相对股票型基金和一般的混合型基金，其预期风险较小。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资、股指期货等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，公司内部监督和反馈系统包括内部控制委员会、督察长、合规审计部、风险管理部、各部门负责人和风险控制联络人、各业务岗位。内部控制委员会负责对公司经营管理和基金运作中的风险进行评估并研究制订相应的控制制度。督察长向董事会负责，总管公司的内控事务并独立地就内控制度的执行情况履行检查、评价、报告和建议职能。风险管理部在督察长指导下对公司内部控制运行情况进行监控，主要针对公司内部控制制度的总体构架和内部控制的目标进行评估并提出改进意见；合规审计部在督察长的领导下对各部门和岗位的内部控制执行情况进行监督和核查，同时对内控的失控点进行查漏并责令改正。

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款均存放于大型股份制商业银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

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

6.4.13.3 流动性风险

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

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

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种

比例以及组合在短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上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股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。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

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

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

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021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	163,449,782.48	-	-	-	163,449,782.48
结算备付金	148,892,821.75	-	-	-	148,892,821.75
存出保证金	471,694.93	-	-	160,794,230.40	161,265,925.33
交易性金融资产	118,060,630.84	1,213,600.00	-	1,385,215,018.86	1,504,489,249.70
买入返售金融资产	95,900,000.00	-	-	-	95,900,000.00
应收利息	-	-	-	2,562,680.54	2,562,680.54
应收申购款	-	-	-	1,964,575.61	1,964,575.61
应收证券清算款	-	-	-	27,078,662.05	27,078,662.05
资产总计	526,774,930.00	1,213,600.00	-	1,577,615,167.46	2,105,603,697.46
负债					
应付赎回款	-	-	-	161,288,045.73	161,288,045.73
应付管理人报酬	-	-	-	1,779,708.35	1,779,708.35
应付托管费	-	-	-	355,941.68	355,941.68
应付证券清算款	-	-	-	33,344,437.83	33,344,437.83
应付销售服务费	-	-	-	176,880.48	176,880.48
应付交易费用	-	-	-	6,572,387.36	6,572,387.36
应交税费	-	-	-	7.05	7.05
其他负债	-	-	-	167,171.27	167,171.27
负债总计	-	-	-	203,684,579.75	203,684,579.75
利率敏感度缺口	526,774,930.00	1,213,600.00	-	1,373,930,587.71	1,901,919,117.71
上年度末 2020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	13,025,258.54	-	-	-	13,025,258.54
结算备付金	274,187,961.83	-	-	-	274,187,961.83
存出保证金	332,720.76	-	-	210,820,989.60	211,153,710.36
交易性金融资产	189,164,382.30	18,208,600.00	473,631.60	1,809,823,361.30	2,017,669,975.20
买入返售金融资产	748,200,000.00	-	-	-	748,200,000.00
应收利息	-	-	-	3,772,564.46	3,772,564.46
应收申购款	1,120.43	-	-	4,365,116.38	4,366,236.81
应收证券清算款	-	-	-	54,523,133.48	54,523,133.48
资产总计	1,224,911,443.86	18,208,600.00	473,631.60	2,083,305,165.22	3,326,898,840.68
负债	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	68,947,730.64	68,947,730.64
应付管理人报酬	-	-	-	2,667,597.13	2,667,597.13
应付托管费	-	-	-	533,519.44	533,519.44
应付证券清算款	-	-	-	66,174,131.09	66,174,131.09
应付销售服务费	-	-	-	179,739.77	179,739.77
应付交易费用	-	-	-	3,070,353.22	3,070,353.22
应交税费	-	-	-	1,210.08	1,210.08
其他负债	-	-	-	333,980.59	333,980.59
负债总计	-	-	-	141,908,261.96	141,908,261.96
利率敏感度缺口	1,224,911,443.86	18,208,600.00	473,631.60	1,941,396,903.26	3,184,990,578.72

