

# 华宝价值发现混合型证券投资基金 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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设银行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 01 月 01 日起至 2023 年 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
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>	<b>6</b>
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>	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	13
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	13
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	13
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>13</b>
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	18
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>41</b>
7.1 期末基金资产组合情况	41
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	45
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	48
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	48

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	48
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	48
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	48
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	48
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	48
7.12 投资组合报告附注 .....	48
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>50</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	50
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	50
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 .....	50
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>51</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>51</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	51
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 .....	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	51
10.4 基金投资策略的改变 .....	51
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	51
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 .....	52
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	52
10.8 其他重大事件 .....	53
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>54</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 .....	54
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	55
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>55</b>
12.1 备查文件目录 .....	55
12.2 存放地点 .....	55
12.3 查阅方式 .....	55

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华宝价值发现混合型证券投资基金	
基金简称	华宝价值发现混合	
基金主代码	005445	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 1 月 24 日	
基金管理人	华宝基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	131,558,081.45 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华宝价值发现混合 A	华宝价值发现混合 C
下属分级基金的交易代码	005445	015614
报告期末下属分级基金的份额总额	97,291,524.57 份	34,266,556.88 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过精选价值型股票，在控制风险的前提下，力争实现资产的稳健增值。
投资策略	<p>本基金以定性和定量分析相结合的方法，以“自下而上”的方式遴选出估值较低、并具备较强盈利能力和业绩可持续成长能力的优秀价值型企业，构建投资组合。</p> <p>定性分析主要基于投研团队对公司的案头研究和实地调研，包括所属细分行业情况、公司财务状况、市场供求、商业模式、核心技术等内容，深入分析公司的治理结构、经营管理、竞争优势，来综合判断公司的估值水平和未来盈利空间。本基金将优选行业趋势良好、行业地位稳定、财务状况健康、增长前景明确、有核心竞争力、具有稳定可持续的商业模式、公司治理结构良好并有清晰、合理的发展战略的上市公司进行投资。</p> <p>定量分析主要根据相关估值指标，通过与全市场或者同行业/板块其他公司的估值比率对比来衡量个股估值的相对高低。其中估值比率主要包括股息收益率（D/P）、每股收益与价格比率（E/P）、每股净资产与价格比率（B/P）、每股净现金流与价格比率（CF/P）等。</p>
业绩比较基准	中证 800 价值指数收益率×80%+上证国债指数收益率×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	中国建设银行股份有限公司

信息披露 负责人	姓名	周雷	王小飞
	联系电话	021-38505888	021-60637103
	电子邮箱	xxpl@fsfund.com	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		400-700-5588、400-820-5050	021-60637228
传真		021-38505777	021-60635778
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		200120	100033
法定代表人		黄孔威	田国立

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
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	报告期(2023年1月1日-2023年6月30日)	
	华宝价值发现混合 A	华宝价值发现混合 C
本期已实现收益	988,520.70	-85,775.27
本期利润	-5,166,853.15	-2,268,388.78
加权平均基金份额本期利润	-0.0367	-0.0698
本期加权平均净值利润率	-2.36%	-4.52%
本期基金份额净值增长率	-2.39%	-2.68%
3.1.2 期末数据	报告期末(2023年6月30日)	

和指标		
期末可供分配利润	46,423,520.45	16,025,997.77
期末可供分配基金份额利润	0.4772	0.4677
期末基金资产净值	143,715,045.02	50,292,554.65
期末基金份额净值	1.4772	1.4677
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	47.72%	-3.12%

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。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华宝价值发现混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.35%	0.99%	-0.72%	0.68%	1.07%	0.31%
过去三个月	-3.27%	1.00%	-0.67%	0.79%	-2.60%	0.21%
过去六个月	-2.39%	0.94%	3.19%	0.74%	-5.58%	0.20%
过去一年	-8.17%	1.19%	-3.22%	0.81%	-4.95%	0.38%
过去三年	27.27%	1.27%	6.38%	0.93%	20.89%	0.34%
自基金合同生效起至今	47.72%	1.20%	-9.57%	0.98%	57.29%	0.22%

华宝价值发现混合 C

阶段	份额净值增长	份额净值增长率标	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
----	--------	----------	------------	--------------	-----	-----

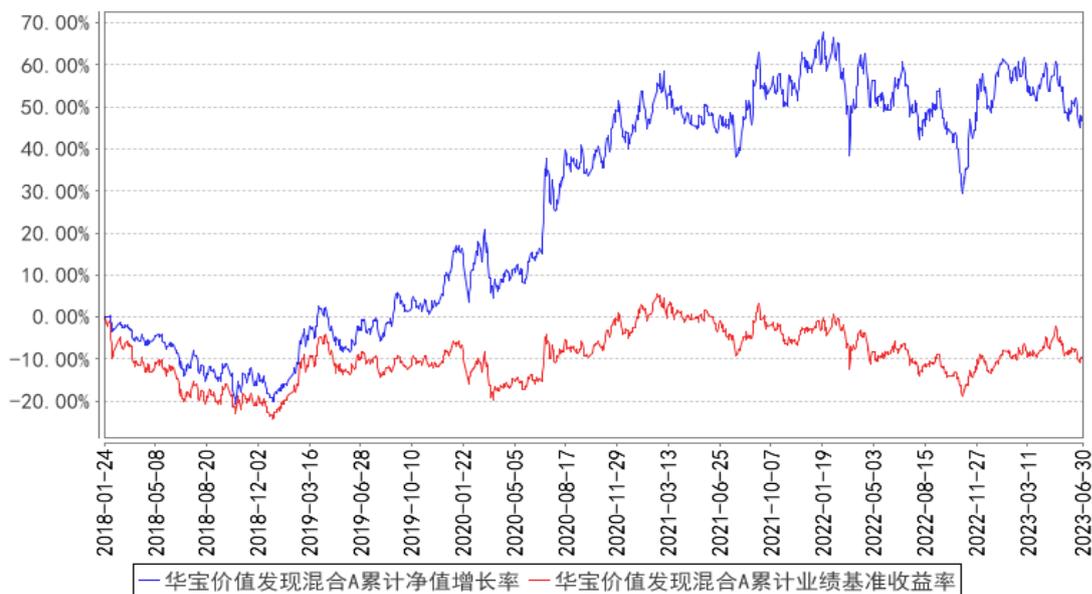
	率①	准差②		④		
过去一个月	0.30%	1.00%	-0.72%	0.68%	1.02%	0.32%
过去三个月	-3.41%	1.01%	-0.67%	0.79%	-2.74%	0.22%
过去六个月	-2.68%	0.94%	3.19%	0.74%	-5.87%	0.20%
过去一年	-8.71%	1.19%	-3.22%	0.81%	-5.49%	0.38%
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	-3.12%	1.17%	0.67%	0.80%	-3.79%	0.37%

