

华宝量化选股混合型发起式证券投资基金 2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：华宝基金管理有限公司

基金托管人：中信证券股份有限公司

送出日期：2024 年 8 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中信证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 08 月 28 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 2024 年 01 月 01 日起至 2024 年 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
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	10
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	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
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	11
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	16
§ 7 投资组合报告	38
7.1 期末基金资产组合情况	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	38
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	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	51
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	52
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	52

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	52
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	52
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	52
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	52
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	53
7.12 投资组合报告附注	53
§ 8 基金份额持有人信息	54
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	54
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	54
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	54
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	54
§ 9 开放式基金份额变动	55
§ 10 重大事件揭示	55
10.1 基金份额持有人大会决议	55
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	56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	56
10.4 基金投资策略的改变	56
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	56
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	56
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	56
10.8 其他重大事件	57
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	57
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	57
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	57
§ 12 备查文件目录	58
12.1 备查文件目录	58
12.2 存放地点	58
12.3 查阅方式	58

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华宝量化选股混合型发起式证券投资基金	
基金简称	华宝量化选股混合发起式	
基金主代码	017715	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2023 年 2 月 20 日	
基金管理人	华宝基金管理有限公司	
基金托管人	中信证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	51,126,408.25 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华宝量化选股混合发起式 A	华宝量化选股混合发起式 C
下属分级基金的交易代码	017715	017716
报告期末下属分级基金的份额总额	18,961,211.82 份	32,165,196.43 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制投资组合风险的前提下，通过量化投资精选股票，力争获得超越业绩比较基准的收益。
投资策略	主要考虑估值、成长、盈利质量、市场预期等基本因子以及业绩超预期等事件驱动因子，通过实证分析和动态跟踪得到有效因子，再根据有效因子的综合评分结果，在全市场中选择股票构建股票投资组合。所选股票具备较高的市场认可度、成长水平、盈利质量等，具备对全 A 优质股的综合表征能力。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率×80%+中证综合债指数收益率×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理论上低于股票型基金，高于债券型基金、货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	华宝基金管理有限公司	中信证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	周雷
	联系电话	021-38505888
	电子邮箱	xxpl@fsfund.com
客户服务电话	400-700-5588、400-820-5050	95548-3
传真	021-38505777	010-60834004
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼	广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座
办公地址	中国（上海）自由贸易试验区世	北京市朝阳区亮马桥路 48 号中

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

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.fsfund.com
基金中期报告备置地点	基金管理人办公场所和基金托管人办公场所。

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日)	
	华宝量化选股混合发起式 A	华宝量化选股混合发起式 C
本期已实现收益	227, 509. 72	233, 159. 44
本期利润	-463, 173. 71	-1, 642, 041. 51
加权平均基金份额本期利润	-0. 0229	-0. 0478
本期加权平均净值利润率	-2. 43%	-5. 10%
本期基金份额净值增长率	-3. 13%	-3. 32%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	-1, 410, 179. 28	-2, 554, 127. 33
期末可供分配基金份额利润	-0. 0744	-0. 0794
期末基金资产净值	17, 551, 032. 54	29, 611, 069. 10
期末基金份额净值	0. 9256	0. 9206
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	-7. 44%	-7. 94%

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

华宝量化选股混合发起式 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-6.02%	1.21%	-5.37%	0.77%	-0.65%	0.44%
过去三个月	-3.46%	1.20%	-4.84%	0.91%	1.38%	0.29%
过去六个月	-3.13%	1.69%	-6.30%	1.28%	3.17%	0.41%
过去一年	-9.13%	1.32%	-13.07%	1.02%	3.94%	0.30%
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	-7.44%	1.18%	-15.31%	0.93%	7.87%	0.25%

华宝量化选股混合发起式 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-6.05%	1.21%	-5.37%	0.77%	-0.68%	0.44%
过去三个月	-3.56%	1.20%	-4.84%	0.91%	1.28%	0.29%
过去六个月	-3.32%	1.69%	-6.30%	1.28%	2.98%	0.41%
过去一年	-9.49%	1.32%	-13.07%	1.02%	3.58%	0.30%
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	-7.94%	1.18%	-15.31%	0.93%	7.37%	0.25%

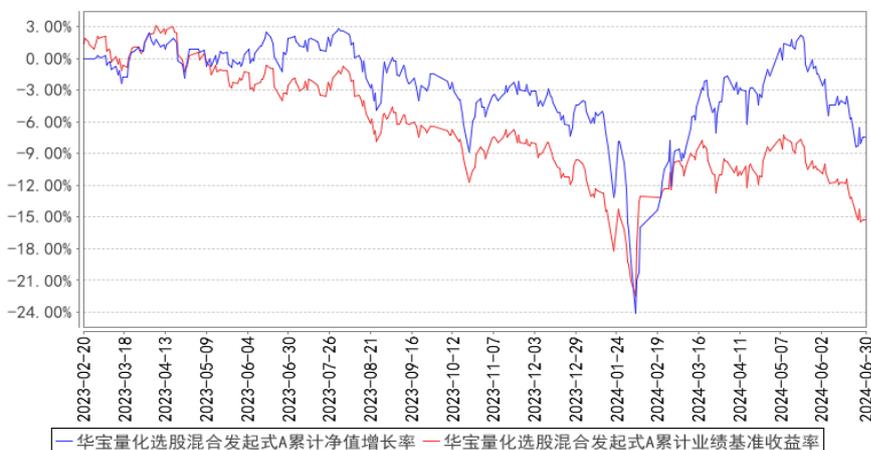
注：（1）基金业绩基准：中证 500 指数收益率×80%+中证综合债指数收益率×20%；

