

华宝中证 500 指数增强型发起式证券投资 基金 2019 年半年度报告

2019 年 6 月 30 日

基金管理人：华宝基金管理有限公司

基金托管人：中国民生银行股份有限公司

送出日期：2019 年 8 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 8 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
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.....	15
§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 托管人对本半年度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）	17
6.1 资产负债表.....	17
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.....	43
7.1 期末基金资产组合情况.....	43
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	43
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	54
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	56
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.....	56
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.....	56
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	56
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	56
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	56
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	57
7.12 投资组合报告附注.....	57
§8 基金份额持有人信息.....	59
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	59
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	59
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的情况.....	59
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....	60
§9 开放式基金份额变动.....	61
§10 重大事件揭示.....	62
10.1 基金份额持有人大会决议.....	62
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.....	62
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	62
10.4 基金投资策略的改变.....	62
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	62
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.....	62
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	62
10.8 其他重大事件.....	63
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	66

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	66
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	66
§12 备查文件目录.....	67
12.1 备查文件目录.....	67
12.2 存放地点.....	67
12.3 查阅方式.....	67

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华宝中证 500 指数增强型发起式证券投资基金	
基金简称	华宝中证 500 增强	
基金主代码	005607	
交易代码	005607	
基金运作方式	契约型开放式、发起式	
基金合同生效日	2018 年 4 月 19 日	
基金管理人	华宝基金管理有限公司	
基金托管人	中国民生银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	48,149,211.52 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	中证 500 增强 A	中证 500 增强 C
下属分级基金的交易代码:	005607	005608
报告期末下属分级基金的份额总额	31,764,145.48 份	16,385,066.04 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为中证 500 指数增强型基金,在实现对中证 500 指数有效跟踪的基础上,通过数量化的方法进行积极的组合配置和管理,力争实现超越标的指数的投资收益。
投资策略	<p>本基金在复制标的指数的基础上优化投资组合,力求通过量化技术实现指数增强的效果。</p> <p>1、资产配置策略 本基金主要投资于中证 500 指数成分股及备选股票,也会根据中证 500 股指期货的基差情况择机部分使用期货替代现货,降低成本。视市场情况本基金也会谨慎地参与一些绝对收益策略。同时,本基金将预留必要的现金,应对期货保证金的增加要求或投资者的赎回申请。</p> <p>2、股票投资策略 本基金主要采用量化行业配置模型和量化 Alpha 选股模型构建指数增强股票组合。在控制跟踪偏离度的前提下力争实现超额表现,并根据市场变化趋势,定期对模型进行调整,以改进模型的有效性。</p> <p>3、股指期货投资策略 在不同的市场环境下,本基金将综合考虑股指期货相对现货的基差、流动性、展期收益以及保证金要求等因素,选择部分使用股指期货多头合约替代指数现货,以求提高资金利用效率和组合收益水平。</p> <p>4、债券投资策略 本基金基于流动性管理及策略性投资的需要,可投资于债券、货币市场工具和资产支持证券,以保证基金资产流动性,有效利用基金资产,提高基金资产的投资收益。</p>
业绩比较基准	中证 500 指数收益率*95%+银行活期存款利率(税后)*5%。

风险收益特征	本基金为股票型基金，属于高预期风险、高预期收益的证券投资基金品种，其预期风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。
--------	--

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华宝基金管理有限公司	中国民生银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	刘月华	罗菲菲
	联系电话	021-38505888	010-58560666
	电子邮箱	xxpl@fsfund.com	tgbfxjdzx@cmbc.com.cn
客户服务电话		400-700-5588、 021-38924558	95568
传真		021-38505777	010-58560798
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼	北京市西城区复兴门内大街 2 号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼	北京市西城区复兴门内大街 2 号
邮政编码		200120	100031
法定代表人		孔祥清	洪崎

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.fsfund.com
基金半年度报告备置地点	本基金半年报置备地点包括基金管理人办公场所和基金托管人办公场所。

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	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

基金级别	中证 500 增强 A	中证 500 增强 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019 年 1 月 1 日 - 2019 年 6 月 30 日)	报告期(2019 年 1 月 1 日 - 2019 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	2,639,801.18	1,073,779.37
本期利润	3,173,769.44	1,359,479.64
加权平均基金份额本期利润	0.1074	0.0927
本期加权平均净值利润率	12.33%	10.73%
本期基金份额净值增长率	14.05%	13.82%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	-4,217,220.02	-2,243,135.36
期末可供分配基金份额利润	-0.1328	-0.1369
期末基金资产净值	27,546,925.46	14,141,930.68
期末基金份额净值	0.8672	0.8631
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	-13.28%	-13.69%

注：1、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

中证 500 增强 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	1.89%	1.19%	0.75%	1.32%	1.14%	-0.13%
过去三个月	-9.65%	1.62%	-10.21%	1.72%	0.56%	-0.10%
过去六个月	14.05%	1.62%	17.87%	1.70%	-3.82%	-0.08%

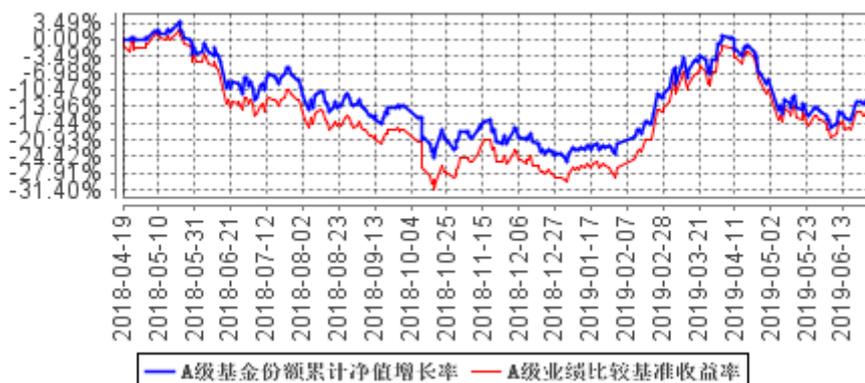
过去一年	-5.66%	1.54%	-4.70%	1.60%	-0.96%	-0.06%
自基金合同生效日起至今	-13.28%	1.49%	-16.13%	1.57%	2.85%	-0.08%

中证 500 增强 C

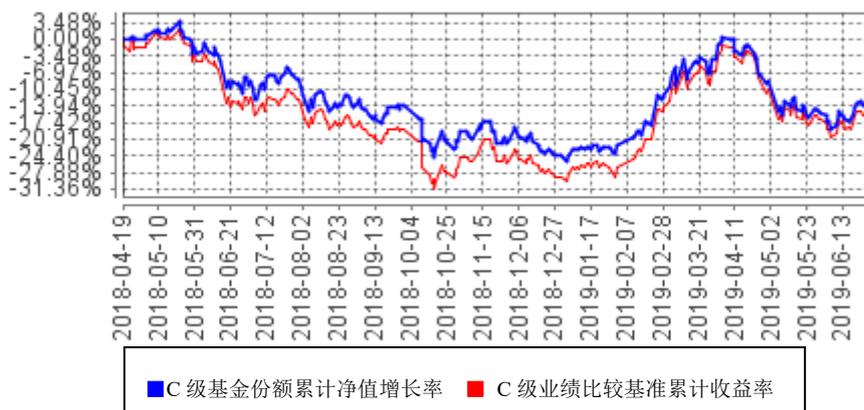
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	1.85%	1.19%	0.75%	1.32%	1.10%	-0.13%
过去三个月	-9.74%	1.62%	-10.21%	1.72%	0.47%	-0.10%
过去六个月	13.82%	1.62%	17.87%	1.70%	-4.05%	-0.08%
过去一年	-6.03%	1.54%	-4.70%	1.60%	-1.33%	-0.06%
自基金合同生效日起至今	-13.69%	1.49%	-16.13%	1.57%	2.44%	-0.08%