注：（1）基金业绩基准：中证 800 价值指数收益率×80%+上证国债指数收益率×20%；

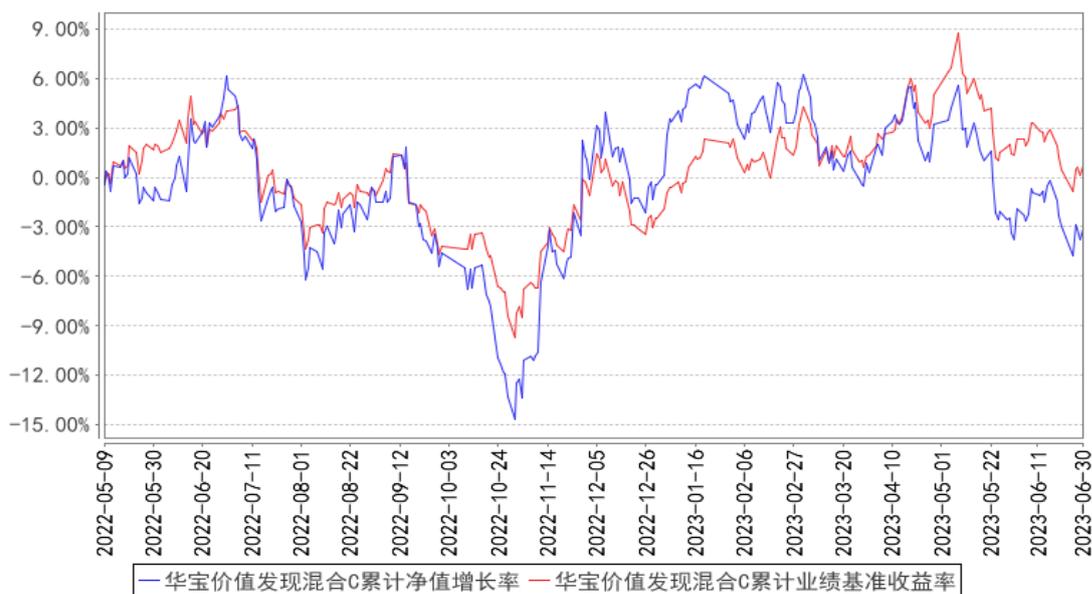
（2）净值以及比较基准相关数据计算中涉及天数的，包括所有交易日以及季末最后一自然日（如非交易日）。

### 3.2.2 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

华宝价值发现混合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



华宝价值发现混合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，基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定，截至 2018 年 07 月 24 日，本基金已达到合同规定的资产配置比例。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

华宝基金管理有限公司（公司原名“华宝兴业基金管理有限公司”）于 2003 年 2 月 12 日经中国证监会批准设立，2003 年 3 月 7 日在国家工商总局注册登记并正式开业，是国内首批中外合资基金管理公司。成立之初，公司注册资本为 1 亿元人民币，2007 年经中国证监会批准，公司注册资本增加至 1.5 亿元人民币。2017 年公司名称变更为“华宝基金管理有限公司”。目前公司股东为华宝信托有限责任公司、美国华平资产管理有限合伙（Warburg Pincus Asset Management, L.P.）和江苏省铁路集团有限公司，持有股权占比分别为 51%、29%、20%。公司在北京和深圳设有分公司，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		
蔡目荣	本基金基金经理、	2018-01-24	-	20 年	硕士。曾在金信研究、国金证券股份有限公司从事研究工作。2008 年 6 月加入华宝

	权益投资部 总经理、权益投资总监				基金管理有限公司，先后担任高级分析师、研究部总经理助理、基金经理助理、交易员、国内投资部副总经理、投资副总监等职务，现任权益投资总监、权益投资部总经理。2012 年 8 月起任华宝资源优选混合型证券投资基金基金经理，2015 年 6 月至 2017 年 3 月任华宝新机遇灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) 基金经理，2015 年 11 月至 2023 年 6 月任华宝多策略增长开放式证券投资基金基金经理，2018 年 1 月起任华宝价值发现混合型证券投资基金基金经理，2018 年 9 月至 2020 年 11 月任华宝绿色主题混合型证券投资基金基金经理，2019 年 9 月至 2020 年 11 月任华宝绿色领先股票型证券投资基金基金经理，2022 年 10 月起任华宝服务优选混合型证券投资基金基金经理。
--	------------------	--	--	--	---

注：1、任职日期以及离任日期均以基金公告为准。

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

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

本报告期内，本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作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、《华宝价值发现混合型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

本基金管理人旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，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% 的交易共有 1 次，均为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。

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 年上半年国内经济经历了企稳回升后走弱，一季度国内制造业 PMI 指数处于 50% 以上，二季度滑落到荣枯线之下。从投资数据看，上半年基建投资是经济增长重要拉动力，地产开发投资是经济的拖累项。上半年地产销售也是前高后低，导致土地市场和地产投资转好预期回落。出口数据方面，虽然有一定的韧性，但数据还是出现了回落。从消费数据看，社会消费品零售总额出现修复，尤其是二季度在低基数影响下增长尚可，但从环比数据看也一般，未来能否较好修复还需要看后续经济增长恢复情况。上半年海外经济虽有走弱迹象，但在就业、服务消费方面表现较强的韧性，美国月度制造业 PMI 指数还是在逐步走弱，欧元区制造业 PMI 指数走势也是下降趋势，相对美国绝对值更低。为了应对高通胀，前期美联储以及部分国家和地区央行纷纷采取较为激进的偏紧缩的政策，预计未来加息幅度随着通胀回落、经济低迷而降低，由于通胀虽然回落但依然处于高位，紧缩政策转向还要有待时日，未来需要密切关注海外央行紧缩政策变化对经济和金融市场的影响。

2023 年上半年 A 股市场震荡上行后略有回落，前期市场以普涨为主，受益于经济复苏的部分行业涨幅较好，中后期市场关注度较高是 chatGPT 技术引发的 AI 板块行情；另一个市场关注的点是低估值国央企的估值提升。上半年市场涨幅较好的是通信、传媒和计算机行业，表现较差的是消费者服务、地产和农业。上半年上证指数涨幅 3.65%，深成指涨幅 0.1%，创业板指数涨幅-5.61%，中证 800 价值指数涨幅 3.35%。

本基金上半年大部分时间内维持了较高仓位，6 月底仓位较年初略有提升。在持仓结构方面主要增加了农业、社服和建材，部分降低了金融地产配置。

### 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-2.39%，本报告期基金份额 C 类净值增长率为-2.68%；同期业绩比较基准收益率为 3.19%。

## 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 2023 年下半年，预期国内经济增长将会得到改善，继续呈现弱复苏。投资方面，由于稳

增长政策依然持续，预计基建投资还会是一个亮点。地产方面，由于地产销售回落，进一步稳定地产行业的政策不断出台，预期 2023 年下半年地产销售会趋稳回升，地产投资稳定有望走稳。2023 年上半年国内出行、消费、服务等行业消费场景恢复，出行相关行业景气度较好，由于预期经济将会继续弱复苏，预期国内消费将会出现稳中向好的格局。出口方面 2023 年下半年还会有一定的压力，海外经济的疲弱将会继续拖累我们的出口表现。由于短期还会面临通胀压力，美联储加息周期已经进入尾声，加息何时结束以及降息何时启动后续可以继续观察。