（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

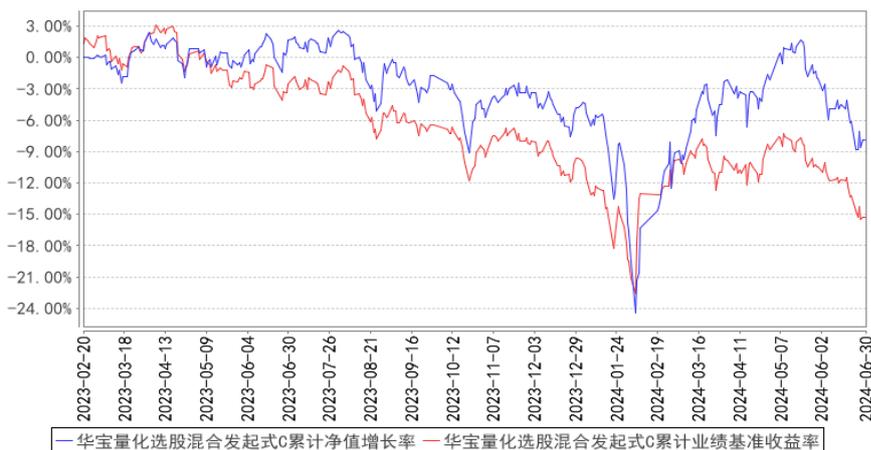
非交易日)。

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

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



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



注：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 2023 年 08 月 20 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。截至本报告期末（2024 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 141 只，涵盖股票型基金、混合型基金、债券型基金、货币市场基金、FOF 等。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
喻银尤	本基金基金经理	2023-02-20	-	8 年	硕士。曾在中信建投证券股份有限公司从事量化研究工作，2018 年 9 月加入华宝基金管理有限公司，历任量化分析师、投资经理等职务。2022 年 7 月起任华宝中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金经理，2023 年 2 月起任华宝量化选股混合型发起式证券投资基金基金经理。
徐林明	本基金基金经理、量化投资总监、量化投资部总经理	2023-02-20	-	22 年	硕士。曾在兴业证券、凯龙财经（上海）有限公司、中原证券从事金融工程研究工作。2005 年 8 月加入华宝基金管理有限公司，先后担任金融工程部数量分析师、金融工程部副总经理等职务，现任量化投资总监、量化投资部总经理。2009 年 9 月至 2015 年 11 月任华宝中证 100 指数证券投资基金基金经理，2010 年 4 月至 2015 年 11 月任上证 180 价值交易型开放式指数证券投资基金、华宝上证 180 价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，2014 年 9 月起任华宝量化对冲策略混合型发起式证券投资基金基金经理，2015 年 4 月至 2020 年 2 月任华宝事件驱动混合型证券投资基金基金经理，2016 年 12 月起任华宝沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金基金经理，2019 年 2 月至 2022 年 10 月任华宝科技先锋混合型证券投资基金基金经理，2021 年 12 月至 2023 年 11 月任华宝中证稀有金属主题指数增强型发起式证券投资基金基金经理，2022 年 8 月至 2023 年 11 月任华宝高端装备股票型发起式证券投资基金基金经理，2023 年 2 月起任华宝量化选股混合型发起式证券投资基金基金经理。

注：1、任职日期以及离任日期均以基金公告为准。

2、证券从业含义遵从《证券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合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本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

2024 年上半年，A 股总体震荡探底，不同风格表现较为分化。总体来看，市值方面，大市值占优，中小市值较弱；风格方面，红利占优，成长较弱。如今大盘股在经历了连续 3 年下跌之后估值处于底部，疫情 3 年的影响基本逐渐褪去，基本面也处于底部位置。另一方面小微盘在经历了 2 月份和 4 月份及最近 6 月初三次小微盘的回调之后，大的风险基本已经释放。站在当下，对未来资本市场充满期待。

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金份额 A 类净值增长率为-3.13%，本报告期基金份额 C 类净值增长率为-3.32%；同期业绩比较基准收益率为-6.30%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2024 年 A 股市场上行拐点或已出现，当前市场或处于政策底、盈利底、估值底三重相对底部区域。首先政策逐步加码，更多呵护资本市场的硬招、实招陆续推出，政策效果有望逐步显现。估值角度看，A 股市场持续震荡回调，股权风险溢价率处在历史相对高位区间，市场估值处于相对较低水平，安全边际较充足。最后，从上市公司业绩来看，2024 年一季报基本确认 A 股上市公司净利润同比处于周期底部，业绩底或基本确立。

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其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

本基金本报告期末未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

本报告期，华宝基金管理有限公司在对华宝量化选股混合发起式证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华宝量化选股混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	1,578,871.03	1,340,615.45
结算备付金		1,826,117.27	4,614,354.53
存出保证金		116,592.00	252,633.60
交易性金融资产	6.4.7.2	43,751,427.48	66,043,095.07
其中：股票投资		43,751,427.48	66,043,095.07
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		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		19,362.20	17,835.88
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		47,292,369.98	72,268,534.53
负债和净资产	附注号	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023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		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		9,119.49	59,197.80
应付管理人报酬		46,451.11	74,054.00
应付托管费		7,741.85	12,342.34
应付销售服务费		9,659.95	17,748.50
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	6.4.7.6	57,295.94	135,222.91
负债合计		130,268.34	298,565.55
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	51,126,408.25	75,511,612.72
未分配利润	6.4.7.8	-3,964,306.61	-3,541,643.74
净资产合计		47,162,101.64	71,969,968.98
负债和净资产总计		47,292,369.98	72,268,534.53

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额总额 51,126,408.25 份，其中华宝量化选股混合发起式 A 基金份额总额 18,961,211.82 份，基金份额净值 0.9256 元；华宝量化选股混合发起式 C 基金份额总额 32,165,196.43 份，基金份额净值 0.9206 元。

6.2 利润表

会计主体：华宝量化选股混合型发起式证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 2 月 20 日（基金 合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-1,628,949.99	2,250,938.83
1. 利息收入		18,894.86	80,301.07
其中：存款利息收入	6.4.7.9	18,894.86	22,339.97
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息 收入		-	-
买入返售金融资产 收入		-	57,961.10
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-” 填列）		905,846.25	1,491,986.09
其中：股票投资收益	6.4.7.10	683,462.81	877,176.01
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-	2,425.52
资产支持证券投资 收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-247,244.52	-
股利收益	6.4.7.15	469,627.96	612,384.56
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	6.4.7.16	-2,565,884.38	673,406.55
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）	6.4.7.17	12,193.28	5,245.12
减：二、营业总支出		476,265.23	689,945.87
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	304,543.24	459,336.47
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	50,757.22	76,556.10
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	63,680.27	93,267.54
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产 支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.18	-	-
7. 税金及附加		-	-

8. 其他费用	6.4.7.19	57,284.50	60,785.76
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-2,105,215.22	1,560,992.96
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-2,105,215.22	1,560,992.96
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-2,105,215.22	1,560,992.96

6.3 净资产变动表

会计主体：华宝量化选股混合型发起式证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	75,511,612.72	-	-3,541,643.74	71,969,968.98
二、本期期初净资产	75,511,612.72	-	-3,541,643.74	71,969,968.98
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-24,385,204.47	-	-422,662.87	-24,807,867.34
（一）、综合收益总额	-	-	-2,105,215.22	-2,105,215.22
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-24,385,204.47	-	1,682,552.35	-22,702,652.12
其中：1. 基金申购款	16,054,854.71	-	-475,870.87	15,578,983.84
2. 基金赎回款	-40,440,059.18	-	2,158,423.22	-38,281,635.96
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
四、本期期末净资产	51,126,408.25	-	-3,964,306.61	47,162,101.64
项目	上年度可比期间			

	2023 年 2 月 20 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-	-
二、本期期初净资产	93,965,302.33	-	-	93,965,302.33
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-16,380,124.51	-	1,361,657.99	-15,018,466.52
（一）、综合收益总额	-	-	1,560,992.96	1,560,992.96
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-16,380,124.51	-	-199,334.97	-16,579,459.48
其中：1. 基金申购款	25,283,333.89	-	67,445.52	25,350,779.41
2. 基金赎回款	-41,663,458.40	-	-266,780.49	-41,930,238.89
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
四、本期期末净资产	77,585,177.82	-	1,361,657.99	78,946,835.81