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

A级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



C 级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：按照基金合同的约定，自基金成立日期的 6 个月内达到规定的资产组合，截至 2018 年 10 月 19 日，本基金已达到合同规定的资产配置比例。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
丰晨成	本基金基金经理、上证 180 价值	2018 年 4 月 19 日	-	9 年	硕士。2009 年加入华宝基金管理有限公司，先后担任助理产品经理、数量分析师、投资经理助理、投

	ETF、华宝上证 180 价值 ETF 联接、华宝中证全指证券公司 ETF、华宝券商 ETF 联接、华宝中证 1000 指数分级基金经理			资经理等职务。2015 年 11 月起任上证 180 价值交易型开放式指数证券投资基金、华宝上证 180 价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，2016 年 8 月起任华宝中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2018 年 4 月起任华宝中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金经理，2018 年 6 月起任华宝中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理，2018 年 8 月起任华宝中证 1000 指数分级证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--

注：1、任职日期以及离任日期均以基金公告为准。

2、证券从业含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《华宝中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋取最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

票、债券)的收益率差异以及连续四个季度期间内、不同时间窗下同向交易的交易价差;分析结果未发现异常情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,基金管理人未发生所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%。

本报告期内,本基金未发现异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

中证 500 指数增强基金运用量化选股模型和行业配置模型进行股票筛选和权重配置,精选具有合理估值的高成长性股票,在跟踪中证 500 指数的基础上力争实现稳定的超越指数的表现。2019 年上半年虽然市场对于宏观经济的预期不高,但市场创出了近几年少有的单季度涨幅,在上涨过程中以中证 500 为代表的中小市值指数表现较好,但由于在二月份急速上涨过程中基本面因子失效严重,因子收益与模型预期效果出现较大背离,导致一季度组合相对于基准指数没有取得正的超额收益。在二季度该情况有所好转,报告期相对基准指数取得了一定的超额收益。

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金份额 A 净值增长率为 14.05%;本报告期基金份额 C 净值增长率为 13.82%;同期业绩比较基准收益率为 17.87%。

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,经济增速虽然大概率处于逐渐降速的过程中,但宏观经济抵御内外风险的韧性仍在,货币政策不排除部分层面边际宽松的可能。我们秉持 GARP 选股逻辑,通过量化方法克服恐惧心理,同时也根据运行期的累计表现和经验不断研究改进现有模型的途径方法,力争保持模型的稳定性的同时也提高其获取超额收益的水平。未来,我们认为中证 500 指数作为中盘股的基准指数,在目前点位有较好的中期配置价值。

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

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本基金管理人设有估值委员会，定期评价现行估值政策和程序，在发生了影响估值政策和程序的有效性、适用性的情况后及时修订估值方法。基金在投资新品种时，由估值委员会评价现有估值政策和程序的适用性。

(1) 日常估值流程

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

(2) 特殊业务估值流程

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

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

在重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

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

截止 2019 年 6 月 30 日，本基金基金合同生效未满三年，基金管理人暂无需对基金持有人数或基金资产净值进行预警说明。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国民生银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，依法安全保管了基金财产，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

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

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查的本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华宝中证 500 指数增强型发起式证券投资基金

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	2,486,267.24	3,880,836.39
结算备付金		723,639.23	520,809.91
存出保证金		23,030.86	262,333.82
交易性金融资产	6.4.7.2	38,925,668.24	28,347,373.84
其中：股票投资		38,925,668.24	28,347,373.84
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		158,842.47	-
应收利息	6.4.7.5	700.15	981.41
应收股利		-	-
应收申购款		41,034.82	148,970.56
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		42,359,183.01	33,161,305.93
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		40,552.04	726,793.12
应付赎回款		414,508.09	12,609.60
应付管理人报酬		33,426.63	27,663.67
应付托管费		4,011.19	3,319.66
应付销售服务费		4,516.46	3,425.10
应付交易费用	6.4.7.7	128,982.26	97,394.81

应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	44,330.20	120,001.01
负债合计		670,326.87	991,206.97
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	48,149,211.52	42,343,581.88
未分配利润	6.4.7.10	-6,460,355.38	-10,173,482.92
所有者权益合计		41,688,856.14	32,170,098.96
负债和所有者权益总计		42,359,183.01	33,161,305.93

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，中证 500 增强 A 基金份额净值 0.8672 元，基金份额总额 31,764,145.48 份；中证 500 增强 C 基金份额净值 0.8631 元，基金份额总额 16,385,066.04 份。华宝中证 500 增强份额总额合计为 48,149,211.52 份。

6.2 利润表

会计主体：华宝中证 500 指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 4 月 19 日(基金 合同生效日)至 2018 年 6 月 30 日
一、收入		5,267,923.21	-1,850,558.40
1.利息收入		14,703.75	78,503.47
其中：存款利息收入	6.4.7.11	14,703.75	20,365.87
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		-	58,137.60
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		4,396,897.50	-412,328.11
其中：股票投资收益	6.4.7.12	3,894,053.18	-486,595.88
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	132,233.01	-143,920.00
股利收益	6.4.7.16	370,611.31	218,187.77
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	819,668.53	-1,577,578.52

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	36,653.43	60,844.76
减：二、费用		734,674.13	232,670.25
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	189,776.15	81,594.36
2. 托管费	6.4.10.2.2	22,773.16	9,791.35
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	25,106.93	14,863.17
4. 交易费用	6.4.7.19	442,415.81	84,412.03
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		436.37	-
7. 其他费用	6.4.7.20	54,165.71	42,009.34
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		4,533,249.08	-2,083,228.65
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		4,533,249.08	-2,083,228.65

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华宝中证 500 指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	42,343,581.88	-10,173,482.92	32,170,098.96
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	4,533,249.08	4,533,249.08
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	5,805,629.64	-820,121.54	4,985,508.10
其中：1. 基金申购款	28,380,065.56	-3,468,293.04	24,911,772.52

2. 基金赎回款	-22,574,435.92	2,648,171.50	-19,926,264.42
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	48,149,211.52	-6,460,355.38	41,688,856.14
项目	上年度可比期间 2018年4月19日(基金合同生效日)至2018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)	55,157,340.21	-	55,157,340.21
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-2,083,228.65	-2,083,228.65
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)	-20,522,775.03	-721,360.66	-21,244,135.69
其中: 1.基金申购款	5,875,113.82	-141,178.73	5,733,935.09
2.基金赎回款	-26,397,888.85	-580,181.93	-26,978,070.78
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)	34,634,565.18	-2,804,589.31	31,829,975.87