对于 A 股市场而言，展望 2023 年下半年，稳增长政策依然会继续，国内经济恢复有望进一步持续，国内流动性也会维持相对宽松状态。从海外看，虽然短期还会面临着通胀压力而继续加息，但加息终止是值得逐步去期待。对于 2023 年下半年 A 股市场整体是偏乐观，预计市场风格会偏均衡化，低估值顺周期板块也依然会有较好的投资机会。具体板块方面，具有较低估值的金融板块，在地产政策及流动性宽松政策下，会有修复性机会；地产产业链也会受益于地产行业景气度回升；由于出行板块景气度较高，相关板块值得关注。同时随着国内经济回升，大众消费品、服务消费、养殖和医药等板块也会受益，同时还可以关注具有估值性价比优势的传媒、电子等板块的投资机会。本基金计划在 2023 年下半年继续采取偏积极仓位策略，密切关注市场变化，紧跟经济形势、政策动向及流动性走势，采取灵活应对措施，在契约规定的范围内进一步优化持仓结构挖掘优质个股以争取获取好的业绩。

#### 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

本基金本报告期亏损，未有应分未分的利润。

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

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

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，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关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真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：华宝价值发现混合型证券投资基金

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	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	13,626,920.81	28,825,297.36
结算备付金		1,744,449.23	1,554,614.84
存出保证金		112,328.32	80,189.03
交易性金融资产	6.4.7.2	180,268,403.24	208,459,514.37

其中：股票投资		180,268,403.24	208,459,514.37
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		139,843.40	67,851.63
应收股利		-	-
应收申购款		70,167.28	105,299.91
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		195,962,112.28	239,092,767.14
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年6月30日</b>	<b>上年度末 2022年12月31日</b>
<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		475,227.06	-
应付赎回款		191,889.83	147,002.83
应付管理人报酬		261,412.89	308,196.79
应付托管费		43,568.80	51,366.13
应付销售服务费		24,855.04	11,467.25
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	957,558.99	1,064,152.60
负债合计		1,954,512.61	1,582,185.60
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	131,558,081.45	157,003,518.91
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	62,449,518.22	80,507,062.63
净资产合计		194,007,599.67	237,510,581.54
负债和净资产总计		195,962,112.28	239,092,767.14

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额总额 131,558,081.45 份，其中华宝价值发现混合 A 基金份额总额 97,291,524.57 份，基金份额净值 1.4772 元；华宝价值发现混合 C 基金份额总额 34,266,556.88 份，基金份额净值 1.4677 元。

## 6.2 利润表

会计主体：华宝价值发现混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		-4,836,846.69	-5,003,771.21
1. 利息收入		66,594.98	69,593.68
其中：存款利息收入	6.4.7.13	66,594.98	69,593.68
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		3,269,946.35	4,379,814.61
其中：股票投资收益	6.4.7.14	1,270,735.86	-813,670.64
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	407,458.66
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
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	1,999,210.49	4,786,026.59
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	-8,337,987.36	-10,125,190.70
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	164,599.34	672,011.20
<b>减：二、营业总支出</b>		2,598,395.24	2,579,234.41

1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,009,590.15	2,124,821.74
2. 托管费	6.4.10.2.2	334,931.63	354,137.00
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	150,805.90	242.87
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		-	0.88
8. 其他费用	6.4.7.23	103,067.56	100,031.92
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-7,435,241.93	-7,583,005.62
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-7,435,241.93	-7,583,005.62
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-7,435,241.93	-7,583,005.62

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：华宝价值发现混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	157,003,518.91	-	80,507,062.63	237,510,581.54
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）	157,003,518.91	-	80,507,062.63	237,510,581.54
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-25,445,437.46	-	-18,057,544.41	-43,502,981.87
（一）、综合收益总额	-	-	-7,435,241.93	-7,435,241.93
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-25,445,437.46	-	-10,622,302.48	-36,067,739.94

(净值减少以“-”号填列)				
其中：1. 基金申购款	85,170,831.37	-	48,376,176.00	133,547,007.37
2. 基金赎回款	-110,616,268.83	-	-58,998,478.48	-169,614,747.31
(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)	131,558,081.45	-	62,449,518.22	194,007,599.67
项目	上年度可比期间 2022年1月1日至2022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)	122,258,542.21	-	74,126,863.52	196,385,405.73
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)	122,258,542.21	-	74,126,863.52	196,385,405.73
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	49,779,774.48	-	30,579,801.54	80,359,576.02
(一)、综合收益总额	-	-	-7,583,005.62	-7,583,005.62
(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)	49,779,774.48	-	38,162,807.16	87,942,581.64
其中：1. 基金申购款	180,788,550.01	-	107,681,394.43	288,469,944.44
2. 基金赎回款	-131,008,775.5	-	-69,518,587.27	-200,527,362.80

	3			
(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）	172,038,316.69	-	104,706,665.06	276,744,981.75

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：

<u>向辉</u>	<u>向辉</u>	<u>张幸骏</u>
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

华宝价值发现混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）系由基金管理人华宝基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《华宝价值发现混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）及其他有关法律法规的规定，经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）以证监许可[2017]2187 号文批准公开募集。本基金为契约型开放式基金，存续期限为不定期，首次设立募集基金份额为 1,230,830,153.56 份，经德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）验证，并出具了编号为德师报（验）字（18）第 00002 号的验资报告。基金合同于 2018 年 1 月 24 日正式生效。本基金的基金管理人为华宝基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《华宝基金管理有限公司关于华宝价值发现混合型证券投资基金增加 C 类基金份额并修改基金合同等法律文件的公告》，自 2022 年 5 月 6 日起，增设 C 类基金份额。增加 C 类基金份额后，本基金将设 A 类份额和 C 类份额两个基金份额类别，本基金原有基金份额为 A 类基金份额。本基金根据销售服务费及申购费收取方式的不同，将基金份额分为 A 类基金份额和 C 类基金份额两个类别。不从本类别基金资产中计提销售服务费，且收取申购费的基金份额类别为 A 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费，且不收取申购费的基金份额类别为 C 类基金份额。两

类基金份额分设不同的基金代码，并分别计算并公布基金份额净值和基金份额累计净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《华宝价值发现混合型证券投资基金基金合同》和《华宝价值发现混合型证券投资基金招募说明书》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（包括中小板、创业板、存托凭证及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、资产支持证券、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、权证、股指期货以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但需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。本基金的投资组合比例为：基金资产的 60%-95%；其中，投资于价值型股票的比例不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，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 800 价值指数收益率×80%+上证国债指数收益率×20%。

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 2023 年 8 月 29 日批准报出。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《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 1 月 1 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 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一致。

## 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

### 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	13,626,920.81
等于：本金	13,625,512.40
加：应计利息	1,408.41
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	13,626,920.81

##### 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	197,573,129.64	-	180,268,403.24	-17,304,726.40
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	197,573,129.64	-	180,268,403.24	-17,304,726.40

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 债权投资

无。

#### 6.4.7.6 其他债权投资

无。

#### 6.4.7.7 其他权益工具投资

无。

#### 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	538.46
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	872,717.97
其中：交易所市场	872,717.97
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	84,302.56
合计	957,558.99

#### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

华宝价值发现混合 A

项目	本期
----	----

	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	138,157,082.33	138,157,082.33
本期申购	34,755,433.09	34,755,433.09
本期赎回 (以“-”号填列)	-75,620,990.85	-75,620,990.85
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	97,291,524.57	97,291,524.57

华宝价值发现混合 C

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	18,846,436.58	18,846,436.58
本期申购	50,415,398.28	50,415,398.28
本期赎回 (以“-”号填列)	-34,995,277.98	-34,995,277.98
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	34,266,556.88	34,266,556.88

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

无。

#### 6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

华宝价值发现混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	77,182,857.02	-6,252,601.60	70,930,255.42
本期利润	988,520.70	-6,155,373.85	-5,166,853.15
本期基金份额交易产生的变动数	-23,918,684.32	4,578,802.50	-19,339,881.82
其中：基金申购款	19,867,336.75	216,509.45	20,083,846.20
基金赎回款	-43,786,021.07	4,362,293.05	-39,423,728.02
本期已分配利润	-	-	-
本期末	54,252,693.40	-7,829,172.95	46,423,520.45

华宝价值发现混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	10,434,955.00	-858,147.79	9,576,807.21
本期利润	-85,775.27	-2,182,613.51	-2,268,388.78

本期基金份额交易产生的变动数	8,433,928.05	283,651.29	8,717,579.34
其中：基金申购款	28,434,661.54	-142,331.74	28,292,329.80
基金赎回款	-20,000,733.49	425,983.03	-19,574,750.46
本期已分配利润	-	-	-
本期末	18,783,107.78	-2,757,110.01	16,025,997.77

#### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2023年1月1日至2023年6月30日	
活期存款利息收入	52,622.69	
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	13,113.49	
其他	858.80	
合计	66,594.98	

#### 6.4.7.14 股票投资收益

##### 6.4.7.14.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2023年1月1日至2023年6月30日	
卖出股票成交总额	621,824,105.54	
减：卖出股票成本总额	618,707,334.87	
减：交易费用	1,846,034.81	
买卖股票差价收入	1,270,735.86	

#### 6.4.7.15 债券投资收益

本基金本报告期内无债券投资收益。

#### 6.4.7.16 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。

#### 6.4.7.17 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.18 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

#### 6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	
	2023年1月1日至2023年6月30日	
股票投资产生的股利收益	1,999,210.49	

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	1,999,210.49

#### 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1月1日至2023年6月30日
1. 交易性金融资产	-8,337,987.36
股票投资	-8,337,987.36
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	-8,337,987.36

#### 6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
基金赎回费收入	159,730.38
基金转换费收入	4,868.96
合计	164,599.34

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 25% 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 25% 归入转出基金的基金资产。

#### 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1月1日至2023年6月30日
审计费用	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-

银行费用	165.00
账户维护费	18,000.00
上清所 CFCA 证书服务费	600.00
合计	103,067.56

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无需要披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华宝基金管理有限公司(“华宝基金”)	基金管理人, 注册登记机构, 基金销售机构
中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	基金托管人, 基金销售机构
华宝信托有限责任公司(“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
华宝稳健目标风险三个月持有期混合型发起式基金中基金(FOF)	本基金的基金管理人管理的其他基金

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

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行交易。

##### 6.4.10.2 关联方报酬

###### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日

当期发生的基金应支付的管理费	2,009,590.15	2,124,821.74
其中：支付销售机构的客户维护费	403,393.69	541,408.09

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	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	334,931.63	354,137.00

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 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华宝价值发现混合 A	华宝价值发现混合 C	合计
华宝基金	-	31,752.37	31,752.37
合计	-	31,752.37	31,752.37
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华宝价值发现混合 A	华宝价值发现混合 C	合计
华宝基金	-	2.03	2.03
合计	-	2.03	2.03

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 0.6%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： $H=E \times 0.6\% \div \text{当年天数}$ ，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

本基金本报告期内及上年度可比期间无转融通证券出借业务。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

本报告期内及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

##### 6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

华宝价值发现混合 C

关联方名称	本期末 2023年6月30日		上年度末 2022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(%)
华宝基金 稳健目标 风险三个 月持有期 混合型发 起式基金 中基金 (FOF)	50,000.00	0.15	110,332.67	0.59

#### 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1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022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
中国建设银行	13,626,920.81	52,622.69	32,669,854.05	60,952.17

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.7 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（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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
001282	三联锻造	2023 年 5 月 15 日	6 个月	新股锁定	27.93	33.03	81	2,262.33	2,675.43	-
001286	陕西能源	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股锁定	9.60	9.41	3,767	36,163.20	35,447.47	-
001287	中电港	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股锁定	11.88	21.02	367	4,359.96	7,714.34	-
001324	长青科技	2023 年 5 月 12 日	6 个月	新股锁定	18.88	19.60	107	2,020.16	2,097.20	-
001360	南矿集团	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股锁定	15.38	14.87	147	2,260.86	2,185.89	-
001367	海森药业	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股锁定	44.48	39.48	55	2,446.40	2,171.40	-
300804	广康生化	2023 年 6 月 15 日	6 个月	新股锁定	42.45	32.97	173	7,343.85	5,703.81	-
301157	华塑科技	2023 年 3 月 1 日	6 个月	新股锁定	56.50	52.93	129	7,288.50	6,827.97	-
301202	朗威股份	2023 年 6 月 28 日	6 个月	新股锁定	25.82	25.82	171	4,415.22	4,415.22	-
301202	朗威股份	2023 年 6 月 28 日	1 个月内(含)	新股流通受限	25.82	25.82	1,532	39,556.24	39,556.24	-

301210	金杨股份	2023年6月21日	6个月	新股锁定	57.88	49.17	140	8,103.20	6,883.80	-
301225	恒勃股份	2023年6月8日	6个月	新股锁定	35.66	33.26	249	8,879.34	8,281.74	-
301232	飞沃科技	2023年6月8日	6个月	新股锁定	72.50	58.42	115	8,337.50	6,718.30	-
301246	宏源药业	2023年3月10日	6个月	新股锁定	50.00	30.71	298	14,900.00	9,151.58	-
301261	恒工精密	2023年6月29日	6个月	新股锁定	36.90	36.90	116	4,280.40	4,280.40	-
301261	恒工精密	2023年6月29日	1个月内(含)	新股流通受限	36.90	36.90	1,039	38,339.10	38,339.10	-
301262	海看股份	2023年6月13日	6个月	新股锁定	30.22	25.50	314	9,489.08	8,007.00	-
301281	科源制药	2023年3月28日	6个月	新股锁定	44.18	25.10	170	7,510.60	4,267.00	-
301281	科源制药	2023年5月26日	4个月	新股锁定-送股	-	25.10	68	-	1,706.80	-
301291	明阳电气	2023年6月21日	6个月	新股锁定	38.13	31.03	249	9,494.37	7,726.47	-
301292	海科新源	2023年6月29日	1个月内(含)	新股流通受限	19.99	19.99	2,864	57,251.36	57,251.36	-
301292	海科新源	2023年6月29日	6个月	新股锁定	19.99	19.99	319	6,376.81	6,376.81	-
301293	三博脑科	2023年4月25日	6个月	新股锁定	29.60	71.42	220	6,512.00	15,712.40	-
301307	美利信	2023年4月14日	6个月	新股锁定	32.34	31.86	330	10,672.20	10,513.80	-
301315	威士顿	2023年6月13日	6个月	新股锁定	32.29	51.12	189	6,102.81	9,661.68	-