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本报告期末，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 6.27% (上年度末：6.53%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响 (上年度末：同)。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，基金管理人主要运用股指期货等空头工具对持有的股票等权益类多头组合进行对冲操作，规避权益类多头组合的市场系统性风险；同时预留必要的现金，以应对保证金的增加要求或投资者的赎回申请。在股票投资方面，主要采用量化行业配置模型和量化本基金主要采用量化行业配置模型和量化 Alpha 选股模型构建指数增强股票组合，严格控制运作风险，并根据市场变化趋势，定期对模型进行调整，以改进模型的有效性，最大化超额收益。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金的投资组合比例为：本基金权益类空头头寸的价值占本基金权益类多头头寸的价值的比例范围在 80%-120%之间。每个交易日日终，持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%。在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日		上年度末 2020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	1,385,215,018.86	72.83	1,809,823,361.30	56.82
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	1,385,215,018.86	72.83	1,809,823,361.30	56.82

注：其他包含在期货交易所交易的期货投资。在当日无负债结算制度下，期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 0。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
	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（2021年6月30日）	上年度末（2020年12月31日）
分析	1. 业绩比较基准上升 5%	145,127,156.30	1,203,647.17
	2. 业绩比较基准下降 5%	-145,127,156.30	-1,203,647.17

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) 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。

(b) 持续的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 1,383,035,904.23 元，属于第二层次的余额为 121,453,345.47 元，无属于第三层次的余额(上年度末：第一层次 1,821,118,935.65 元，第二层次 196,551,039.55 元，无第三层次)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会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将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于本报告期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(上年度末：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	1,385,215,018.86	65.79
	其中：股票	1,385,215,018.86	65.79
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	119,274,230.84	5.66
	其中：债券	119,274,230.84	5.66
	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	95,900,000.00	4.55
	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	312,342,604.23	14.83
8	其他各项资产	192,871,843.53	9.16
9	合计	2,105,603,697.46	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	11,290.28	0.00
B	采矿业	20,986,082.00	1.10
C	制造业	832,605,747.86	43.78
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	15,474,444.39	0.81
E	建筑业	10,492,986.37	0.55

F	批发和零售业	13,761,732.58	0.72
G	交通运输、仓储和邮政业	34,860,608.00	1.83
H	住宿和餐饮业	3,906,770.00	0.21
I	信息传输、软件和信息技术服务业	25,148,164.04	1.32
J	金融业	303,413,182.45	15.95
K	房地产业	23,175,693.90	1.22
L	租赁和商务服务业	32,816,508.00	1.73
M	科学研究和技术服务业	27,666,321.20	1.45
N	水利、环境和公共设施管理业	44,438.33	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	36,254,849.46	1.91
R	文化、体育和娱乐业	4,596,200.00	0.24
S	综合	-	-
	合计	1,385,215,018.86	72.83

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	38,604	79,396,846.80	4.17
2	600036	招商银行	990,400	53,669,776.00	2.82
3	000858	五粮液	176,800	52,666,952.00	2.77
4	601318	中国平安	508,300	32,673,524.00	1.72
5	601012	隆基股份	350,272	31,118,164.48	1.64
6	600030	中信证券	1,138,600	28,396,684.00	1.49
7	603259	药明康德	176,680	27,666,321.20	1.45
8	002415	海康威视	418,461	26,990,734.50	1.42
9	300059	东方财富	795,128	26,072,247.12	1.37
10	601888	中国中免	85,540	25,670,554.00	1.35
11	000333	美的集团	358,798	25,607,413.26	1.35
12	600809	山西汾酒	55,200	24,729,600.00	1.30
13	000001	平安银行	946,800	21,416,616.00	1.13
14	603986	兆易创新	108,580	20,402,182.00	1.07
15	002475	立讯精密	434,331	19,979,226.00	1.05
16	002049	紫光国微	120,200	18,533,638.00	0.97
17	603501	韦尔股份	56,100	18,064,200.00	0.95
18	000063	中兴通讯	514,900	17,110,127.00	0.90