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>黄小慧</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

华宝中证 500 指数增强型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)系由基金管理人华宝基

金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《华宝中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)及其他有关法律法规的规定,经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)以证监许可[2018]15 号文批准公开募集。本基金为契约型开放式、发起式基金,存续期限为不定期,首次设立募集基金份额为 55,157,340.21 份,经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)验证,并出具了编号为德师报(验)字(18)第 00004 号的验资报告。基金合同于 2018 年 4 月 19 日正式生效。本基金的基金管理人为华宝基金管理有限公司,基金托管人为中国民生银行股份有限公司。

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《华宝中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》和《华宝中证 500 指数增强型发起式证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金可以参与融资和转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为:本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产的 80%,其中投资于中证 500 指数成分股及备选成分股的比例不低于非现金基金资产的 80%。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,基金保留的现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。本基金投资股指期货、权证及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准为:中证 500 指数收益率*95%+银行活期存款利率(税后)*5%。

本财务报表由本基金的基金管理人华宝基金管理有限公司于 2019 年 8 月 29 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颁布的企业会计准则及相关规定(以下简称“企业会计准则”)以及中国证监会发布的基金行业实务操作的有关规定编制,同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2019 半年度财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2019 年 6 月 30 日的财务状况以及 2019 半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金本报告期所采用的会计政策和会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

-

6.4.5.2 会计估计变更的说明

-

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2008]1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008 年 9 月 18 日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]48 号《关于实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税

[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

2) 对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不缴纳企业所得税。

3) 对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司在收到相关扣收税款当月的法定申报期内向主管税务机关申报缴纳；从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

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

5) 对于基金从事 A 股买卖，出让方按 0.10% 的税率缴纳证券(股票)交易印花税，对受让方不再缴纳印花税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
活期存款	2,486,267.24
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计：	2,486,267.24

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	38,559,575.05	38,925,668.24	366,093.19
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	38,559,575.05	38,925,668.24	366,093.19

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	573.81
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	114.10
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-

应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	1.84
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	10.40
合计	700.15

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
交易所市场应付交易费用	128,982.26
银行间市场应付交易费用	-
合计	128,982.26

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	746.11
预提费用	33,584.09
指数使用费	10,000.00
合计	44,330.20

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

中证 500 增强 A		
项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	29,247,088.16	29,247,088.16
本期申购	10,977,928.87	10,977,928.87
本期赎回(以“-”号填列)	-8,460,871.55	-8,460,871.55
- 基金拆分/份额折算前	-	-

基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	31,764,145.48	31,764,145.48

金额单位：人民币元

中证 500 增强 C		
项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	13,096,493.72	13,096,493.72
本期申购	17,402,136.69	17,402,136.69
本期赎回(以“-”号填列)	-14,113,564.37	-14,113,564.37
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	16,385,066.04	16,385,066.04

注：申购含红利再投以及转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

中证 500 增强 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-5,748,464.39	-1,259,085.21	-7,007,549.60
本期利润	2,639,801.18	533,968.26	3,173,769.44
本期基金份额交易产生的变动数	-182,598.74	-200,841.12	-383,439.86
其中：基金申购款	-1,353,126.09	64,803.37	-1,288,322.72
基金赎回款	1,170,527.35	-265,644.49	904,882.86
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-3,291,261.95	-925,958.07	-4,217,220.02

单位：人民币元

中证 500 增强 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-2,602,154.63	-563,778.69	-3,165,933.32
本期利润	1,073,779.37	285,700.27	1,359,479.64
本期基金份额交易产生的变动数	-237,542.92	-199,138.76	-436,681.68

其中：基金申购款	-2,340,688.89	160,718.57	-2,179,970.32
基金赎回款	2,103,145.97	-359,857.33	1,743,288.64
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,765,918.18	-477,217.18	-2,243,135.36

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
活期存款利息收入	12,237.45
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	2,006.40
其他	459.90
合计	14,703.75

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
卖出股票成交总额	144,776,086.59
减：卖出股票成本总额	140,882,033.41
买卖股票差价收入	3,894,053.18

6.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期内无债券投资收益。

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

-

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 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
国债期货投资收益	-
股指期货-投资收益	132,233.01

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	370,611.31
基金投资产生的股利收益	-
合计	370,611.31

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	766,508.53
——股票投资	766,508.53
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	53,160.00
减：应税金融商品公允价值变动产生的预 估增值税	-
合计	819,668.53

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
----	---------------------------------------

基金赎回费收入	28,801.55
转换费收入 005607	7,546.13
转换费收入 005608	305.75
合计	36,653.43

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	442,415.81
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	442,415.81

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
审计费用	14,876.39
信息披露费	18,707.70
指数使用费	20,000.00
银行汇划费用	581.62
其他	-
合计	54,165.71

6.4.7.21 分部报告

无。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无其它需作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6 月30日	上年度可比期间 2018年4月19日(基金合同生效日) 至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	189,776.15	81,594.36
其中：支付销售机构的客户维护费	51,453.78	21,072.41

注：支付基金管理人华宝基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.0% 的年费率计提，逐日累计

至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 1.0% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	2018 年 4 月 19 日(基金合同生效日)至 2018 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	22,773.16	9,791.35

注：支付基金托管人中国民生银行的托管费按前一日基金资产净值 0.12%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值 X 0.12% / 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中证 500 增强 A	中证 500 增强 C	合计
华宝基金	-	3,654.20	3,654.20
民生银行	-	6,125.67	6,125.67
华宝证券	-	8,649.14	8,649.14
合计	-	18,429.01	18,429.01
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2018 年 4 月 19 日(基金合同生效日)至 2018 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中证 500 增强 A	中证 500 增强 C	合计
华宝基金	-	264.48	264.48
民生银行	-	2,149.64	2,149.64
华宝证券	-	12,066.13	12,066.13
合计	-	14,480.25	14,480.25

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：
日基金销售服务费=前一日基金资产净值×约定年费率 / 当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间无与关联方进行的银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	
	中证 500 增强 A	中证 500 增强 C
基金合同生效日(2018 年 4 月 19 日) 持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	10,000,450.05	-
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	10,000,450.05	-
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	31.4800%	-

项目	上年度可比期间 2018 年 4 月 19 日(基金合同生效日)至 2018 年 6 月 30 日	
	中证 500 增强 A	中证 500 增强 C
基金合同生效日(2018 年 4 月 19 日) 持有的基金份额	10,000,450.05	-
期初持有的基金份额	-	-
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	10,000,450.05	-
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	28.8700%	-

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。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本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。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2018 年 4 月 19 日(基金合同生效日)至 2018 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
民生银行	2,486,267.24	12,237.45	3,833,131.53	18,661.99

注：本基金的银行存款由基金托管人中国民生银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本期及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.7 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（2019 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

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
601236	红塔证券	2019 年 6 月 26 日	2019 年 7 月 5 日	新股流通受限	3.46	3.46	9,789	33,869.94	33,869.94	-