		日									
301317	鑫磊股份	2023年1月12日	6个月	新股锁定	20.67	26.17	459	9,487.53	12,012.03		-
301320	豪江智能	2023年6月1日	6个月	新股锁定	13.06	20.62	642	8,384.52	13,238.04		-
301322	绿通科技	2023年2月27日	6个月	新股锁定	131.11	53.24	86	11,275.46	4,578.64		-
301322	绿通科技	2023年5月25日	3个月	新股锁定-送股	-	53.24	43	-	2,289.32		-
301323	新莱福	2023年5月29日	6个月	新股锁定	39.06	39.36	143	5,585.58	5,628.48		-
301325	曼恩斯特	2023年5月4日	6个月	新股锁定	76.80	107.95	128	9,830.40	13,817.60		-
301345	涛涛车业	2023年3月10日	6个月	新股锁定	73.45	46.64	90	6,610.50	4,197.60		-
301355	南王科技	2023年6月2日	6个月	新股锁定	17.55	16.75	417	7,318.35	6,984.75		-
301358	湖南裕能	2023年2月1日	6个月	新股锁定	23.77	42.89	344	8,176.88	14,754.16		-
301360	荣旗科技	2023年4月17日	6个月	新股锁定	71.88	92.60	98	7,044.24	9,074.80		-
301376	致欧科技	2023年6月14日	6个月	新股锁定	24.66	22.51	276	6,806.16	6,212.76		-
301383	天键股份	2023年5月31日	6个月	新股锁定	46.16	35.72	238	10,986.08	8,501.36		-
301395	仁信新材	2023年6月21日	6个月	新股锁定	26.68	26.68	295	7,870.60	7,870.60		-
301395	仁信新材	2023年6月21日	1个月内(含)	新股流通受限	26.68	26.68	2,649	70,675.32	70,675.32		-
301397	溯联	2023年	6个月	新股锁	53.27	40.20	149	7,937.23	5,989.80		-

	股份	6月15日		定							
301419	阿莱德	2023年2月2日	6个月	新股锁定	24.80	43.85	330	8,184.00	14,470.50		-
301439	泓淋电力	2023年3月10日	6个月	新股锁定	19.99	16.90	317	6,336.83	5,357.30		-
601061	中信金属	2023年3月30日	6个月	新股锁定	6.58	7.58	824	5,421.92	6,245.92		-
601065	江盐集团	2023年3月31日	6个月	新股锁定	10.36	11.84	283	2,931.88	3,350.72		-
601133	柏诚股份	2023年3月31日	6个月	新股锁定	11.66	12.26	247	2,880.02	3,028.22		-
603125	常青科技	2023年3月30日	6个月	新股锁定	25.98	24.53	88	2,286.24	2,158.64		-
603172	万丰股份	2023年4月28日	6个月	新股锁定	14.58	16.13	122	1,778.76	1,967.86		-
688146	中船特气	2023年4月13日	6个月	新股锁定	36.15	38.13	239	8,639.85	9,113.07		-
688249	晶合集成	2023年4月24日	6个月	新股锁定	19.86	18.06	1,444	28,677.84	26,078.64		-
688334	西高院	2023年6月9日	6个月	新股锁定	14.16	16.21	514	7,278.24	8,331.94		-
688343	云天励飞	2023年3月28日	6个月	新股锁定	43.92	50.67	3,827	168,081.84	193,914.09		-
688352	颀中科技	2023年4月11日	6个月	新股锁定	12.10	12.07	728	8,808.80	8,786.96		-
688361	中科飞测	2023年5月12日	6个月	新股锁定	23.60	64.67	243	5,734.80	15,714.81		-
688429	时创能源	2023年6月20日	6个月	新股锁定	19.20	25.53	222	4,262.40	5,667.66		-

688443	智翔金泰	2023年6月13日	6个月	新股锁定	37.88	29.49	399	15,114.12	11,766.51	-
688469	中芯集成	2023年4月28日	6个月	新股锁定	5.69	5.41	2,726	15,510.94	14,747.66	-
688472	阿特斯	2023年6月2日	6个月	新股锁定	11.10	17.04	932	10,345.20	15,881.28	-
688478	晶升股份	2023年4月13日	6个月	新股锁定	32.52	42.37	293	9,528.36	12,414.41	-
688484	南芯科技	2023年3月28日	6个月	新股锁定	39.99	36.71	238	9,517.62	8,736.98	-
688485	九州一轨	2023年1月11日	6个月	新股锁定	17.47	15.17	3,287	57,423.89	49,863.79	-
688502	茂莱光学	2023年2月28日	6个月	新股锁定	69.72	178.59	1,098	76,552.56	196,091.82	-
688523	航天环宇	2023年5月26日	6个月	新股锁定	21.86	23.85	339	7,410.54	8,085.15	-
688535	华海诚科	2023年3月28日	6个月	新股锁定	35.00	51.23	140	4,900.00	7,172.20	-
688543	国科军工	2023年6月14日	6个月	新股锁定	43.67	53.05	157	6,856.19	8,328.85	-
688570	天玛智控	2023年5月29日	6个月	新股锁定	30.26	25.33	266	8,049.16	6,737.78	-
688581	安杰思	2023年5月12日	6个月	新股锁定	125.80	118.03	57	7,170.60	6,727.71	-
688582	芯动联科	2023年6月21日	6个月	新股锁定	26.74	40.68	219	5,856.06	8,908.92	-
688623	双元科技	2023年5月31日	6个月	新股锁定	125.88	86.79	64	8,056.32	5,554.56	-

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行

业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

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

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

#### **6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### **6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**

##### **6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

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

##### **6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购**

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

#### **6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券**

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

#### **6.4.13 金融工具风险及管理**

##### **6.4.13.1 风险管理政策和组织架构**

本基金是一只主动投资的混合型证券投资基金，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相对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及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，因此违约风险可能性很小。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。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

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（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，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》（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）。

本基金所持证券均在证券交易所上市，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。本基金所持证券均在证券交易所上市，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。