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

向辉

基金管理人负责人

向辉

主管会计工作负责人

张幸骏

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华宝量化选股混合型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2022]3112 号文《关于准予华宝量化选股混合型发起式证券投资基金注册的批复》准予注册，由华宝基金管理有限公司于 2023 年 2 月 15 日至 2023 年 2 月 16 日止期间向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证

并出具安永华明（2022）验字第 61471289_B03 号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2023 年 2 月 20 日生效。本基金为契约型开放式、发起式，存续期限不定。设立时募集扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 93,956,514.37 元，其中 A 类基金份额的净认购金额为人民币 19,740,148.53 元；C 类基金份额的净认购金额为人民币 74,216,365.84 元。在募集期间产生利息为人民币 8,787.96 元，其中 A 类基金份额的有效认购资金在初始销售期内产生的利息为人民币 2,031.92 元；C 类基金份额的有效认购资金在初始销售期内产生的利息为人民币 6,756.04 元。以上收到的实收资金（本息）共计人民币 93,965,302.33 元，折合 93,965,302.33 份基金份额。本基金的基金管理人与注册登记机构为华宝基金管理有限公司，基金托管人为中信证券股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华宝量化选股混合型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（包括创业板、存托凭证及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券（含分离交易可转换债）、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：基金资产的 60%-95%；每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金保留的现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

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

本财务报表已于 2024 年 8 月 30 日经本基金的基金管理人批准。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL

模板第 3 号《年度报告和中期报告》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及 2024 年 1 月 1 日至 2024 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‰；根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收；

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法》、《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 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	1,578,871.03
等于：本金	1,577,967.46
加：应计利息	903.57
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	1,578,871.03

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	46,736,886.36	-	43,751,427.48	-2,985,458.88
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	46,736,886.36	-	43,751,427.48	-2,985,458.88

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	1,010,300.00	-	-	-
其中：股指期货 投资	1,010,300.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	1,010,300.00	-	-	-

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IM2407	IM2407	1.00	971,600.00	-38,700.00
合计				-38,700.00

减：可抵销期货暂收款				-38,700.00
净额				0.00

注：（1）买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

（2）衍生金融资产项下的利率/权益/其他衍生工具为国债/股指/商品期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指/商品/国债期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指/商品/国债期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为 0。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	11.44
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	57,284.50
合计	57,295.94

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

华宝量化选股混合发起式 A

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	21,467,805.54	21,467,805.54
本期申购	3,154,553.29	3,154,553.29

本期赎回（以“-”号填列）	-5,661,147.01	-5,661,147.01
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	18,961,211.82	18,961,211.82

华宝量化选股混合发起式 C

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	54,043,807.18	54,043,807.18
本期申购	12,900,301.42	12,900,301.42
本期赎回（以“-”号填列）	-34,778,912.17	-34,778,912.17
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	32,165,196.43	32,165,196.43

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。

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

华宝量化选股混合发起式 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-613,174.35	-342,593.30	-955,767.65
本期期初	-613,174.35	-342,593.30	-955,767.65
本期利润	227,509.72	-690,683.43	-463,173.71
本期基金份额交易产生的变动数	187,322.04	-178,559.96	8,762.08
其中：基金申购款	-82,477.80	25,956.83	-56,520.97
基金赎回款	269,799.84	-204,516.79	65,283.05
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-198,342.59	-1,211,836.69	-1,410,179.28

华宝量化选股混合发起式 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-1,724,007.67	-861,868.42	-2,585,876.09
本期期初	-1,724,007.67	-861,868.42	-2,585,876.09
本期利润	233,159.44	-1,875,200.95	-1,642,041.51
本期基金份额交易产生的变动数	983,304.91	690,485.36	1,673,790.27
其中：基金申购款	-558,375.67	139,025.77	-419,349.90
基金赎回款	1,541,680.58	551,459.59	2,093,140.17
本期已分配利润	-	-	-

本期末	-507,543.32	-2,046,584.01	-2,554,127.33
-----	-------------	---------------	---------------

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
活期存款利息收入		14,803.18
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		4,091.68
其他		-
合计		18,894.86

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
卖出股票成交总额		187,243,248.20
减：卖出股票成本总额		186,246,016.03
减：交易费用		313,769.36
买卖股票差价收入		683,462.81

6.4.7.10.3 股票投资收益——证券出借差价收入

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

6.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 贵金属投资收益

6.4.7.13.1 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
股指期货投资收益	-247,244.52

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	469,627.96
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	469,627.96

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
1. 交易性金融资产	-2,582,234.37
股票投资	-2,582,234.37
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	16,349.99
权证投资	-
期货投资	16,349.99
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	-2,565,884.38

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
基金赎回费收入	12,027.11
基金转换费收入	166.17
合计	12,193.28

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。

6.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
审计费用	17,502.94
信息披露费	39,781.56
证券出借违约金	-
合计	57,284.50

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无需要披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年2月20日（基金合同生效日） 至2023年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例（%）	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例（%）
中信证券	353,779,831.01	100.00	551,788,661.60	100.00

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年2月20日（基金合同生效日） 至2023年6月30日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比 例（%）	成交金额	占当期债券 成交总额的比 例（%）
中信证券	-	-	2,210,107.04	100.00

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年2月20日（基金合同生效日） 至2023年6月30日	
	成交金额	占当期债券回 购 成交总额的比 例（%）	成交金额	占当期债券回 购 成交总额的比 例（%）
中信证券	-	-	317,803,000.00	100.00

6.4.10.1.4 权证交易

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
中信证券	197,446.70	100.00	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2023年2月20日（基金合同生效日）至2023年6月30日			

	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
中信证券	419,026.37	100.00	-	-

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

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

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6 月30日	上年度可比期间 2023年2月20日（基金合 同生效日）至2023年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	304,543.24	459,336.47
其中：应支付销售机构的客户维护 费	57,514.77	82,565.37
应支付基金管理人的净管理费	247,028.47	376,771.10

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 1.20% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.20\% \div \text{当年天数}$$

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 2024年1月1日至2024年6 月30日	上年度可比期间 2023年2月20日（基金合 同生效日）至2023年6月 30日
当期发生的基金应支付的托管费	50,757.22	76,556.10

注：基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.20% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华宝量化选股混合发起式 A	华宝量化选股混合发起式 C	合计
华宝基金	-	1,163.63	1,163.63
中信证券	-	52,293.22	52,293.22
合计	-	53,456.85	53,456.85
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2023 年 2 月 20 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华宝量化选股混合发起式 A	华宝量化选股混合发起式 C	合计
华宝基金	-	425.02	425.02
中信证券	-	91,842.96	91,842.96
合计	-	92,267.98	92,267.98