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购

获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。此外，基金还可作为特定投资者，认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本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。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为指数增强型基金，在实现对中证 500 指数有效跟踪的基础上，通过数量化的方法进行积极的组合配置和管理，力争实现超越标的指数的投资收益。本基金属于高预期风险、高预期收益的证券投资基金品种，其预期风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资、股指期货等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，公司内部监督和反馈系统包括内部控制委员会、督察长、监察稽核部、风险管理部、各部门负责人和风险控制联络人、各业务岗位。内部控制委员会负责对公司在经营管理和基金运作中的风险进行评估并研究制订相应的控制制度。督察长向董事会负责，总管公司的内控事务并独立地就内控制度的执行情况履行检查、评价、报告和建议职能。风险管理部在督察长指导下对公司内部控制运行情况进行监控，主要针对公司内

部控制制度的总体构架和内部控制的目标进行评估并提出改进意见；监察稽核部在督察长的领导下对各部门和岗位的内部控制执行情况进行监督和核查，同时对内控的失控点进行查漏并责令改正。

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

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

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同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

-

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短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不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证

券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

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

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

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

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

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金、债券投资及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 2019 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	2,486,267.24	-	-	-	2,486,267.24
结算备付金	723,639.23	-	-	-	723,639.23
存出保证金	23,030.86	-	-	-	23,030.86
交易性金融资产	-	-	-	38,925,668.24	38,925,668.24
应收证券清算款	-	-	-	158,842.47	158,842.47
应收利息	-	-	-	700.15	700.15
应收申购款	4,359.83	-	-	36,674.99	41,034.82
资产总计	3,237,297.16	-	-	39,121,885.85	42,359,183.01
负债					
应付证券清算款	-	-	-	40,552.04	40,552.04
应付赎回款	-	-	-	414,508.09	414,508.09
应付管理人报酬	-	-	-	33,426.63	33,426.63
应付托管费	-	-	-	4,011.19	4,011.19
应付指数使用费	-	-	-	4,516.46	4,516.46
应付交易费用	-	-	-	128,982.26	128,982.26
其他负债	-	-	-	44,330.20	44,330.20
负债总计	-	-	-	670,326.87	670,326.87
利率敏感度缺口	3,237,297.16	-	-	38,451,558.98	41,688,856.14
上年度末 2018 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	3,880,836.39	-	-	-	3,880,836.39
结算备付金	520,809.91	-	-	-	520,809.91

存出保证金	18,685.82	-	-	243,648.00	262,333.82
交易性金融资产	-	-	-	-28,347,373.84	28,347,373.84
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	981.41	981.41
应收申购款	6,144.62	-	-	142,825.94	148,970.56
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	4,426,476.74	-	-	-28,734,829.19	33,161,305.93
负债					
应付证券清算款	-	-	-	726,793.12	726,793.12
应付赎回款	-	-	-	12,609.60	12,609.60
应付管理人报酬	-	-	-	27,663.67	27,663.67
应付托管费	-	-	-	3,319.66	3,319.66
应付销售服务费	-	-	-	3,425.10	3,425.10
应付交易费用	-	-	-	97,394.81	97,394.81
其他负债	-	-	-	120,001.01	120,001.01
负债总计	-	-	-	991,206.97	991,206.97
利率敏感度缺口	4,426,476.74	-	-	-27,743,622.22	32,170,098.96

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，基金管理人主要运用股指期货等空头工具对持有的股票等权益类多头组合进行对冲操作，规避权益类多头组合的市场系统性风险；同时预留必要的现金，以应对保证金的增加要求或投资者的赎回申请。在股票投资方面，主要采用

量化行业配置模型和量化本基金主要采用量化行业配置模型和量化 Alpha 选股模型构建指数增强股票组合，严格控制运作风险，并根据市场变化趋势，定期对模型进行调整，以改进模型的有效性，最大化超额收益。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金的投资组合比例为：投资于股票资产的比例不低于基金资产的 80%，其中投资于中证 500 指数成分股及备选成分股的比例不低于非现金基金资产的 80%。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。本基金投资股指期货、权证及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日		上年度末 2018 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	38,925,668.24	93.37	28,347,373.84	88.12
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	38,925,668.24	93.37	28,347,373.84	88.12

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(2019年6月) 上年度末(2018年12月)

		30 日)	31 日)
	比较基准+5%	1,971,644.68	-
	比较基准-5%	-1,971,644.68	-

注：于 2018 年 12 月 31 日，本基金成立尚未满一年，上年度末无足够历史经验数据计算其他价格风险对基金资产净值的影响。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 不以公允价值计量的金融工具

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

(b) 以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2019 年 06 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为人民币 38,891,798.30 元，属于第二层次的余额为人民币 33,869.94 元，无属于第三层次的余额（于 2018 年 12 月 31 日：第一层次为人民币 28,347,373.84 元，无属于第二层次和第三层次的余额）。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于本基金投资的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关证券公允价值应属第二层次或第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	38,925,668.24	91.89
	其中：股票	38,925,668.24	91.89
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	3,209,906.47	7.58
8	其他各项资产	223,608.30	0.53
9	合计	42,359,183.01	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	368,485.00	0.88
B	采矿业	992,963.80	2.38
C	制造业	18,626,121.28	44.68
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	949,883.00	2.28
E	建筑业	714,106.40	1.71
F	批发和零售业	930,662.00	2.23
G	交通运输、仓储和邮政业	1,173,208.00	2.81
H	住宿和餐饮业	161,820.00	0.39
I	信息传输、软件和信息技术服	2,992,279.24	7.18

	务业		
J	金融业	1,343,122.80	3.22
K	房地产业	1,632,941.00	3.92
L	租赁和商务服务业	617,339.00	1.48
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	248,381.40	0.60
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	126,316.00	0.30
Q	卫生和社会工作	209,370.00	0.50
R	文化、体育和娱乐业	1,150,398.00	2.76
S	综合	387,307.00	0.93
	合计	32,624,703.92	78.26

7.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	471,767.75	1.13
C	制造业	3,493,991.83	8.38
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	85,063.00	0.20
E	建筑业	59,666.00	0.14
F	批发和零售业	168,526.00	0.40
G	交通运输、仓储和邮政业	119,980.00	0.29
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	676,666.80	1.62
J	金融业	407,710.94	0.98
K	房地产业	311,176.00	0.75
L	租赁和商务服务业	77,924.00	0.19
M	科学研究和技术服务业	25,476.00	0.06
N	水利、环境和公共设施管理业	116,180.00	0.28
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	231,300.00	0.55
R	文化、体育和娱乐业	55,536.00	0.13
S	综合	-	-
	合计	6,300,964.32	15.11