#### 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、存出保证金、交易性金融资产等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	13,626,920.81	-	-	-	13,626,920.81
结算备付金	1,744,449.23	-	-	-	1,744,449.23
存出保证金	112,328.32	-	-	-	112,328.32
交易性金融资产	-	-	-	-180,268,403.24	180,268,403.24
应收申购款	-	-	-	70,167.28	70,167.28
应收清算款	-	-	-	139,843.40	139,843.40
<b>资产总计</b>	<b>15,483,698.36</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-180,478,413.92</b>	<b>195,962,112.28</b>
<b>负债</b>					
应付赎回款	-	-	-	191,889.83	191,889.83
应付管理人报酬	-	-	-	261,412.89	261,412.89
应付托管费	-	-	-	43,568.80	43,568.80
应付清算款	-	-	-	475,227.06	475,227.06
应付销售服务费	-	-	-	24,855.04	24,855.04
其他负债	-	-	-	957,558.99	957,558.99
<b>负债总计</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>1,954,512.61</b>	<b>1,954,512.61</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>15,483,698.36</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-178,523,901.31</b>	<b>194,007,599.67</b>
上年度末 2022 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	28,825,297.36	-	-	-	28,825,297.36
结算备付金	1,554,614.84	-	-	-	1,554,614.84
存出保证金	80,189.03	-	-	-	80,189.03
交易性金融资产	-	-	-	-208,459,514.37	208,459,514.37
应收申购款	-	-	-	105,299.91	105,299.91
应收清算款	-	-	-	67,851.63	67,851.63
资产总计	30,460,101.23	-	-	-208,632,665.91	239,092,767.14
负债					
应付赎回款	-	-	-	147,002.83	147,002.83
应付管理人报酬	-	-	-	308,196.79	308,196.79
应付托管费	-	-	-	51,366.13	51,366.13
应付销售服务费	-	-	-	11,467.25	11,467.25
其他负债	-	-	-	1,064,152.60	1,064,152.60
负债总计	-	-	-	1,582,185.60	1,582,185.60
利率敏感度缺口	30,460,101.23	-	-	-207,050,480.31	237,510,581.54

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下和自下而上相结合”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，做出资产配置及投资组合构建的策略；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价格风险。本基金投资组合中股票投资比例为基金总资产

的 60%-95%，其中，投资于价值型股票的比例不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券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 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 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	180,268,403.24	92.92	208,459,514.37	87.77
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	180,268,403.24	92.92	208,459,514.37	87.77

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023 年 6 月 30 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	1. 业绩比较基准上升 5%	12,860,285.46	16,029,076.95
1. 业绩比较基准下降 5%	-12,860,285.46	-16,029,076.95	

#### 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	上年度末 2022年12月31日
第一层次	179,113,700.82	208,366,217.03
第二层次	228,765.05	-
第三层次	925,937.37	93,297.34
合计	180,268,403.24	208,459,514.37

##### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

##### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

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

##### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	180,268,403.24	91.99
	其中：股票	180,268,403.24	91.99

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	15,371,370.04	7.84
8	其他各项资产	322,339.00	0.16
9	合计	195,962,112.28	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	8,157,559.40	4.20
B	采矿业	-	-
C	制造业	23,150,364.56	11.93
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	35,447.47	0.02
E	建筑业	10,208,431.22	5.26
F	批发和零售业	20,173.02	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	12,531,009.00	6.46
H	住宿和餐饮业	5,764,969.00	2.97
I	信息传输、软件和信息技术服务业	211,582.77	0.11
J	金融业	91,328,707.73	47.07
K	房地产业	24,621,843.94	12.69
L	租赁和商务服务业	4,164,407.00	2.15
M	科学研究和技术服务业	8,331.94	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	49,863.79	0.03
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	15,712.40	0.01
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-

	合计	180,268,403.24	92.92
--	----	----------------	-------

### 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	600030	中信证券	517,330	10,232,787.40	5.27
2	601318	中国平安	210,777	9,780,052.80	5.04
3	002142	宁波银行	336,910	8,523,823.00	4.39
4	600958	东方证券	865,396	8,394,341.20	4.33
5	600048	保利发展	633,000	8,247,990.00	4.25
6	600383	金地集团	1,055,125	7,607,451.25	3.92
7	600036	招商银行	208,200	6,820,632.00	3.52
8	603885	吉祥航空	417,600	6,443,568.00	3.32
9	601128	常熟银行	872,000	5,947,040.00	3.07
10	000001	平安银行	526,571	5,913,392.33	3.05
11	600258	首旅酒店	304,220	5,764,969.00	2.97
12	000858	五粮液	30,400	4,972,528.00	2.56
13	600029	南方航空	815,100	4,915,053.00	2.53
14	601077	渝农商行	1,355,700	4,866,963.00	2.51
15	000002	万科A	345,612	4,845,480.24	2.50
16	001201	东瑞股份	183,160	4,412,324.40	2.27
17	600919	江苏银行	574,000	4,218,900.00	2.17
18	601988	中国银行	1,065,800	4,167,278.00	2.15
19	002939	长城证券	500,700	4,070,691.00	2.10
20	601658	邮储银行	816,700	3,993,663.00	2.06
21	001979	招商蛇口	300,915	3,920,922.45	2.02
22	300498	温氏股份	204,100	3,745,235.00	1.93
23	601800	中国交建	335,900	3,664,669.00	1.89
24	002567	唐人神	545,900	3,630,235.00	1.87
25	601668	中国建筑	588,300	3,376,842.00	1.74
26	601377	兴业证券	525,850	3,218,202.00	1.66
27	601390	中国中铁	417,400	3,163,892.00	1.63
28	601288	农业银行	893,900	3,155,467.00	1.63
29	603300	华铁应急	578,500	3,152,825.00	1.63
30	002100	天康生物	379,400	3,130,050.00	1.61
31	002791	坚朗五金	47,700	3,086,667.00	1.59
32	601966	玲珑轮胎	116,400	2,586,408.00	1.33
33	601211	国泰君安	176,800	2,473,432.00	1.27
34	601398	工商银行	447,500	2,156,950.00	1.11
35	002475	立讯精密	65,500	2,125,475.00	1.10
36	000776	广发证券	135,200	1,988,792.00	1.03

37	300702	天宇股份	70,500	1,711,035.00	0.88
38	601021	春秋航空	20,400	1,172,388.00	0.60
39	300662	科锐国际	28,600	1,011,582.00	0.52
40	601916	浙商银行	338,600	893,904.00	0.46
41	002088	鲁阳节能	33,600	619,584.00	0.32
42	600109	国金证券	59,100	512,397.00	0.26
43	688239	航宇科技	4,090	286,095.50	0.15
44	688502	茂莱光学	1,098	196,091.82	0.10
45	688343	云天励飞	3,827	193,914.09	0.10
46	688331	荣昌生物	3,439	191,724.25	0.10
47	301395	仁信新材	2,944	78,545.92	0.04
48	301292	海科新源	3,183	63,628.17	0.03
49	688485	九州一轨	3,287	49,863.79	0.03
50	301202	朗威股份	1,703	43,971.46	0.02
51	301261	恒工精密	1,155	42,619.50	0.02
52	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.02
53	688249	晶合集成	1,444	26,078.64	0.01
54	688472	阿特斯	932	15,881.28	0.01
55	688361	中科飞测	243	15,714.81	0.01
56	301293	三博脑科	220	15,712.40	0.01
57	301358	湖南裕能	344	14,754.16	0.01
58	688469	中芯集成	2,726	14,747.66	0.01
59	301419	阿莱德	330	14,470.50	0.01
60	301325	曼恩斯特	128	13,817.60	0.01
61	301320	豪江智能	642	13,238.04	0.01
62	688478	晶升股份	293	12,414.41	0.01
63	301317	鑫磊股份	459	12,012.03	0.01
64	688443	智翔金泰	399	11,766.51	0.01
65	301307	美利信	330	10,513.80	0.01
66	301315	威士顿	189	9,661.68	0.00
67	301246	宏源药业	298	9,151.58	0.00
68	688146	中船特气	239	9,113.07	0.00
69	301360	荣旗科技	98	9,074.80	0.00
70	688582	芯动联科	219	8,908.92	0.00
71	688352	颀中科技	728	8,786.96	0.00
72	688484	南芯科技	238	8,736.98	0.00
73	301383	天键股份	238	8,501.36	0.00
74	688334	西高院	514	8,331.94	0.00
75	688543	国科军工	157	8,328.85	0.00
76	301225	恒勃股份	249	8,281.74	0.00
77	688523	航天环宇	339	8,085.15	0.00
78	301262	海看股份	314	8,007.00	0.00
79	301291	明阳电气	249	7,726.47	0.00