19	002594	比亚迪	66,640	16,726,640.00	0.88
20	601211	国泰君安	926,800	15,885,352.00	0.84
21	600900	长江电力	749,100	15,461,424.00	0.81
22	600309	万华化学	139,700	15,202,154.00	0.80
23	688396	华润微	167,000	15,200,340.00	0.80
24	601166	兴业银行	739,283	15,192,265.65	0.80
25	300015	爱尔眼科	208,177	14,776,403.46	0.78
26	002179	中航光电	184,500	14,579,190.00	0.77
27	300274	阳光电源	121,200	13,945,272.00	0.73
28	600031	三一重工	475,600	13,825,692.00	0.73
29	002142	宁波银行	353,534	13,777,219.98	0.72
30	300122	智飞生物	73,400	13,705,982.00	0.72
31	600104	上汽集团	618,500	13,588,445.00	0.71
32	600919	江苏银行	1,906,900	13,538,990.00	0.71
33	600763	通策医疗	32,900	13,521,900.00	0.71
34	601009	南京银行	1,279,000	13,455,080.00	0.71
35	600276	恒瑞医药	195,088	13,260,131.36	0.70
36	603799	华友钴业	115,861	13,231,326.20	0.70
37	000776	广发证券	870,460	13,178,764.40	0.69
38	002241	歌尔股份	293,800	12,557,012.00	0.66
39	601838	成都银行	981,700	12,408,688.00	0.65
40	000725	京东方 A	1,942,800	12,123,072.00	0.64
41	002311	海大集团	147,400	12,027,840.00	0.63
42	300014	亿纬锂能	114,000	11,848,020.00	0.62
43	002821	凯莱英	31,117	11,594,194.20	0.61
44	000661	长春高新	29,700	11,493,900.00	0.60
45	600660	福耀玻璃	199,614	11,148,441.90	0.59
46	600887	伊利股份	297,500	10,956,925.00	0.58
47	601668	中国建筑	2,251,100	10,467,615.00	0.55
48	601636	旗滨集团	561,500	10,421,440.00	0.55
49	002129	中环股份	269,000	10,383,400.00	0.55
50	600048	保利地产	835,800	10,063,032.00	0.53
51	601658	邮储银行	1,975,100	9,915,002.00	0.52
52	601919	中远海控	322,800	9,858,312.00	0.52
53	002460	赣锋锂业	81,300	9,844,617.00	0.52
54	601155	新城控股	233,910	9,730,656.00	0.51
55	002352	顺丰控股	142,600	9,654,020.00	0.51
56	600436	片仔癀	21,500	9,638,450.00	0.51
57	600779	水井坊	75,100	9,488,885.00	0.50
58	601006	大秦铁路	1,407,900	9,263,982.00	0.49
59	002080	中材科技	351,400	9,196,138.00	0.48
60	603605	珀莱雅	46,500	9,147,015.00	0.48