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600872	中炬高新	8,400	359,772.00	0.86
2	002268	卫士通	12,100	295,845.00	0.71
3	300253	卫宁健康	20,200	286,436.00	0.69
4	002340	格林美	57,700	271,767.00	0.65
5	002127	南极电商	23,700	266,388.00	0.64
6	300383	光环新网	15,300	256,581.00	0.62
7	002273	水晶光电	21,700	251,286.00	0.60
8	002916	深南电路	2,460	250,723.20	0.60
9	600022	山东钢铁	145,100	242,317.00	0.58
10	300450	先导智能	7,200	241,920.00	0.58
11	600823	世茂股份	51,400	236,954.00	0.57
12	000778	新兴铸管	52,500	233,100.00	0.56
13	000878	云南铜业	21,600	229,608.00	0.55
14	600779	水井坊	4,500	228,690.00	0.55
15	603228	景旺电子	5,700	228,057.00	0.55
16	601231	环旭电子	18,600	224,130.00	0.54
17	002244	滨江集团	53,700	222,855.00	0.53
18	000932	华菱钢铁	46,340	221,041.80	0.53
19	600348	阳泉煤业	37,600	218,456.00	0.52
20	600521	华海药业	15,400	217,140.00	0.52
21	600885	宏发股份	8,900	216,270.00	0.52
22	000926	福星股份	31,100	215,212.00	0.52
23	000513	丽珠集团	6,400	212,672.00	0.51
24	600426	华鲁恒升	14,300	212,498.00	0.51
25	600282	南钢股份	60,400	211,400.00	0.51
26	300168	万达信息	16,200	210,114.00	0.50

27	000090	天健集团	42,510	209,999.40	0.50
28	600563	法拉电子	5,100	209,967.00	0.50
29	600782	新钢股份	41,600	208,000.00	0.50
30	603659	璞泰来	4,400	206,888.00	0.50
31	600580	卧龙电驱	24,500	206,045.00	0.49
32	002463	沪电股份	14,700	200,214.00	0.48
33	000012	南玻 A	48,070	199,971.20	0.48
34	300010	立思辰	21,200	199,068.00	0.48
35	600039	四川路桥	54,500	198,380.00	0.48
36	300376	易事特	40,000	197,200.00	0.47
37	000089	深圳机场	22,100	196,469.00	0.47
38	603806	福斯特	5,300	194,669.00	0.47
39	600008	首创股份	55,200	194,304.00	0.47
40	300166	东方国信	15,800	194,182.00	0.47
41	600673	东阳光	24,700	193,895.00	0.47
42	600643	爱建集团	20,100	192,558.00	0.46
43	000559	万向钱潮	31,900	190,762.00	0.46
44	600820	隧道股份	30,000	189,300.00	0.45
45	600757	长江传媒	27,600	187,956.00	0.45
46	600881	亚泰集团	57,500	186,875.00	0.45
47	002583	海能达	22,100	185,419.00	0.44
48	002157	正邦科技	11,100	184,926.00	0.44
49	000690	宝新能源	28,400	182,896.00	0.44
50	603328	依顿电子	17,800	182,806.00	0.44
51	600315	上海家化	5,800	180,670.00	0.43
52	600657	信达地产	43,700	180,044.00	0.43
53	600557	康缘药业	12,100	179,806.00	0.43
54	601928	凤凰传媒	22,100	178,347.00	0.43
55	600717	天津港	27,600	177,192.00	0.43
56	600098	广州发展	28,700	176,792.00	0.42
57	603883	老百姓	3,000	175,440.00	0.42
58	601801	皖新传媒	29,100	174,891.00	0.42
59	603077	和邦生物	91,000	172,900.00	0.41
60	002353	杰瑞股份	7,400	170,940.00	0.41
61	600699	均胜电子	8,000	170,880.00	0.41
62	000975	银泰资源	12,820	169,095.80	0.41
63	002195	二三四五	43,316	168,499.24	0.40
64	000860	顺鑫农业	3,610	168,406.50	0.40
65	600267	海正药业	16,800	168,000.00	0.40

66	603444	吉比特	800	167,968.00	0.40
67	000887	中鼎股份	17,500	167,825.00	0.40
68	000623	吉林敖东	10,200	167,178.00	0.40
69	600376	首开股份	18,700	166,991.00	0.40
70	002385	大北农	31,500	166,635.00	0.40
71	600879	航天电子	27,000	166,320.00	0.40
72	601098	中南传媒	13,100	165,584.00	0.40
73	002507	涪陵榨菜	5,400	164,700.00	0.40
74	600258	首旅酒店	9,000	161,820.00	0.39
75	300315	掌趣科技	46,800	161,460.00	0.39
76	000686	东北证券	18,100	159,461.00	0.38
77	600017	日照港	50,500	159,075.00	0.38
78	603515	欧普照明	4,900	158,025.00	0.38
79	601019	山东出版	20,200	157,156.00	0.38
80	600143	金发科技	31,900	156,310.00	0.37
81	300244	迪安诊断	9,200	156,216.00	0.37
82	600298	安琪酵母	4,900	154,987.00	0.37
83	600729	重庆百货	5,100	154,224.00	0.37
84	300199	翰宇药业	16,600	152,222.00	0.37
85	000581	威孚高科	8,200	152,192.00	0.37
86	002250	联化科技	13,700	151,933.00	0.36
87	603866	桃李面包	3,600	149,940.00	0.36
88	601128	常熟银行	19,400	149,768.00	0.36
89	002004	华邦健康	30,600	148,716.00	0.36
90	600201	生物股份	9,450	148,270.50	0.36
91	603369	今世缘	5,300	147,817.00	0.35
92	601168	西部矿业	23,000	146,740.00	0.35
93	002489	浙江永强	43,700	145,958.00	0.35
94	002049	紫光国微	3,300	145,563.00	0.35
95	002439	启明星辰	5,400	145,260.00	0.35
96	601100	恒立液压	4,600	144,348.00	0.35
97	002299	圣农发展	5,700	144,324.00	0.35
98	600959	江苏有线	32,300	143,735.00	0.34
99	000158	常山北明	26,400	143,088.00	0.34
100	603885	吉祥航空	10,900	142,790.00	0.34
101	000547	航天发展	14,900	142,444.00	0.34
102	600869	智慧能源	31,500	142,380.00	0.34
103	601118	海南橡胶	27,500	141,625.00	0.34
104	002818	富森美	11,000	141,130.00	0.34

105	002384	东山精密	9,600	139,872.00	0.34
106	002155	湖南黄金	13,800	138,966.00	0.33
107	600567	山鹰纸业	41,200	138,844.00	0.33
108	000066	中国长城	13,500	138,780.00	0.33
109	002280	联络互动	37,900	138,714.00	0.33
110	600755	厦门国贸	16,000	138,080.00	0.33
111	002242	九阳股份	6,600	137,346.00	0.33
112	000401	冀东水泥	7,700	135,597.00	0.33
113	002437	誉衡药业	34,200	135,090.00	0.32
114	300058	蓝色光标	31,600	134,932.00	0.32
115	600350	山东高速	28,000	134,400.00	0.32
116	600528	中铁工业	11,600	134,212.00	0.32
117	002223	鱼跃医疗	5,400	132,948.00	0.32
118	002371	北方华创	1,900	131,575.00	0.32
119	600325	华发股份	16,700	130,427.00	0.31
120	600765	中航重机	14,100	130,143.00	0.31
121	000807	云铝股份	27,600	129,444.00	0.31
122	002129	中环股份	13,200	128,832.00	0.31
123	300088	长信科技	25,300	128,018.00	0.31
124	002699	美盛文化	21,300	127,800.00	0.31
125	600021	上海电力	14,700	127,596.00	0.31
126	002607	中公教育	9,200	126,316.00	0.30
127	601699	潞安环能	15,900	126,246.00	0.30
128	000563	陕国投 A	28,400	126,096.00	0.30
129	000930	中粮生化	16,700	125,584.00	0.30
130	600901	江苏租赁	20,600	125,454.00	0.30
131	002690	美亚光电	3,800	123,880.00	0.30
132	000636	风华高科	10,100	122,210.00	0.29
133	603198	迎驾贡酒	6,800	121,788.00	0.29
134	002128	露天煤业	14,000	121,100.00	0.29
135	600260	凯乐科技	6,000	119,880.00	0.29
136	601200	上海环境	8,800	119,768.00	0.29
137	600895	张江高科	5,800	119,016.00	0.29
138	000750	国海证券	23,600	118,708.00	0.28
139	002064	华峰氨纶	23,500	117,970.00	0.28
140	002266	浙富控股	24,800	117,800.00	0.28
141	000960	锡业股份	10,500	117,285.00	0.28
142	002092	中泰化学	14,700	117,012.00	0.28
143	002375	亚厦股份	19,700	116,427.00	0.28