80	001287	中电港	367	7,714.34	0.00
81	688535	华海诚科	140	7,172.20	0.00
82	301355	南王科技	417	6,984.75	0.00
83	301210	金杨股份	140	6,883.80	0.00
84	301322	绿通科技	129	6,867.96	0.00
85	301157	华塑科技	129	6,827.97	0.00
86	688570	天玛智控	266	6,737.78	0.00
87	688581	安杰思	57	6,727.71	0.00
88	301232	飞沃科技	115	6,718.30	0.00
89	601061	中信金属	824	6,245.92	0.00
90	301376	致欧科技	276	6,212.76	0.00
91	301397	溯联股份	149	5,989.80	0.00
92	301281	科源制药	238	5,973.80	0.00
93	300804	广康生化	173	5,703.81	0.00
94	688429	时创能源	222	5,667.66	0.00
95	301323	新莱福	143	5,628.48	0.00
96	688623	双元科技	64	5,554.56	0.00
97	301439	泓淋电力	317	5,357.30	0.00
98	301345	涛涛车业	90	4,197.60	0.00
99	601065	江盐集团	283	3,350.72	0.00
100	601133	柏诚股份	247	3,028.22	0.00
101	001282	三联锻造	81	2,675.43	0.00
102	001360	南矿集团	147	2,185.89	0.00
103	001367	海森药业	55	2,171.40	0.00
104	603125	常青科技	88	2,158.64	0.00
105	001324	长青科技	107	2,097.20	0.00
106	603172	万丰股份	122	1,967.86	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	600036	招商银行	18,661,723.00	7.86
2	601111	中国国航	16,340,195.00	6.88
3	601658	邮储银行	15,326,041.00	6.45
4	603885	吉祥航空	14,756,398.28	6.21
5	600029	南方航空	13,300,777.00	5.60
6	601800	中国交建	13,006,279.00	5.48
7	000001	平安银行	12,751,066.00	5.37
8	600258	首旅酒店	12,533,648.00	5.28
9	601390	中国中铁	12,079,234.00	5.09
10	002415	海康威视	11,804,152.00	4.97
11	600030	中信证券	11,484,646.00	4.84

12	601618	中国中冶	10,494,386.00	4.42
13	601318	中国平安	9,956,392.67	4.19
14	603799	华友钴业	9,798,886.00	4.13
15	601288	农业银行	9,571,718.00	4.03
16	603517	绝味食品	9,405,969.00	3.96
17	601628	中国人寿	9,201,016.00	3.87
18	001979	招商蛇口	9,085,932.46	3.83
19	688223	晶科能源	9,062,030.62	3.82
20	600048	保利发展	8,787,210.00	3.70
21	601377	兴业证券	8,697,177.20	3.66
22	600109	国金证券	8,572,394.00	3.61
23	601988	中国银行	8,504,931.00	3.58
24	002939	长城证券	8,353,728.00	3.52
25	002555	三七互娱	8,262,226.00	3.48
26	600958	东方证券	7,934,624.36	3.34
27	000858	五粮液	7,846,373.18	3.30
28	600383	金地集团	7,669,534.00	3.23
29	000776	广发证券	7,543,723.00	3.18
30	002142	宁波银行	7,404,589.70	3.12
31	601668	中国建筑	7,068,806.00	2.98
32	601077	渝农商行	6,838,463.00	2.88
33	601166	兴业银行	6,774,326.00	2.85
34	601669	中国电建	6,371,675.00	2.68
35	601233	桐昆股份	6,336,397.00	2.67
36	603300	华铁应急	6,089,784.00	2.56
37	000301	东方盛虹	6,088,955.00	2.56
38	600809	山西汾酒	6,078,044.99	2.56
39	600256	广汇能源	6,027,466.00	2.54
40	601998	中信银行	5,920,832.00	2.49
41	600919	江苏银行	5,787,945.00	2.44
42	000625	长安汽车	5,501,386.10	2.32
43	001201	东瑞股份	5,289,161.29	2.23
44	002624	完美世界	5,286,255.00	2.23
45	688599	天合光能	4,813,453.91	2.03

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	000001	平安银行	26,641,819.00	11.22
2	601166	兴业银行	24,497,995.49	10.31
3	601658	邮储银行	22,339,922.32	9.41
4	601318	中国平安	19,442,114.13	8.19

5	601628	中国人寿	15,800,043.00	6.65
6	600036	招商银行	15,576,393.00	6.56
7	601111	中国国航	15,101,729.00	6.36
8	600030	中信证券	14,006,006.00	5.90
9	600109	国金证券	13,877,622.00	5.84
10	601390	中国中铁	13,370,422.00	5.63
11	002415	海康威视	12,407,530.00	5.22
12	000776	广发证券	12,048,365.00	5.07
13	002555	三七互娱	11,766,966.42	4.95
14	600029	南方航空	11,625,356.00	4.89
15	601800	中国交建	11,450,025.00	4.82
16	601618	中国中冶	10,921,341.00	4.60
17	001979	招商蛇口	10,177,152.99	4.28
18	603885	吉祥航空	9,856,115.00	4.15
19	603799	华友钴业	9,756,468.00	4.11
20	600502	安徽建工	9,469,885.00	3.99
21	688223	晶科能源	8,886,852.54	3.74
22	600926	杭州银行	8,570,306.00	3.61
23	600048	保利发展	7,957,558.00	3.35
24	603517	绝味食品	7,234,771.00	3.05
25	600958	东方证券	7,137,647.84	3.01
26	601998	中信银行	6,986,018.00	2.94
27	601233	桐昆股份	6,555,616.00	2.76
28	600383	金地集团	6,494,524.00	2.73
29	601669	中国电建	6,244,665.27	2.63
30	601288	农业银行	6,209,538.00	2.61
31	600496	精工钢构	6,141,009.00	2.59
32	000301	东方盛虹	5,929,392.00	2.50
33	600809	山西汾酒	5,752,271.00	2.42
34	601211	国泰君安	5,665,368.00	2.39
35	601377	兴业证券	5,610,009.00	2.36
36	000625	长安汽车	5,543,231.40	2.33
37	600256	广汇能源	5,510,603.00	2.32
38	002624	完美世界	5,508,964.95	2.32
39	000002	万 科 A	5,245,982.00	2.21
40	600258	首旅酒店	4,965,037.00	2.09