61	300316	晶盛机电	175,200	8,847,600.00	0.47
62	002230	科大讯飞	127,700	8,629,966.00	0.45
63	601628	中国人寿	252,800	8,567,392.00	0.45
64	000932	华菱钢铁	1,285,300	8,482,980.00	0.45
65	601633	长城汽车	194,100	8,460,819.00	0.44
66	601899	紫金矿业	838,100	8,121,189.00	0.43
67	603659	璞泰来	59,400	8,114,040.00	0.43
68	002833	弘亚数控	207,100	8,025,125.00	0.42
69	002139	拓邦股份	445,000	8,005,550.00	0.42
70	300033	同花顺	70,800	7,984,824.00	0.42
71	603882	金域医学	49,800	7,956,546.00	0.42
72	000739	普洛药业	270,300	7,946,820.00	0.42
73	300595	欧普康视	75,022	7,768,528.10	0.41
74	300529	健帆生物	89,380	7,718,856.80	0.41
75	600690	海尔智家	285,300	7,392,123.00	0.39
76	002677	浙江美大	403,160	7,369,764.80	0.39
77	300124	汇川技术	98,900	7,344,314.00	0.39
78	002027	分众传媒	759,400	7,145,954.00	0.38
79	600999	招商证券	370,710	7,050,904.20	0.37
80	002410	广联达	101,300	6,908,660.00	0.36
81	300782	卓胜微	12,800	6,880,000.00	0.36
82	603195	公牛集团	33,800	6,827,600.00	0.36
83	002563	森马服饰	569,400	6,804,330.00	0.36
84	601857	中国石油	1,281,200	6,777,548.00	0.36
85	601377	兴业证券	694,200	6,705,972.00	0.35
86	688169	石头科技	5,268	6,642,948.00	0.35
87	600298	安琪酵母	120,100	6,531,038.00	0.34
88	600426	华鲁恒升	208,190	6,443,480.50	0.34
89	000012	南玻 A	628,300	6,433,792.00	0.34
90	000100	TCL 科技	835,400	6,390,810.00	0.34
91	601225	陕西煤业	513,700	6,087,345.00	0.32
92	001965	招商公路	842,700	6,084,294.00	0.32
93	688111	金山办公	15,113	5,966,612.40	0.31
94	002271	东方雨虹	107,794	5,963,164.08	0.31
95	601607	上海医药	273,200	5,772,716.00	0.30
96	300750	宁德时代	9,800	5,241,040.00	0.28
97	000799	酒鬼酒	19,800	5,060,880.00	0.27
98	002920	德赛西威	43,500	4,788,480.00	0.25
99	600111	北方稀土	224,500	4,647,150.00	0.24
100	300413	芒果超媒	67,000	4,596,200.00	0.24
101	688526	科前生物	115,000	4,165,300.00	0.22
102	603233	大参林	81,300	4,155,243.00	0.22

103	600754	锦江酒店	68,600	3,906,770.00	0.21
104	000338	潍柴动力	215,300	3,847,411.00	0.20
105	300755	华致酒行	91,600	3,738,196.00	0.20
106	300496	中科创达	22,900	3,596,674.00	0.19
107	603678	火炬电子	51,900	3,503,250.00	0.18
108	601336	新华保险	76,000	3,489,160.00	0.18
109	002968	新大正	77,658	3,382,005.90	0.18
110	300896	爱美客	4,000	3,155,520.00	0.17
111	603369	今世缘	37,200	2,014,752.00	0.11
112	300957	贝泰妮	853	214,921.88	0.01
113	688677	海泰新光	1,768	182,510.64	0.01
114	688687	凯因科技	5,354	149,804.92	0.01
115	688661	和林微纳	1,452	121,982.52	0.01
116	688656	浩欧博	1,371	99,534.60	0.01
117	300919	中伟股份	610	99,430.00	0.01
118	688319	欧林生物	3,412	93,284.08	0.00
119	688607	康众医疗	1,890	84,105.00	0.00
120	688070	纵横股份	2,407	82,969.29	0.00
121	300979	华利集团	925	80,937.50	0.00
122	688533	上声电子	3,493	66,751.23	0.00
123	301018	申菱环境	7,811	64,753.19	0.00
124	688239	航宇科技	4,926	56,550.48	0.00
125	300981	中红医疗	601	54,324.39	0.00
126	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.00
127	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.00
128	688260	昀冢科技	2,990	49,065.90	0.00
129	300894	火星人	628	42,704.00	0.00
130	300973	立高食品	360	41,655.60	0.00
131	688092	爱科科技	1,137	37,759.77	0.00
132	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.00
133	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.00
134	300953	震裕科技	240	23,964.00	0.00
135	001207	联科科技	682	22,581.02	0.00
136	301015	百洋医药	462	17,939.46	0.00
137	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
138	300925	法本信息	600	15,774.00	0.00
139	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00
140	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.00
141	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
142	300940	南极光	307	13,317.66	0.00
143	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
144	300937	药易购	244	13,105.24	0.00

145	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00
146	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
147	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
148	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.00
149	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
150	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
151	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
152	300996	普联软件	241	10,177.43	0.00
153	300956	英力股份	371	9,571.80	0.00
154	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
155	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
156	301016	雷尔伟	275	9,069.50	0.00
157	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
158	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
159	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
160	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
161	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
162	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
163	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
164	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
165	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
166	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
167	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
168	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
169	300993	玉马遮阳	410	7,908.90	0.00
170	300930	屹通新材	322	7,882.56	0.00
171	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00
172	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
173	301004	嘉益股份	312	6,845.28	0.00
174	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
175	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
176	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
177	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
178	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
179	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
180	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
181	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
182	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
183	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
184	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
185	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
186	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00