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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期内及上年度可比期间无转融通证券出借业务。

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

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

份额单位：份

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	华宝量化选股混合发起式 A	华宝量化选股混合发起式 C
基金合同生效日（2023 年 2 月 20 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	9,901,031.35	100,010.42
报告期内申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期内因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期内赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	9,901,031.35	100,010.42
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	52.22%	0.31%
项目	上年度可比期间 2023 年 2 月 20 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日	
	华宝量化选股混合发起式 A	华宝量化选股混合发起式 C
基金合同生效日（2023 年 2 月 20 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	0.00	0.00
报告期内申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期内因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期内赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	9,901,031.35	100,010.42
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	45.60%	0.18%

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

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末除基金管理人外其他关联方未投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 2 月 20 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中信证券-活期	1,578,871.03	14,803.18	3,116,348.74	17,226.62

注：本基金的上述存款，按银行同业利率或约定利率计息。

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（2024 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期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

本基金是一只混合型的证券投资基金，其长期平均预期风险和预期收益率低于股票型基金，高于债券型基金、货币市场基金。本基金投资的金融工具主要包括股票、债券等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

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

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

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

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

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合同责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款均存放于大型股份制商业银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，违约风险发生的可能性很小；在场外交易市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。于本报告期末，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券和资产支持证券占基金净资产的比例较低（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，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 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（自 2017 年 10 月 1 日起施行）等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%，本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制）。

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

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

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

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

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为货币资金、结算备付金和存出保证金等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	1,578,871.03	-	-	-	1,578,871.03
结算备付金	1,826,117.27	-	-	-	1,826,117.27
存出保证金	-	-	-	116,592.00	116,592.00
交易性金融资产	-	-	-	43,751,427.48	43,751,427.48
应收申购款	-	-	-	19,362.20	19,362.20
资产总计	3,404,988.30	-	-	43,887,381.68	47,292,369.98
负债					
应付赎回款	-	-	-	9,119.49	9,119.49

应付管理人报酬	-	-	-	46,451.11	46,451.11
应付托管费	-	-	-	7,741.85	7,741.85
应付销售服务费	-	-	-	9,659.95	9,659.95
其他负债	-	-	-	57,295.94	57,295.94
负债总计	-	-	-	130,268.34	130,268.34
利率敏感度缺口	3,404,988.30	-	-	43,757,113.34	47,162,101.64
上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	1,340,615.45	-	-	-	1,340,615.45
结算备付金	4,614,354.53	-	-	-	4,614,354.53
存出保证金	-	-	-	252,633.60	252,633.60
交易性金融资产	-	-	-	66,043,095.07	66,043,095.07
应收申购款	-	-	-	17,835.88	17,835.88
资产总计	5,954,969.98	-	-	66,313,564.55	72,268,534.53
负债					
应付赎回款	-	-	-	59,197.80	59,197.80
应付管理人报酬	-	-	-	74,054.00	74,054.00
应付托管费	-	-	-	12,342.34	12,342.34
应付销售服务费	-	-	-	17,748.50	17,748.50
其他负债	-	-	-	135,222.91	135,222.91
负债总计	-	-	-	298,565.55	298,565.55
利率敏感度缺口	5,954,969.98	-	-	66,014,999.00	71,969,968.98

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

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金的股票投资比例为基金资产的 60%-95%；每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金保留的现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 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	43,751,427.48	92.77	66,043,095.07	91.76
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	43,751,427.48	92.77	66,043,095.07	91.76

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

上年度末，该基金成立未满一年，无足够历史经验数据计算其他价格风险对基金资产净值的影响。

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

假设	-
	-
	-

分析	风险价值 (单位: 人民币元)	本期末 (2024 年 6 月 30 日)	上年度末 (2023 年 12 月 31 日)
	合计	-	0.00

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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	43,751,427.48	65,692,547.07
第二层次	-	350,548.00
第三层次	-	-
合计	43,751,427.48	66,043,095.07

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	43,751,427.48	92.51
	其中：股票	43,751,427.48	92.51
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	3,404,988.30	7.20
8	其他各项资产	135,954.20	0.29
9	合计	47,292,369.98	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	149.11	0.00
B	采矿业	1,280,141.00	2.71
C	制造业	28,005,768.13	59.38
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,310,030.00	2.78
E	建筑业	990,526.80	2.10
F	批发和零售业	4,790,851.76	10.16
G	交通运输、仓储和邮政业	1,253,112.60	2.66
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,495,413.68	3.17

J	金融业	2,310,510.00	4.90
K	房地产业	425,065.00	0.90
L	租赁和商务服务业	212,373.00	0.45
M	科学研究和技术服务业	143,795.00	0.30
N	水利、环境和公共设施管理业	476,731.40	1.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	43,131.00	0.09
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	1,013,829.00	2.15
S	综合	-	-
	合计	43,751,427.48	92.77

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	300783	三只松鼠	38,900	850,743.00	1.80
2	300677	英科医疗	26,000	697,060.00	1.48
3	300115	长盈精密	56,300	675,037.00	1.43
4	600966	博汇纸业	140,100	669,678.00	1.42
5	300251	光线传媒	79,300	666,913.00	1.41
6	000027	深圳能源	90,800	662,840.00	1.41
7	600861	北京人力	39,900	651,168.00	1.38
8	002533	金杯电工	64,500	641,775.00	1.36
9	601128	常熟银行	82,700	626,039.00	1.33
10	688159	有方科技	16,500	624,690.00	1.32
11	603236	移远通信	12,720	594,405.60	1.26
12	300218	安利股份	37,500	565,500.00	1.20
13	000551	创元科技	62,700	547,371.00	1.16
14	002697	红旗连锁	115,700	535,691.00	1.14
15	601886	江河集团	109,500	534,360.00	1.13
16	600066	宇通客车	20,500	528,900.00	1.12
17	603501	韦尔股份	5,100	506,787.00	1.07
18	300628	亿联网络	13,100	481,687.00	1.02
19	000830	鲁西化工	40,700	471,713.00	1.00
20	002701	奥瑞金	111,200	462,592.00	0.98
21	002958	青农商行	171,800	460,424.00	0.98
22	600711	盛屯矿业	120,800	443,336.00	0.94
23	002557	洽洽食品	15,300	431,307.00	0.91
24	000921	海信家电	12,000	386,880.00	0.82
25	300241	瑞丰光电	91,000	373,100.00	0.79