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	598,854,211.10
卖出股票收入（成交）总额	621,824,105.54

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

华宝价值发现混合截止 2023 年 06 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中，东方证券股份有限公司因在开展股票质押业务、子公司投资等业务过程中，未按照审慎经营的原则，有效控制和防范风险，存在部分业务决策流于形式、风险管理不到位和内部控制不健全等问题。于 2022 年 8 月 3 日收到上海证监局对公司采取出具警示函的监督管理措施。

华宝价值发现混合截止 2023 年 06 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中，中国平安保险(集团)股份有限公司因未按照规定进行国际收支统计申报于 2022 年 8 月 22 日收到国家外汇管理局深圳市分局责令改正、给予警告并处罚款人民币 30 万元的处罚决定。

华宝价值发现混合截止 2023 年 06 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中，招商银行股份有限公司因信贷业务违规，违反审慎经营规则，内部管理与控制制度不健全或执行监督不力，内控管理未形成有效风险控制；于 2022 年 09 月 09 日收到银保监会罚款的处罚措施。

华宝价值发现混合截止 2023 年 06 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中，招商银行股份有限公司

公司因：一是多期债务融资工具未按照发行文件约定开展余额包销，个别债务融资工具挤占了其他投资人的正常投标，违背了公平公正原则，并影响了发行利率。二是低价包销多期债务融资工具，影响了市场正常秩序。三是债务融资工具承销协议的签订不规范。四是多期债务融资工具的簿记建档利率区间未在充分询价基础上形成，发行工作程序执行不到位、工作开展不规范；于 2023 年 01 月 18 日收到中国银行间市场交易商协会警告，责令改正的处罚措施。

华宝价值发现混合截止 2023 年 06 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中，平安银行股份有限公司因作为相关债务融资工具联席主承销商，未按发行文件约定，取利率区间上限开展余额包销，相关行为挤占了其他市场投资人的份额，损害了其他投资人权益，并影响了发行利率，对市场正常秩序造成了一定不良影响；于 2023 年 01 月 18 日收到中国银行间市场交易商协会责令改正，通报批评的处罚措施。

华宝价值发现混合截止 2023 年 06 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中，中信证券股份有限公司因未按规定履行客户身份识别义务，未按规定保存客户身份资料和交易记录，未按规定报送大额交易或者可疑交易报告；于 2023 年 02 月 06 日收到中国人民银行罚款的处罚措施。

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

### 7.12.2 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

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	112,328.32
2	应收清算款	139,843.40
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	70,167.28
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	322,339.00

### 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 (%)
华宝价值发现混合 A	29,198	3,332.13	37,609,702.20	38.66	59,681,822.37	61.34
华宝价值发现混合 C	6,618	5,177.78	24,310,879.83	70.95	9,955,677.05	29.05
合计	35,816	3,673.17	61,920,582.03	47.07	69,637,499.42	52.93

### 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	华宝价值发现混合 A	32,365.79	0.0333
	华宝价值发现混合 C	0.00	0.0000
	合计	32,365.79	0.0246

### 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	华宝价值发现混合 A	0
	华宝价值发现混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	华宝价值发现混合 A	0
	华宝价值发现混合 C	0
	合计	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华宝价值发现混合 A	华宝价值发现混合 C
基金合同生效日 (2018 年 1 月 24 日) 基金份额总额	1,230,830,153.56	-
本报告期期初基金份额总额	138,157,082.33	18,846,436.58
本报告期基金总申购份额	34,755,433.09	50,415,398.28
减：本报告期基金总赎回份额	75,620,990.85	34,995,277.98
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	97,291,524.57	34,266,556.88

## § 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

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：自 2019 年 11 月 20 日起至本报告期末。

## 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚的情况。

### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人及其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 (%)	
德邦证券	2	280,701,334.65	23.10	260,939.22	23.14	-
中信建投	2	277,508,252.65	22.84	258,445.69	22.92	-
申万宏源	1	200,488,676.23	16.50	184,710.57	16.38	-
平安证券	1	138,963,864.98	11.44	129,415.43	11.48	-
国泰君安	2	89,654,785.13	7.38	83,495.54	7.41	-
东吴证券	2	73,716,719.52	6.07	68,652.30	6.09	-
方正证券	3	47,305,367.73	3.89	44,055.85	3.91	-
浙商证券	1	37,595,100.00	3.09	34,636.13	3.07	-
申港证券	2	25,369,181.19	2.09	23,625.44	2.10	-
上海证券	1	19,621,916.94	1.61	18,077.58	1.60	-
长城证券	2	13,818,031.40	1.14	12,868.57	1.14	-
西部证券	2	5,228,102.00	0.43	3,823.33	0.34	-
中金国际	1	2,641,647.58	0.22	2,460.24	0.22	-
中信证券	2	2,368,148.00	0.19	2,181.79	0.19	-
民生证券	1	139,994.40	0.01	128.98	0.01	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
东方财富	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
宏信证券	2	-	-	-	-	-
华安证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-

麦高证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-

注：1. 基金管理人选择交易单元的标准和程序如下：

(1) 选择标准： 资质雄厚，信誉良好，注册资本不少于 5 亿元人民币；财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；经营行为规范，最近两年未因重大违规行为受到中国证监会和中国人民银行处罚；内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；具备基金运作所需要的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需，并能为本基金提供全面的信息服务；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退租的有：宏信证券、天风证券。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

本基金本报告期内未租用证券公司交易单元进行其他证券投资。

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华宝基金关于华宝价值发现混合型证券投资基金新增华西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	2023-01-10
2	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	2023-01-13
3	华宝价值发现混合型证券投资基金 2022 年第 4 季度报告	基金管理人网站	2023-01-19
4	华宝基金关于旗下部分基金新增海通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	2023-02-27
5	华宝价值发现混合型证券投资基金（A 类份额）基金产品资料概要（更新）	基金管理人网站	2023-03-02
6	华宝价值发现混合型证券投资基金（C 类份额）基金产品资料概要（更新）	基金管理人网站	2023-03-02
7	华宝价值发现混合型证券投资基金招	基金管理人网站	2023-03-02

	募说明书（更新）		
8	华宝基金关于华宝价值发现混合型证券投资基金 C 类新增广发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	2023-03-24
9	华宝价值发现混合型证券投资基金 2022 年年度报告	基金管理人网站	2023-03-31
10	华宝基金关于旗下部分基金新增中邮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	2023-04-17
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	华宝基金管理有限公司旗下部分基金季度报告提示性公告	上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2023-04-22
13	华宝价值发现混合型证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	基金管理人网站	2023-04-23
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	华宝基金关于旗下部分基金新增西部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	2023-06-16
17	华宝基金关于旗下部分基金新增德邦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	2023-06-29

## § 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	20230101~20230601	52,750,852.87	0.00	52,750,852.87	0.00	0.00
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。</p> <p>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</p>							

动性风险、市场风险，保护持有人利益。

## 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

中国证监会批准基金设立的文件；  
华宝价值发现混合型证券投资基金基金合同；  
华宝价值发现混合型证券投资基金招募说明书；  
华宝价值发现混合型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