187	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
188	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
189	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
190	301010	晶雪节能	218	3,838.98	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600809	山西汾酒	42,675,338.19	1.34
2	000776	广发证券	42,432,594.64	1.33
3	000858	五粮液	41,505,111.08	1.30
4	000568	泸州老窖	41,206,185.54	1.29
5	600030	中信证券	39,642,163.35	1.24
6	600519	贵州茅台	39,035,103.05	1.23
7	600919	江苏银行	37,898,902.89	1.19
8	600048	保利地产	36,657,943.00	1.15
9	000063	中兴通讯	36,308,264.00	1.14
10	601318	中国平安	34,198,968.82	1.07
11	601006	大秦铁路	32,855,462.43	1.03
12	601919	中远海控	32,153,209.89	1.01
13	600887	伊利股份	32,097,906.30	1.01
14	002475	立讯精密	31,875,324.82	1.00
15	000100	TCL 科技	31,325,995.77	0.98
16	601328	交通银行	31,258,937.71	0.98
17	300122	智飞生物	30,744,207.27	0.97
18	601211	国泰君安	30,622,891.09	0.96
19	603986	兆易创新	30,286,645.46	0.95
20	601668	中国建筑	30,006,223.20	0.94

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	601318	中国平安	73,808,508.04	2.32
2	000568	泸州老窖	69,451,654.22	2.18
3	600519	贵州茅台	67,723,752.19	2.13
4	601328	交通银行	56,645,154.80	1.78
5	600887	伊利股份	48,969,189.70	1.54
6	601398	工商银行	48,644,615.00	1.53
7	600036	招商银行	46,449,052.95	1.46

8	000001	平安银行	45,067,925.99	1.42
9	600048	保利地产	44,926,467.63	1.41
10	000002	万科 A	44,766,791.39	1.41
11	000858	五粮液	42,251,822.83	1.33
12	601012	隆基股份	41,533,416.61	1.30
13	601668	中国建筑	38,023,410.01	1.19
14	601166	兴业银行	36,089,483.75	1.13
15	002475	立讯精密	35,992,670.75	1.13
16	600309	万华化学	34,969,300.74	1.10
17	600000	浦发银行	34,259,273.17	1.08
18	000651	格力电器	34,019,804.77	1.07
19	601211	国泰君安	33,867,598.75	1.06
20	300059	东方财富	33,832,643.05	1.06

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	3,159,047,981.31
卖出股票收入（成交）总额	3,633,147,240.66

注：买入股票成本、卖出股票收入均不包括相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	95,270,539.30	5.01
2	央行票据	-	-
3	金融债券	20,329,742.50	1.07
	其中：政策性金融债	20,329,742.50	1.07
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	3,673,949.04	0.19
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	119,274,230.84	6.27

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
----	------	------	-------	------	---------------

1	019640	20 国债 10	588,550	58,855,000.00	3.09
2	019645	20 国债 15	363,030	36,415,539.30	1.91
3	108604	国开 1805	202,750	20,329,742.50	1.07
4	123111	东财转 3	12,514	1,831,549.04	0.10
5	110053	苏银转债	10,000	1,213,600.00	0.06

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

代 码	名 称	持仓量(买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险说明
IF2107	IF2107	-527	-820,728,720.00	1,432,731.28	-
IF2109	IF2109	-335	-519,223,200.00	-17,087,340.00	-
公允价值变动总额合计(元)					-15,654,608.72
股指期货投资本期收益(元)					-110,290,079.37
股指期货投资本期公允价值变动(元)					65,976,479.37