26	688016	心脉医疗	3,792	371,805.60	0.79
27	603967	中创物流	37,600	349,680.00	0.74
28	300441	鲍斯股份	58,200	345,126.00	0.73
29	000725	京东方 A	82,800	338,652.00	0.72
30	603089	正裕工业	40,300	336,908.00	0.71
31	600128	苏豪弘业	52,600	335,062.00	0.71
32	688369	致远互联	21,160	332,846.80	0.71
33	600176	中国巨石	29,500	325,975.00	0.69
34	300254	仟源医药	40,200	315,972.00	0.67
35	300879	大叶股份	23,500	314,430.00	0.67
36	300119	瑞普生物	22,900	311,898.00	0.66
37	600697	欧亚集团	30,700	308,535.00	0.65
38	603096	新经典	18,000	304,200.00	0.65
39	002839	张家港行	75,500	303,510.00	0.64
40	601113	华鼎股份	90,800	297,824.00	0.63
41	300953	震裕科技	5,400	292,680.00	0.62
42	000703	恒逸石化	41,200	292,108.00	0.62
43	002273	水晶光电	17,100	290,358.00	0.62
44	605208	永茂泰	45,500	283,465.00	0.60
45	002444	巨星科技	11,400	281,580.00	0.60
46	601666	平煤股份	25,100	281,120.00	0.60
47	002602	世纪华通	81,800	280,574.00	0.59
48	600729	重庆百货	12,500	279,500.00	0.59
49	601975	招商南油	77,200	277,148.00	0.59
50	300457	赢合科技	15,300	272,799.00	0.58
51	300562	乐心医疗	30,600	272,646.00	0.58
52	688208	道通科技	11,200	270,368.00	0.57
53	300724	捷佳伟创	5,000	270,050.00	0.57
54	300842	帝科股份	6,900	267,720.00	0.57
55	600300	维维股份	111,000	266,400.00	0.56
56	600597	光明乳业	34,100	264,957.00	0.56
57	002630	华西能源	120,600	255,672.00	0.54
58	688389	普门科技	15,200	247,152.00	0.52
59	688226	威腾电气	14,122	246,852.56	0.52
60	600219	南山铝业	64,500	245,745.00	0.52
61	603766	隆鑫通用	35,400	240,012.00	0.51
62	600690	海尔智家	8,400	238,392.00	0.51
63	600327	大东方	72,300	231,360.00	0.49
64	603368	柳药集团	11,700	204,750.00	0.43
65	002745	木林森	25,200	203,112.00	0.43
66	601311	骆驼股份	25,000	200,500.00	0.43
67	300841	康华生物	3,850	194,964.00	0.41
68	601615	明阳智能	20,300	191,632.00	0.41

69	600916	中国黄金	19,500	187,590.00	0.40
70	002139	拓邦股份	16,900	179,478.00	0.38
71	601933	永辉超市	69,800	173,104.00	0.37
72	600863	内蒙华电	36,900	171,216.00	0.36
73	300383	光环新网	19,800	167,310.00	0.35
74	600660	福耀玻璃	3,400	162,860.00	0.35
75	002550	千红制药	29,400	158,466.00	0.34
76	600737	中粮糖业	15,900	152,481.00	0.32
77	600887	伊利股份	5,900	152,456.00	0.32
78	603871	嘉友国际	8,540	151,072.60	0.32
79	601678	滨化股份	42,600	148,248.00	0.31
80	002266	浙富控股	53,100	148,149.00	0.31
81	002847	盐津铺子	3,360	143,707.20	0.30
82	002206	海利得	37,300	142,486.00	0.30
83	002534	西子洁能	14,000	140,140.00	0.30
84	000990	诚志股份	15,600	116,064.00	0.25
85	002494	华斯股份	36,500	113,880.00	0.24
86	600493	凤竹纺织	25,300	110,055.00	0.23
87	000887	中鼎股份	8,300	101,592.00	0.22
88	002277	友阿股份	46,100	99,576.00	0.21
89	600480	凌云股份	10,100	99,283.00	0.21
90	002571	德力股份	19,900	96,913.00	0.21
91	000400	许继电气	2,800	96,348.00	0.20
92	600469	风神股份	15,700	91,688.00	0.19
93	603171	税友股份	3,300	89,232.00	0.19
94	300460	惠伦晶体	10,200	87,006.00	0.18
95	002311	海大集团	1,800	84,690.00	0.18
96	688117	圣诺生物	3,421	83,951.34	0.18
97	002061	浙江交科	23,000	83,950.00	0.18
98	603186	华正新材	3,500	83,230.00	0.18
99	600237	铜峰电子	15,900	82,998.00	0.18
100	300435	中泰股份	7,000	82,390.00	0.17
101	002921	联诚精密	8,200	82,082.00	0.17
102	603081	大丰实业	8,800	82,016.00	0.17
103	603867	新化股份	3,500	81,655.00	0.17
104	600794	保税科技	25,500	80,835.00	0.17
105	688020	方邦股份	2,400	80,064.00	0.17
106	002381	双箭股份	11,900	79,849.00	0.17
107	603982	泉峰汽车	9,900	79,200.00	0.17
108	000811	冰轮环境	8,200	79,130.00	0.17
109	000655	金岭矿业	14,300	79,079.00	0.17
110	300445	康斯特	4,900	78,890.00	0.17
111	000701	厦门信达	20,900	78,166.00	0.17

112	603686	福龙马	10,200	77,724.00	0.16
113	601628	中国人寿	2,500	77,625.00	0.16
114	002969	嘉美包装	27,200	77,520.00	0.16
115	600335	国机汽车	13,400	77,318.00	0.16
116	001296	长江材料	5,400	76,950.00	0.16
117	000758	中色股份	15,100	76,708.00	0.16
118	002126	银轮股份	4,400	76,604.00	0.16
119	603601	再升科技	27,500	75,900.00	0.16
120	000563	陕国投 A	27,500	75,625.00	0.16
121	601567	三星医疗	2,100	73,500.00	0.16
122	000404	长虹华意	13,700	73,021.00	0.15
123	600132	重庆啤酒	1,200	72,840.00	0.15
124	688292	浩瀚深度	4,710	72,816.60	0.15
125	000042	中洲控股	18,400	72,680.00	0.15
126	300110	华仁药业	23,400	72,306.00	0.15
127	000528	柳 工	6,400	71,616.00	0.15
128	603267	鸿远电子	2,100	71,610.00	0.15
129	688799	华纳药厂	1,678	71,197.54	0.15
130	688029	南微医学	1,145	70,486.20	0.15
131	300485	赛升药业	11,100	68,154.00	0.14
132	600575	淮河能源	17,300	67,297.00	0.14
133	603987	康德莱	11,000	67,210.00	0.14
134	603348	文灿股份	2,400	66,456.00	0.14
135	000757	浩物股份	26,000	65,260.00	0.14
136	600208	新湖中宝	39,800	62,884.00	0.13
137	002583	海能达	15,300	62,271.00	0.13
138	601919	中远海控	4,000	61,960.00	0.13
139	300817	双飞集团	5,800	61,596.00	0.13
140	600216	浙江医药	5,600	61,488.00	0.13
141	601169	北京银行	10,500	61,320.00	0.13
142	600642	申能股份	6,900	60,927.00	0.13
143	000035	中国天楹	13,400	60,702.00	0.13
144	300207	欣旺达	4,000	60,680.00	0.13
145	002425	凯撒文化	24,000	60,480.00	0.13
146	002237	恒邦股份	5,200	59,852.00	0.13
147	603025	大豪科技	4,300	59,426.00	0.13
148	601668	中国建筑	11,100	58,941.00	0.12
149	002979	雷赛智能	3,200	58,240.00	0.12
150	002563	森马服饰	10,000	58,100.00	0.12
151	002807	江阴银行	15,200	57,304.00	0.12
152	000581	威孚高科	3,500	56,980.00	0.12
153	000923	河钢资源	3,300	56,826.00	0.12
154	002532	天山铝业	7,000	56,770.00	0.12