144	600582	天地科技	33,400	115,230.00	0.28
145	600183	生益科技	7,600	114,380.00	0.27
146	002078	太阳纸业	16,700	113,727.00	0.27
147	600967	内蒙一机	10,100	113,120.00	0.27
148	000009	中国宝安	19,600	111,916.00	0.27
149	002444	巨星科技	11,200	111,776.00	0.27
150	600079	人福医药	10,500	110,250.00	0.26
151	600737	中粮糖业	12,700	110,236.00	0.26
152	600572	康恩贝	16,900	108,160.00	0.26
153	600120	浙江东方	8,170	104,085.80	0.25
154	600160	巨化股份	14,600	103,806.00	0.25
155	600169	太原重工	38,700	103,329.00	0.25
156	300207	欣旺达	8,900	102,528.00	0.25
157	000028	国药一致	2,400	100,392.00	0.24
158	000997	新大陆	5,900	99,651.00	0.24
159	600125	铁龙物流	15,400	99,330.00	0.24
160	002212	南洋股份	7,200	98,640.00	0.24
161	002500	山西证券	12,000	97,200.00	0.23
162	002038	双鹭药业	4,100	96,596.00	0.23
163	002399	海普瑞	4,600	96,554.00	0.23
164	002317	众生药业	10,900	92,759.00	0.22
165	601718	际华集团	23,700	92,667.00	0.22
166	600536	中国软件	1,700	91,239.00	0.22
167	000027	深圳能源	14,700	91,140.00	0.22
168	000008	神州高铁	24,100	90,857.00	0.22
169	601966	玲珑轮胎	5,300	90,100.00	0.22
170	600642	申能股份	14,900	89,549.00	0.21
171	600839	四川长虹	30,200	89,090.00	0.21
172	601872	招商轮船	20,400	88,944.00	0.21
173	600633	浙数文化	9,400	87,890.00	0.21
174	000543	皖能电力	18,600	87,606.00	0.21
175	002701	奥瑞金	18,700	87,329.00	0.21
176	600739	辽宁成大	6,000	87,240.00	0.21
177	002332	仙琚制药	12,900	87,204.00	0.21
178	600745	闻泰科技	2,600	86,372.00	0.21
179	601311	骆驼股份	7,900	85,715.00	0.21
180	300027	华谊兄弟	17,100	83,961.00	0.20
181	600392	盛和资源	7,580	83,834.80	0.20
182	002048	宁波华翔	7,700	83,314.00	0.20

183	600500	中化国际	11,100	82,917.00	0.20
184	000998	隆平高科	5,700	82,536.00	0.20
185	002670	国盛金控	6,500	81,900.00	0.20
186	600649	城投控股	12,600	81,522.00	0.20
187	600770	综艺股份	12,200	81,496.00	0.20
188	300316	晶盛机电	6,400	81,216.00	0.19
189	000723	美锦能源	7,700	80,465.00	0.19
190	601866	中远海发	29,500	80,240.00	0.19
191	601608	中信重工	18,400	79,488.00	0.19
192	002019	亿帆医药	6,400	78,400.00	0.19
193	002251	步步高	9,800	78,106.00	0.19
194	002372	伟星新材	4,460	77,604.00	0.19
195	002281	光迅科技	2,900	76,792.00	0.18
196	600166	福田汽车	32,400	76,788.00	0.18
197	603568	伟明环保	3,545	76,288.40	0.18
198	000813	德展健康	10,000	76,200.00	0.18
199	600859	王府井	5,000	75,950.00	0.18
200	002233	塔牌集团	6,500	75,920.00	0.18
201	002408	齐翔腾达	9,700	75,175.00	0.18
202	002183	怡亚通	15,700	74,889.00	0.18
203	300133	华策影视	11,100	74,703.00	0.18
204	600428	中远海特	20,000	74,000.00	0.18
205	000738	航发控制	5,500	73,700.00	0.18
206	601958	金钼股份	10,800	72,360.00	0.17
207	000078	海王生物	20,200	70,296.00	0.17
208	600161	天坛生物	2,760	69,690.00	0.17
209	000031	大悦城	10,600	68,052.00	0.16
210	002302	西部建设	6,100	67,954.00	0.16
211	600409	三友化工	11,900	67,354.00	0.16
212	000060	中金岭南	14,000	65,660.00	0.16
213	600597	光明乳业	6,100	65,575.00	0.16
214	600062	华润双鹤	5,200	65,572.00	0.16
215	002465	海格通信	6,700	63,918.00	0.15
216	000988	华工科技	3,900	61,698.00	0.15
217	002491	通鼎互联	7,600	61,484.00	0.15
218	600664	哈药股份	14,800	61,272.00	0.15
219	000830	鲁西化工	5,600	60,928.00	0.15
220	603000	人民网	3,400	60,622.00	0.15
221	600291	西水股份	5,900	59,354.00	0.14

222	000039	中集集团	5,520	58,953.60	0.14
223	600466	蓝光发展	9,100	56,602.00	0.14
224	002191	劲嘉股份	4,500	55,845.00	0.13
225	002358	森源电气	5,500	55,825.00	0.13
226	000718	苏宁环球	16,100	55,706.00	0.13
227	600410	华胜天成	5,100	54,723.00	0.13
228	601717	郑煤机	9,428	53,833.88	0.13
229	600763	通策医疗	600	53,154.00	0.13
230	000006	深振业 A	9,700	52,865.00	0.13
231	002390	信邦制药	10,000	52,700.00	0.13
232	002797	第一创业	8,300	52,622.00	0.13
233	002573	清新环境	6,500	52,325.00	0.13
234	002419	天虹股份	3,900	50,934.00	0.12
235	002254	泰和新材	4,800	50,784.00	0.12
236	600584	长电科技	3,900	50,115.00	0.12
237	002544	杰赛科技	3,700	48,100.00	0.12
238	600848	上海临港	1,500	46,695.00	0.11
239	603766	隆鑫通用	11,000	46,090.00	0.11
240	300308	中际旭创	1,320	44,866.80	0.11
241	000987	越秀金控	4,800	43,296.00	0.10
242	600623	华谊集团	5,500	42,020.00	0.10
243	000869	张裕 A	1,300	41,756.00	0.10
244	600875	东方电气	3,900	41,418.00	0.10
245	002709	天赐材料	1,700	41,140.00	0.10
246	600329	中新药业	2,800	40,012.00	0.10
247	600804	鹏博士	5,200	39,104.00	0.09
248	300257	开山股份	3,300	36,564.00	0.09
249	002440	闰土股份	2,900	36,134.00	0.09
250	600053	九鼎投资	1,400	32,620.00	0.08
251	603355	莱克电气	1,500	32,280.00	0.08
252	600026	中远海能	3,200	20,768.00	0.05
253	300274	阳光电源	1,800	16,830.00	0.04