注：持仓量和合约市值的负数代表产品投资的期货为空头。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金主要运用股指期货合约进行套期保值操作，规避市场系统性风险。在完全套保的理念下，本基金根据股票多头组合的市值计算股指期货合约卖单量，并根据市场变化对股指期货合约卖单量进行动态跟踪并适时调整。同时，综合考虑定价关系、套利机会、流动性以及保证金要求等因素，在不同股指期货合约之间进行动态配置，并适时进行合约展期操作，以求提高组合收益和套期保值的效果。

本基金投资于股指期货，为特殊类型的混合型基金，主要采用追求绝对收益的市场中性策略，与股票市场表现的相关性较低。相对股票型基金和一般的混合型基金，其预期风险较小。本基金的投资符合既定的投资政策和投资目标。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金未投资国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金未投资国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

量化对冲基金截至 2021 年 6 月 30 日持仓前十名证券中的招商银行（600036）的发行人招商银行股份有限公司于 2021 年 5 月 21 日公告，因公司存在以下违规行为：一、为同业投资提供第三方信用担保、为非保本理财产品出具保本承诺，部分未按规定计提风险加权资产；二、违规协助无衍生产品交易业务资格的银行发行结构性衍生产品；三、理财产品之间风险隔离不到位；四、理财资金投资非标准化债权资产认定不准确，实际余额超监管标准；五、同业投资接受第三方金融机构信用担保；六、理财资金池化运作；七、利用理财产品准备金调节收益；八、高净值客户认定不审慎；九、并表管理不到位，通过关联非银机构的内部交易，违规变相降低理财产品销售门槛；十、投资集合资金信托计划的理财产品未执行合格投资者标准；十一、投资集合资金信托计划人数超限；十二、面向不合格个人投资者销售投资高风险资产或权益性资产的理财产品；十三、信贷资产非真实转让；十四、全权委托业务不规范；十五、未按要求向监管机构报告理财投资合作机构，被监管否决后仍未及时停办业务；十六、通过关联机构引入非合格投资者，受让以本行信用卡债权设立的信托次级受益权；十七、“智能投资受托计划业务”通过其他方式规避整改，扩大业务规模，且业务数据和材料缺失；十八、票据转贴现假卖断屡查屡犯；十九、贷款、理财或同业投资资金违规投向土地储备项目；二十、理财资金违规提供棚改项目资本金融资，向地方政府提供融资并要求地方政府提供担保；二十一、同业投资、理财资金等违规投向地价款或四证不全的房地产项目；二十二、理财资金认购商业银行增发的股票；二十三、违规为企业发行短期融资券提供搭桥融资，并用理财产品投资本行主承债券以承接表内类信贷资产；二十四、为定制

公募基金提供投资顾问；二十五、为本行承销债券兑付提供资金支持；二十六、协助发行人以非市场化的价格发行债券；二十七、瞒报案件信息；于 2021 年 5 月 17 日收到中国银行保险监督管理委员会罚款 7170 万元的处罚。

本基金管理人通过对上述上市公司进行进一步了解和视为，认为上述处分不会对公司的投资价值构成实质性影响，因此本基金管理人对上述证券的投资判断未发生改变。报告期内，本基金投资的前十名证券的其余九名证券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未超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	161,265,925.33
2	应收证券清算款	27,078,662.05
3	应收股利	-
4	应收利息	2,562,680.54
5	应收申购款	1,964,575.61
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	192,871,843.53

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	110053	苏银转债	1,213,600.00	0.06

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末无前十名股票中存在流通受限情况。

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（%）
华宝量化对冲混合 A	56,923	20,267.01	985,806,738.95	85.45	167,852,151.32	14.55
华宝量化对冲混合 C	114,095	4,074.28	32,582,716.38	7.01	432,271,877.40	92.99
合计	171,018	9,463.99	1,018,389,455.33	62.92	600,124,028.72	37.08

注：本表列示“占基金总份额比例”中，对下属分级基金，为占各自级别份额的比例；对合计数，为占期末基金份额总额的比例。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	华宝量化对冲混合 A	2,540,785.29	0.2202
	华宝量化对冲混合 C	329,013.96	0.0708
	合计	2,869,799.25	0.1773