155	600284	浦东建设	10,400	55,536.00	0.12
156	688520	神州细胞	1,400	55,090.00	0.12
157	601717	郑煤机	3,700	54,760.00	0.12
158	002422	科伦药业	1,800	54,594.00	0.12
159	002215	诺普信	7,300	54,385.00	0.12
160	000915	华特达因	1,800	54,288.00	0.12
161	300647	超频三	9,800	53,802.00	0.11
162	600761	安徽合力	2,400	51,936.00	0.11
163	600141	兴发集团	2,700	51,516.00	0.11
164	000543	皖能电力	5,800	51,330.00	0.11
165	301187	欧圣电气	2,100	50,925.00	0.11
166	605178	时空科技	3,100	50,902.00	0.11
167	600872	中炬高新	2,200	49,918.00	0.11
168	000709	河钢股份	25,600	49,664.00	0.11
169	605368	蓝天燃气	3,600	49,104.00	0.10
170	600183	生益科技	2,300	48,438.00	0.10
171	688050	爱博医疗	648	47,511.36	0.10
172	002856	美芝股份	5,000	47,400.00	0.10
173	601816	京沪高铁	8,800	47,256.00	0.10
174	002970	锐明技术	1,300	46,839.00	0.10
175	300762	上海瀚讯	2,600	46,566.00	0.10
176	601233	桐昆股份	2,900	46,284.00	0.10
177	300529	健帆生物	1,700	46,257.00	0.10
178	603358	华达科技	1,600	46,160.00	0.10
179	002652	扬子新材	17,400	46,110.00	0.10
180	002008	大族激光	2,200	45,760.00	0.10
181	601009	南京银行	4,400	45,716.00	0.10
182	605488	福莱新材	3,500	45,500.00	0.10
183	000902	新洋丰	3,800	45,106.00	0.10
184	601991	大唐发电	14,800	44,548.00	0.09
185	000786	北新建材	1,500	44,490.00	0.09
186	002270	华明装备	2,000	44,480.00	0.09
187	600489	中金黄金	3,000	44,400.00	0.09
188	300674	宇信科技	4,000	44,320.00	0.09
189	600885	宏发股份	1,600	44,288.00	0.09
190	300120	经纬辉开	8,500	44,115.00	0.09
191	600750	江中药业	1,900	43,909.00	0.09
192	605158	华达新材	6,800	43,724.00	0.09
193	002161	远望谷	9,400	43,428.00	0.09
194	688018	乐鑫科技	440	43,419.20	0.09
195	000552	甘肃能化	12,500	43,375.00	0.09
196	600282	南钢股份	8,700	43,326.00	0.09
196	603389	亚振家居	8,300	43,326.00	0.09

197	002340	格林美	6,800	43,316.00	0.09
198	601101	昊华能源	4,700	43,193.00	0.09
199	002376	新北洋	8,000	43,120.00	0.09
200	600908	无锡银行	8,100	43,092.00	0.09
201	601677	明泰铝业	3,700	42,772.00	0.09
202	300899	上海凯鑫	2,300	42,734.00	0.09
203	600362	江西铜业	1,800	42,624.00	0.09
204	600125	铁龙物流	7,100	42,387.00	0.09
205	300514	友讯达	2,800	42,364.00	0.09
206	300808	久量股份	2,600	42,354.00	0.09
207	002521	齐峰新材	3,600	42,300.00	0.09
208	600605	汇通能源	1,700	42,296.00	0.09
209	002274	华昌化工	5,700	42,294.00	0.09
210	300521	爱司凯	4,100	42,230.00	0.09
211	300502	新易盛	400	42,220.00	0.09
212	301125	腾亚精工	4,260	42,131.40	0.09
213	002948	青岛银行	12,500	42,125.00	0.09
214	601187	厦门银行	7,900	42,107.00	0.09
215	600864	哈投股份	8,800	41,800.00	0.09
216	603836	海程邦达	3,100	41,757.00	0.09
217	600114	东睦股份	2,900	41,731.00	0.09
218	600007	中国国贸	1,900	41,724.00	0.09
219	601997	贵阳银行	7,900	41,633.00	0.09
220	002469	三维化学	7,300	41,610.00	0.09
221	002558	巨人网络	4,400	41,536.00	0.09
222	600928	西安银行	12,700	41,529.00	0.09
223	003023	彩虹集团	2,600	41,470.00	0.09
224	601139	深圳燃气	6,200	41,416.00	0.09
225	000548	湖南投资	10,300	41,406.00	0.09
226	600787	中储股份	8,600	41,366.00	0.09
227	301178	天亿马	2,000	41,260.00	0.09
228	603160	汇顶科技	600	41,250.00	0.09
229	600153	建发股份	4,600	41,078.00	0.09
230	605196	华通线缆	3,900	41,028.00	0.09
231	002204	大连重工	9,600	40,992.00	0.09
232	603116	红蜻蜓	9,100	40,950.00	0.09
233	601577	长沙银行	5,000	40,900.00	0.09
234	603611	诺力股份	2,400	40,896.00	0.09
235	002091	江苏国泰	6,000	40,860.00	0.09
236	600409	三友化工	8,100	40,662.00	0.09
237	300005	探路者	8,100	40,581.00	0.09
238	601872	招商轮船	4,800	40,560.00	0.09
239	688408	中信博	440	40,515.20	0.09