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净
----	------	------	-------	------	--------

					值比例 (%)
1	300347	泰格医药	3,000	231,300.00	0.55
2	002410	广联达	6,400	210,496.00	0.50
3	603899	晨光文具	4,600	202,262.00	0.49
4	000333	美的集团	3,685	191,104.10	0.46
5	600256	广汇能源	47,800	170,168.00	0.41
6	300202	聚龙股份	19,500	151,905.00	0.36
7	002013	中航机电	20,850	143,448.00	0.34
8	603416	信捷电气	5,800	142,332.00	0.34
9	603160	汇顶科技	1,000	138,800.00	0.33
10	600332	白云山	2,900	118,813.00	0.28
11	600188	兖州煤业	10,800	117,396.00	0.28
12	300203	聚光科技	4,900	117,110.00	0.28
13	603658	安图生物	1,700	116,212.00	0.28
14	000967	盈峰环境	15,700	116,180.00	0.28
15	300395	菲利华	6,500	114,985.00	0.28
16	600028	中国石化	20,900	114,323.00	0.27
17	300298	三诺生物	9,700	114,266.00	0.27
18	300271	华宇软件	6,000	114,000.00	0.27
19	000825	太钢不锈	28,000	113,960.00	0.27
20	002624	完美世界	4,400	113,564.00	0.27
21	603728	鸣志电器	9,100	111,657.00	0.27
22	002126	银轮股份	14,900	110,856.00	0.27
23	600048	保利地产	8,600	109,736.00	0.26
24	603826	坤彩科技	7,200	105,768.00	0.25
25	000402	金融街	13,400	105,056.00	0.25
26	300750	宁德时代	1,500	103,320.00	0.25
27	600743	华远地产	38,400	96,384.00	0.23
28	300075	数字政通	8,600	96,320.00	0.23
29	002311	海大集团	3,100	95,790.00	0.23
30	300609	汇纳科技	2,600	91,156.00	0.22
31	600025	华能水电	20,900	85,063.00	0.20
32	002705	新宝股份	7,100	81,650.00	0.20
33	002851	麦格米特	4,100	81,057.00	0.19
34	000783	长江证券	10,200	79,662.00	0.19
35	300567	精测电子	1,500	78,780.00	0.19
36	300662	科锐国际	2,200	77,924.00	0.19
37	002142	宁波银行	3,200	77,568.00	0.19

38	300196	长海股份	7,800	71,136.00	0.17
39	603730	岱美股份	3,000	70,320.00	0.17
40	002867	周大生	2,000	68,380.00	0.16
41	603737	三棵树	1,540	67,051.60	0.16
42	600055	万东医疗	6,400	66,432.00	0.16
43	000630	铜陵有色	26,400	64,944.00	0.16
44	002025	航天电器	2,300	56,074.00	0.13
45	300144	宋城演艺	2,400	55,536.00	0.13
46	600655	豫园股份	6,400	52,416.00	0.13
47	600999	招商证券	3,000	51,270.00	0.12
48	000034	神州数码	3,700	47,730.00	0.11
49	600038	中直股份	1,100	45,122.00	0.11
50	600873	梅花生物	9,400	45,026.00	0.11
51	300114	中航电测	4,800	44,688.00	0.11
52	600489	中金黄金	4,300	44,161.00	0.11
53	600535	天士力	2,600	43,030.00	0.10
54	600009	上海机场	500	41,890.00	0.10
55	000902	新洋丰	3,900	41,847.00	0.10
56	002643	万润股份	4,100	41,410.00	0.10
57	601021	春秋航空	900	40,500.00	0.10
58	300470	日机密封	1,600	39,744.00	0.10
59	601628	中国人寿	1,400	39,648.00	0.10
60	600000	浦发银行	3,300	38,544.00	0.09
61	601398	工商银行	6,500	38,285.00	0.09
62	601390	中国中铁	5,800	37,816.00	0.09
63	600760	中航沈飞	1,300	37,739.00	0.09
64	002563	森马服饰	3,400	37,604.00	0.09
65	600377	宁沪高速	3,500	37,590.00	0.09
66	600438	通威股份	2,600	36,556.00	0.09
67	002313	日海智能	1,800	36,360.00	0.09
68	600498	烽火通信	1,300	36,218.00	0.09
69	600031	三一重工	2,600	34,008.00	0.08
70	601236	红塔证券	9,789	33,869.94	0.08
71	600050	中国联通	5,300	32,648.00	0.08
72	300782	卓胜微	272	29,626.24	0.07
73	601166	兴业银行	1,500	27,435.00	0.07
74	600968	海油发展	7,245	25,719.75	0.06
75	600629	华建集团	2,640	25,476.00	0.06
76	601668	中国建筑	3,800	21,850.00	0.05

77	600030	中信证券	900	21,429.00	0.05
78	603867	新化股份	801	20,673.81	0.05
79	603587	地素时尚	900	20,466.00	0.05
80	603217	元利科技	292	19,634.08	0.05
81	300780	德恩精工	658	19,476.80	0.05
82	601698	中国卫通	4,715	18,482.80	0.04
83	002838	道恩股份	1,600	17,920.00	0.04
84	300594	朗进科技	360	15,879.60	0.04
85	601233	桐昆股份	60	930.60	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	600507	方大特钢	744,590.00	2.31
2	002273	水晶光电	660,849.00	2.05
3	002690	美亚光电	604,980.63	1.88
4	002340	格林美	579,447.00	1.80
5	600673	东阳光	578,742.00	1.80
6	600823	世茂股份	572,736.00	1.78
7	002463	沪电股份	566,092.00	1.76
8	000778	新兴铸管	546,454.10	1.70
9	000807	云铝股份	544,773.00	1.69
10	300010	立思辰	535,859.00	1.67
11	600885	宏发股份	531,901.00	1.65
12	600511	国药股份	522,278.00	1.62
13	000559	万向钱潮	522,244.00	1.62
14	002127	南极电商	514,709.50	1.60
15	600875	东方电气	502,548.00	1.56
16	601019	山东出版	502,493.94	1.56
17	002174	游族网络	499,048.00	1.55
18	000078	海王生物	496,280.00	1.54
19	000581	威孚高科	492,253.00	1.53
20	002128	露天煤业	491,538.00	1.53