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	华宝量化对冲混合 A	10~50
	华宝量化对冲混合 C	0~10
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	华宝量化对冲混合 A	10~50
	华宝量化对冲混合 C	-
	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	11,550,347.29	0.71	9,800,000.00	0.61	不少于 3 年
基金管理人高级管理人员	117,860.68	0.01	100,000.00	0.01	不少于 3 年
基金经理等人员	110,000.63	0.01	100,000.00	0.01	不少于 3 年
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	11,778,208.60	0.73	10,000,000.00	0.62	-

注：1、本基金募集期间，本基金管理人运用固有资金、基金管理人高级管理人员及基金经理等人员使用自有资金作为发起资金总计 1,000 万元认购了本基金。发起资金认购的基金份额自基金合同生效之日起持有期不少于 3 年；

2、本基金管理人运用固有资金于 2014 年 9 月 12 日通过本公司直销柜台认购本基金作为发起资金的认购费用为 1,000 元；本基金管理人高级管理人员使用自有资金认购本基金作为发起资金的认购费率为 0.3%；本基金基金经理等人员使用自有资金认购本基金作为发起资金的认购费率为 0.6%。符合基金合同和招募说明书等法律文件的约定。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华宝量化对冲混合 A	华宝量化对冲混合 C
----	------------	------------

基金合同生效日 (2014 年 9 月 17 日) 基金份额总额	539,601,058.43	67,437,011.52
本报告期期初基金份 额总额	2,256,292,463.92	459,246,805.32
本报告期基金总申购 份额	443,786,665.48	334,091,612.38
减:本报告期基金总 赎回份额	1,546,420,239.13	328,483,823.92
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	1,153,658,890.27	464,854,593.78

§ 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，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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、基金资产和基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未发生变更。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

基金管理人为本基金聘任的会计师事务所向本基金提供的审计服务持续期限为：本基金合同生效之日起至本报告期末。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人、本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
宏信证券	2	1,130,434,095.15	16.67%	1,037,530.50	16.60%	-
东方财富	2	1,010,118,192.89	14.89%	938,392.68	15.02%	-
海通证券	2	690,916,128.04	10.19%	638,709.04	10.22%	-
长江证券	1	683,938,382.50	10.08%	636,951.08	10.19%	-
中信建投	1	539,131,615.49	7.95%	502,093.14	8.03%	-
浙商证券	2	489,117,957.01	7.21%	446,332.56	7.14%	-
天风证券	3	467,607,443.74	6.89%	426,130.21	6.82%	-
开源证券	2	416,738,423.61	6.14%	385,231.70	6.16%	-
方正证券	1	378,170,135.05	5.58%	344,631.90	5.51%	-
广发证券	2	180,566,823.38	2.66%	164,550.41	2.63%	-
中金公司	2	149,278,344.70	2.20%	136,037.38	2.18%	-
国海证券	2	100,255,974.83	1.48%	91,363.22	1.46%	-
华创证券	2	99,501,016.69	1.47%	90,675.33	1.45%	-
财通证券	2	95,789,468.51	1.41%	89,208.24	1.43%	-
华宝证券	1	75,125,109.13	1.11%	68,461.68	1.10%	-

光大证券	2	65,085,022.37	0.96%	59,311.74	0.95%	-
东方证券	1	57,602,376.49	0.85%	52,493.34	0.84%	-
国泰君安	1	36,500,889.76	0.54%	33,993.72	0.54%	-
招商证券	1	29,264,279.99	0.43%	26,668.23	0.43%	-
兴业证券	2	27,958,902.91	0.41%	26,038.78	0.42%	-
国元证券	2	25,962,938.65	0.38%	23,659.47	0.38%	-
中泰证券	1	23,625,004.11	0.35%	22,001.79	0.35%	-
申万宏源	3	5,944,667.50	0.09%	5,536.43	0.09%	-
国信证券	1	3,631,443.55	0.05%	3,382.06	0.05%	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
国联证券	3	-	-	-	-	-
华金证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	2	-	-	-	-	-
新时代证 券	2	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
中信金通	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-