240	603518	锦泓集团	4,600	40,480.00	0.09
241	603161	科华控股	2,700	40,419.00	0.09
242	002608	江苏国信	5,200	40,300.00	0.09
242	002615	哈尔斯	6,500	40,300.00	0.09
243	601901	方正证券	5,200	40,196.00	0.09
244	300059	东方财富	3,800	40,128.00	0.09
245	000949	新乡化纤	11,800	40,120.00	0.09
246	300995	奇德新材	2,600	40,092.00	0.09
247	301011	华立科技	2,600	40,066.00	0.08
248	002075	沙钢股份	10,600	39,962.00	0.08
249	600704	物产中大	9,200	39,928.00	0.08
250	002012	凯恩股份	11,700	39,897.00	0.08
251	002617	露笑科技	8,300	39,840.00	0.08
252	000030	富奥股份	8,100	39,771.00	0.08
253	300950	德固特	2,600	39,624.00	0.08
254	002443	金洲管道	7,400	39,516.00	0.08
255	000060	中金岭南	9,300	39,432.00	0.08
256	600399	抚顺特钢	7,000	39,410.00	0.08
257	002011	盾安环境	4,000	39,320.00	0.08
258	000886	海南高速	9,400	39,292.00	0.08
259	600502	安徽建工	9,100	39,130.00	0.08
260	600073	光明肉业	7,100	39,121.00	0.08
261	002668	TCL 智家	4,300	38,958.00	0.08
262	002165	红宝丽	11,800	38,940.00	0.08
262	300948	冠中生态	4,400	38,940.00	0.08
263	605081	太和水	3,300	38,577.00	0.08
264	002286	保龄宝	7,000	38,570.00	0.08
265	000544	中原环保	4,900	38,563.00	0.08
266	001226	拓山重工	1,400	38,206.00	0.08
267	300892	品渥食品	2,800	38,192.00	0.08
268	603727	博迈科	2,900	38,164.00	0.08
269	603708	家家悦	4,700	38,117.00	0.08
270	300694	蠡湖股份	4,400	37,444.00	0.08
271	301167	建研设计	3,200	37,248.00	0.08
272	300707	威唐工业	3,000	37,140.00	0.08
273	000691	亚太实业	10,100	37,067.00	0.08
274	002244	滨江集团	5,100	37,026.00	0.08
275	688139	海尔生物	993	36,939.60	0.08
276	002852	道道全	5,100	36,720.00	0.08
277	301098	金埔园林	4,800	36,336.00	0.08
278	300181	佐力药业	2,400	36,288.00	0.08
279	300635	中达安	4,800	36,240.00	0.08
280	002848	高斯贝尔	5,200	36,088.00	0.08

281	300840	酷特智能	3,900	36,075.00	0.08
282	300749	顶固集创	6,800	36,040.00	0.08
283	002128	电投能源	1,700	35,870.00	0.08
284	002385	大北农	9,300	35,805.00	0.08
284	600521	华海药业	2,100	35,805.00	0.08
285	603612	索通发展	2,800	35,728.00	0.08
286	301024	霍普股份	1,800	35,712.00	0.08
287	603616	韩建河山	12,100	35,695.00	0.08
288	603444	吉比特	200	35,602.00	0.08
289	600315	上海家化	2,000	35,560.00	0.08
290	002035	华帝股份	5,700	35,511.00	0.08
291	300106	西部牧业	5,900	35,400.00	0.08
292	002188	中天服务	8,100	35,397.00	0.08
293	002567	唐人神	6,600	35,376.00	0.08
294	600455	博通股份	2,400	35,328.00	0.07
295	300685	艾德生物	2,000	35,280.00	0.07
296	605069	正和生态	5,700	34,998.00	0.07
297	688659	元琛科技	5,787	34,722.00	0.07
298	300912	凯龙高科	3,700	34,669.00	0.07
299	301288	清研环境	3,100	34,596.00	0.07
300	301228	实朴检测	3,700	34,595.00	0.07
301	002207	准油股份	8,400	34,524.00	0.07
302	002205	国统股份	5,500	34,485.00	0.07
303	300896	爱美客	200	34,420.00	0.07
304	605111	新洁能	1,120	34,260.80	0.07
305	002058	威尔泰	4,500	34,200.00	0.07
306	600302	标准股份	9,900	34,056.00	0.07
307	002591	恒大高新	9,300	34,038.00	0.07
308	002225	濮耐股份	8,300	33,947.00	0.07
309	000848	承德露露	4,300	33,798.00	0.07
310	300665	飞鹿股份	6,600	33,462.00	0.07
311	002028	思源电气	500	33,450.00	0.07
312	301126	达嘉维康	3,700	33,411.00	0.07
313	002027	分众传媒	5,500	33,330.00	0.07
314	000999	华润三九	780	33,212.40	0.07
315	000630	铜陵有色	9,200	33,212.00	0.07
316	600149	廊坊发展	10,300	33,166.00	0.07
317	601318	中国平安	800	33,088.00	0.07
318	603486	科沃斯	700	33,026.00	0.07
319	000929	兰州黄河	5,400	32,994.00	0.07
320	688004	博汇科技	3,007	32,926.65	0.07
321	002211	宏达新材	13,000	32,890.00	0.07
322	000927	中国铁物	13,800	32,844.00	0.07

323	600587	新华医疗	2,080	32,739.20	0.07
324	300030	阳普医疗	8,800	32,736.00	0.07
325	000638	万方发展	9,200	32,568.00	0.07
326	002020	京新药业	3,100	32,457.00	0.07
327	300662	科锐国际	2,000	32,260.00	0.07
328	002719	麦趣尔	5,400	32,130.00	0.07
329	300482	万孚生物	1,300	31,720.00	0.07
330	603567	珍宝岛	3,000	31,590.00	0.07
331	688232	新点软件	1,600	31,552.00	0.07
332	600557	康缘药业	2,000	31,400.00	0.07
333	002193	如意集团	11,200	31,136.00	0.07
334	000785	居然之家	12,800	31,104.00	0.07
335	000679	大连友谊	13,000	30,810.00	0.07
336	600276	恒瑞医药	800	30,768.00	0.07
337	300145	中金环境	12,300	30,750.00	0.07
338	603021	山东华鹏	11,900	30,702.00	0.07
339	600998	九州通	6,192	30,216.96	0.06
340	002897	意华股份	800	30,128.00	0.06
341	603716	塞力医疗	5,300	30,104.00	0.06
342	002554	惠博普	13,800	29,946.00	0.06
343	300405	科隆股份	8,300	29,465.00	0.06
344	600702	舍得酒业	500	28,335.00	0.06
345	300144	宋城演艺	3,500	28,105.00	0.06
346	603883	老百姓	1,430	26,254.80	0.06
347	301015	百洋医药	1,100	25,883.00	0.05
348	002409	雅克科技	400	25,164.00	0.05
349	688516	奥特维	600	25,086.00	0.05
350	002032	苏泊尔	500	25,050.00	0.05
351	300401	花园生物	1,700	24,378.00	0.05
352	603939	益丰药房	960	23,568.00	0.05
353	000651	格力电器	600	23,532.00	0.05
354	688036	传音控股	302	23,115.08	0.05
355	301219	腾远钴业	600	22,956.00	0.05
356	002850	科达利	300	22,914.00	0.05
357	688100	威胜信息	600	22,890.00	0.05
358	600486	扬农化工	400	22,580.00	0.05
359	300856	科思股份	700	22,407.00	0.05
360	600601	方正科技	7,300	21,900.00	0.05
361	600408	安泰集团	13,700	21,646.00	0.05
362	603026	石大胜华	600	20,280.00	0.04
363	300770	新媒股份	600	20,028.00	0.04
364	601163	三角轮胎	1,300	19,786.00	0.04
365	601000	唐山港	4,200	19,740.00	0.04