注：买入金额不包括相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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	600507	方大特钢	774,861.00	2.41
2	002690	美亚光电	670,704.00	2.08
3	002174	游族网络	662,873.00	2.06
4	300274	阳光电源	657,459.26	2.04
5	600875	东方电气	623,490.00	1.94
6	000656	金科股份	613,777.00	1.91
7	000988	华工科技	570,598.00	1.77
8	002463	沪电股份	566,904.00	1.76
9	600325	华发股份	563,089.00	1.75
10	600755	厦门国贸	557,478.00	1.73
11	002414	高德红外	554,855.22	1.72
12	600748	上实发展	554,689.00	1.72
13	002465	海格通信	545,733.00	1.70
14	000997	新大陆	513,314.00	1.60
15	601106	中国一重	504,535.00	1.57
16	600511	国药股份	496,404.00	1.54
17	000975	银泰资源	494,603.00	1.54
18	600737	中粮糖业	490,789.00	1.53
19	300413	芒果超媒	489,042.00	1.52
20	600528	中铁工业	481,170.00	1.50

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	150,693,819.28
卖出股票收入（成交）总额	144,776,086.59

注：买入股票成本、卖出股票收入均不包括相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金未投资股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

本基金投资于股指期货，对基金总体风险的影响很小，并符合既定的投资政策和投资目标。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金未投资国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金未投资国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

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

7.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	23,030.86
2	应收证券清算款	158,842.47
3	应收股利	-
4	应收利息	700.15
5	应收申购款	41,034.82
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	223,608.30

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五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
中证 500 增强 A	1,032	30,779.21	10,000,450.05	31.48%	21,763,695.43	68.52%
中证 500 增强 C	1,068	15,341.82	0.00	0.00%	16,385,066.04	100.00%
合计	2,100	22,928.20	10,000,450.05	20.77%	38,148,761.47	79.23%

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	中证 500 增强 A	1,975,822.60	6.2203%
	中证 500 增强 C	368,694.27	2.2502%
	合计	2,344,516.87	4.8693%

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的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和部门负责人持有本开放式基金	中证 500 增强 A	0
	中证 500 增强 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	中证 500 增强 A	0~10
	中证 500 增强 C	0~10
	合计	10~50

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例 (%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例 (%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,450.05	20.77	10,000,450.05	20.77	不少于 3 年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,000,450.05	20.77	10,000,450.05	20.77	-

注：1、本基金募集期间，本基金管理人运用固有资金作为发起资金总计 10,001,000.00 元认购了本基金。发起资金认购的基金份额自基金合同生效之日起持有期不少于 3 年；

2、本基金管理人运用固有资金于 2018 年 4 月 16 日通过本公司直销柜台认购本基金作为发起资金的认购费用为 1,000 元。符合基金合同和招募说明书等法律文件的约定。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中证 500 增强 A	中证 500 增强 C
基金合同生效日（2018 年 4 月 19 日）基金份额总额	21,918,920.54	33,238,419.67
本报告期期初基金份额总额	29,247,088.16	13,096,493.72
本报告期期间基金总申购份额	10,977,928.87	17,402,136.69
减：本报告期期间基金总赎回份额	8,460,871.55	14,113,564.37
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	31,764,145.48	16,385,066.04

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人、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，基金管理人、托管人及其高级管理人员未有受到稽查或处罚的情况

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比	佣金	占当期佣金总量的比例	

		例			
中信证券	2	294,949,179.80	100.00%	271,572.64	100.00%

注：基金管理人选择交易单元的标准和程序如下：

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

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

2. 本基金本报告期券商交易单元无新增。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

本基金本报告期内未租用证券公司交易单元进行其它证券投资。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华宝基金管理有限公司旗下基金资产净值公告	基金管理人网站	2019 年 1 月 1 日
2	华宝基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加玄元保险代理有限公司为代销机构的公告	上海证券报、证券时报、中国证券报、基金管理人网站	2019 年 1 月 9 日
3	华宝基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加宜信普泽（北京）基金销售有限公司为代销机构的公告	上海证券报、证券时报、中国证券报、基金管理人网站	2019 年 1 月 18 日
4	华宝基金管理有限公司关于参加宜信普泽（北京）基金销售有限公司费率优惠活动的公告	上海证券报、证券时报、中国证券报、基金管理人网站	2019 年 1 月 18 日
5	华宝中证 500 指数增强型发起式证券投资基金 2018 年第	中国证券报、基金管理人网站	2019 年 1 月 21 日

	4 季度报告		
6	华宝基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加上海基煜基金销售有限公司为代销机构的公告	上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报、基金管理人网站	2019 年 3 月 18 日
7	华宝基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加北京汇成基金销售有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报、基金管理人网站	2019 年 3 月 21 日
8	华宝中证 500 指数增强型发起式证券投资基金 2018 年度报告	基金管理人网站	2019 年 3 月 30 日
9	华宝中证 500 指数增强型发起式证券投资基金 2018 年度报告（摘要）	中国证券报、基金管理人网站	2019 年 3 月 30 日
10	华宝基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加上海挖财基金销售有限公司为代销机构的公告	上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报、基金管理人网站	2019 年 4 月 3 日
11	关于华宝现金宝货币基金 E 类份额转换、赎回转申购业务费率优惠公告	上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报、基金管理人网站	2019 年 4 月 15 日
12	华宝中证 500 指数增强型发起式证券投资基金 2019 年第 1 季度报告	中国证券报、基金管理人网站	2019 年 4 月 19 日
13	华宝中证 500 指数增强型发起式证券投资基金招募说明书（更新）	基金管理人网站	2019 年 5 月 29 日
14	华宝中证 500 指数增强型发起式证券投资基金招募说明书（更新）摘要	中国证券报、基金管理人网站	2019 年 5 月 29 日
15	华宝基金关于华宝中证 500 指数增强型发起式证券投资基金新增中国建设银行为代销机构的公告	中国证券报、基金管理人网站	2019 年 6 月 6 日
16	华宝基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加通华财富（上海）基金销售有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报、基金管理人网站	2019 年 6 月 12 日
17	关于华宝现金宝 E 货币基金定期转换、定期赎回转申购业	上海证券报、证券日报、证券时报、中国	2019 年 6 月 18 日

	务费率优惠公告	证券报、基金管理人网站	
18	华宝基金管理有限公司关于旗下部分基金可投资科创板股票的公告	上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报、基金管理人网站	2019 年 6 月 22 日
19	华宝基金管理有限公司旗下基金资产净值公告	基金管理人网站	2019 年 6 月 30 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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	20190101~20190630	10,000,450.05	0.00	0.00	10,000,450.05	20.77%
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

基金管理人于 2019 年 6 月 22 日发布《华宝基金管理有限公司关于旗下部分基金可投资科创板股票的公告》，具体内容详见公司公告，请投资者予以关注。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

中国证监会批准基金设立的文件；
华宝中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金合同；
华宝中证 500 指数增强型发起式证券投资基金招募说明书；
华宝中证 500 指数增强型发起式证券投资基金托管协议；
基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
基金管理人报告期内在指定报刊上披露的各种公告；
基金托管人业务资格批件和营业执照。

12.2 存放地点

以上文件存于基金管理人及基金托管人住所备投资者查阅。

12.3 查阅方式

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

华宝基金管理有限公司

2019 年 8 月 29 日