注：1、基金管理人选择交易单元的标准和程序如下：

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

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

2、报告期内券商交易单元新增财通证券、开源证券、民生证券、信达证券。

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
宏信证券	-	-	717,900,000.00	2.24%	-	-
东方财富	13,061,440.54	7.75%	7,532,900,000.00	23.52%	-	-
海通证券	2,608,000.00	1.55%	2,553,200,000.00	7.97%	-	-
长江证券	69,880,037.54	41.48%	3,040,200,000.00	9.49%	-	-
中信建投	27,319,276.97	16.21%	995,400,000.00	3.11%	-	-
浙商证券	127,000.00	0.08%	16,500,000.00	0.05%	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	15,492,664.25	9.20%	3,844,200,000.00	12.00%	-	-
方正证券	15,165,509.60	9.00%	7,118,400,000.00	22.23%	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	333,798.25	0.20%	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	20,748,322.73	12.31%	-	-	-	-
财通证券	-	-	1,666,700,000.00	5.20%	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	3,559,217.73	2.11%	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	14,200,000.00	0.04%	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	215,100,000.00	0.67%	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	190,968.40	0.11%	2,086,600,000.00	6.51%	-	-
申万宏源	-	-	898,300,000.00	2.80%	-	-
国信证券	-	-	1,243,500,000.00	3.88%	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	85,200,000.00	0.27%	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-

新时代证 券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
中信金通	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华宝基金关于华宝量化对冲策略混合型发起式证券投资基金新增国元证券为代销机构的公告	基金管理人网站, 证券时报	2021-1-8
2	华宝量化对冲策略混合型发起式证券投资基金 2020 年第 4 季度报告	基金管理人网站	2021-1-22
3	华宝量化对冲策略混合型发起式证券投资基金新增平安银行为代销机构的公告	基金管理人网站, 证券时报	2021-2-1
4	关于警惕冒用华宝基金管理有限公司名义进行诈骗活动的特别提示公告	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	2021-2-19
5	华宝现金添益交易型货币市场基金 B 类基金份额开放转换业务的公告	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	2021-2-26
6	华宝基金管理有限公司关于提示投资者完善身份信息的公告	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	2021-3-9
7	华宝量化对冲策略混合型发起式证券投资基金 2020 年年度报告	基金管理人网站	2021-3-31
8	华宝量化对冲策略混合型发起式证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	基金管理人网站	2021-4-22
9	华宝新优选一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金开放日常申购、赎回及转换业务的公告	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	2021-5-18
10	华宝资源优选混合型证券投资基金 C 类基金份额开放转换业务及开通定期定额投资业务的公告	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	2021-5-18
11	华宝基金关于旗下部分开放式基金新增华鑫证券为代销机构的公告	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	2021-5-27
12	华宝量化对冲策略混合型发起式证券投资基金 (A 类份额) 基金产品资料概要 (更新)	基金管理人网站	2021-6-9
13	华宝量化对冲策略混合型发起式证券投资基金招募说明书 (更新)	基金管理人网站	2021-6-9

14	华宝基金管理有限公司关于深圳分公司负责人变更的公告	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	2021-6-22
15	华宝量化对冲策略混合型发起式证券投资基金新增方正证券为代销机构的公告	基金管理人网站, 证券时报	2021-6-23
16	华宝基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加鼎信汇金(北京)投资管理有限公司为代销机构及费率优惠的公告	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	2021-6-23
17	华宝基金关于旗下部分开放式基金参加交通银行申购及定投手续费率优惠活动的公告	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	2021-6-30

§ 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	20210629~20210630	347,458,596.32	-	-	347,458,596.32	21.47
产品特有风险							
<p>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。</p>							

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;

华宝量化对冲策略混合型发起式证券投资基金基金合同;

华宝量化对冲策略混合型发起式证券投资基金招募说明书;

华宝量化对冲策略混合型发起式证券投资基金托管协议；

基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；

基金管理人报告期内在指定报刊上披露的各种公告；

基金托管人业务资格批件和营业执照。

12.2 存放地点

以上文件存于基金管理人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

2021 年 8 月 27 日