366	603328	依顿电子	2,500	19,650.00	0.04
367	002832	比音勒芬	800	19,336.00	0.04
368	600566	济川药业	600	19,026.00	0.04
369	002152	广电运通	1,800	18,828.00	0.04
370	300638	广和通	1,100	18,810.00	0.04
371	300458	全志科技	800	18,808.00	0.04
372	000423	东阿阿胶	300	18,780.00	0.04
373	603369	今世缘	400	18,480.00	0.04
374	300253	卫宁健康	3,100	18,290.00	0.04
375	600926	杭州银行	1,400	18,270.00	0.04
376	600886	国投电力	1,000	18,240.00	0.04
377	688120	华海清科	96	18,199.68	0.04
378	002991	甘源食品	300	18,195.00	0.04
379	600420	国药现代	1,700	18,156.00	0.04
380	300750	宁德时代	100	18,003.00	0.04
381	000338	潍柴动力	1,100	17,864.00	0.04
382	603993	洛阳钼业	2,100	17,850.00	0.04
383	300768	迪普科技	1,500	17,775.00	0.04
384	002925	盈趣科技	1,400	17,738.00	0.04
385	601665	齐鲁银行	3,600	17,676.00	0.04
386	600577	精达股份	4,400	17,468.00	0.04
387	600612	老凤祥	300	17,457.00	0.04
388	002001	新和成	900	17,280.00	0.04
389	000001	平安银行	1,700	17,255.00	0.04
390	002423	中粮资本	2,300	17,227.00	0.04
391	603055	台华新材	1,700	17,221.00	0.04
392	000951	中国重汽	1,200	17,184.00	0.04
393	601868	中国能建	8,100	17,172.00	0.04
394	000425	徐工机械	2,400	17,160.00	0.04
395	601555	东吴证券	2,900	17,110.00	0.04
396	000727	冠捷科技	8,300	17,098.00	0.04
397	600017	日照港	6,400	17,088.00	0.04
398	300002	神州泰岳	2,100	17,052.00	0.04
399	002245	蔚蓝锂芯	2,200	17,050.00	0.04
400	001914	招商积余	1,700	17,034.00	0.04
401	601800	中国交建	1,900	16,986.00	0.04
402	000517	荣安地产	6,300	16,884.00	0.04
403	601058	赛轮轮胎	1,200	16,800.00	0.04
404	600170	上海建工	7,800	16,770.00	0.04
405	002242	九阳股份	1,600	16,768.00	0.04
406	600037	歌华有线	2,800	16,744.00	0.04
407	600252	中恒集团	7,700	16,709.00	0.04
408	600048	保利发展	1,900	16,644.00	0.04

409	600643	爱建集团	4,400	16,588.00	0.04
410	601108	财通证券	2,500	16,525.00	0.04
411	601969	海南矿业	2,600	16,484.00	0.03
412	002138	顺络电子	600	16,476.00	0.03
413	601618	中国中冶	5,300	16,430.00	0.03
414	002961	瑞达期货	1,500	16,425.00	0.03
415	601718	际华集团	6,600	16,368.00	0.03
416	002081	金螳螂	5,400	16,362.00	0.03
417	603323	苏农银行	3,400	16,354.00	0.03
418	603187	海容冷链	1,400	16,324.00	0.03
419	603583	捷昌驱动	800	16,304.00	0.03
420	002283	天润工业	3,800	16,302.00	0.03
421	600710	苏美达	2,000	16,300.00	0.03
422	002065	东华软件	3,600	16,272.00	0.03
423	000488	晨鸣纸业	4,700	16,262.00	0.03
424	002390	信邦制药	4,900	16,219.00	0.03
425	600459	贵研铂业	1,200	16,212.00	0.03
426	600623	华谊集团	2,800	16,184.00	0.03
427	002249	大洋电机	3,400	16,082.00	0.03
428	601528	瑞丰银行	3,400	16,048.00	0.03
429	601600	中国铝业	2,100	16,023.00	0.03
430	000875	吉电股份	3,000	15,990.00	0.03
431	601229	上海银行	2,200	15,972.00	0.03
432	600210	紫江企业	3,000	15,960.00	0.03
433	002488	金固股份	3,600	15,804.00	0.03
434	300587	天铁股份	3,900	15,756.00	0.03
435	600497	驰宏锌锗	2,900	15,486.00	0.03
436	000828	东莞控股	1,700	15,317.00	0.03
437	300687	赛意信息	1,100	15,312.00	0.03
438	002191	劲嘉股份	4,200	15,162.00	0.03
439	002498	汉缆股份	4,600	15,134.00	0.03
440	300428	立中集团	800	14,872.00	0.03
441	002099	海翔药业	2,900	14,819.00	0.03
442	002221	东华能源	1,800	14,778.00	0.03
443	600158	中体产业	1,900	14,611.00	0.03
444	603919	金徽酒	800	14,536.00	0.03
445	002155	湖南黄金	800	14,480.00	0.03
446	600997	开滦股份	2,100	14,406.00	0.03
447	600197	伊力特	800	14,248.00	0.03
448	003006	百亚股份	600	14,220.00	0.03
449	002145	中核钛白	4,300	14,104.00	0.03
450	603517	绝味食品	900	13,860.00	0.03
451	600096	云天化	700	13,594.00	0.03

452	002984	森麒麟	560	13,490.40	0.03
453	300855	图南股份	510	13,484.40	0.03
454	000069	华侨城 A	6,600	13,464.00	0.03
455	000403	派林生物	500	13,330.00	0.03
456	002472	双环传动	600	13,212.00	0.03
457	300598	诚迈科技	440	12,355.20	0.03
458	601865	福莱特	600	12,060.00	0.03
459	300390	天华新能	700	12,026.00	0.03
460	300408	三环集团	400	11,676.00	0.02
461	002936	郑州银行	6,300	10,899.00	0.02
462	603156	养元饮品	500	10,635.00	0.02
463	002727	一心堂	700	10,563.00	0.02
464	603806	福斯特	700	10,290.00	0.02
465	002437	誉衡药业	6,000	10,200.00	0.02
465	600567	山鹰国际	6,800	10,200.00	0.02
466	002146	荣盛发展	6,700	9,983.00	0.02
467	688019	安集科技	79	9,938.20	0.02
468	000718	苏宁环球	5,900	9,912.00	0.02
469	600503	华丽家族	5,500	9,845.00	0.02
470	002629	仁智股份	6,000	9,300.00	0.02
471	002607	中公教育	5,100	7,803.00	0.02
472	688439	振华风光	96	6,379.20	0.01
473	605258	协和电子	200	6,272.00	0.01
474	688777	中控技术	143	5,391.10	0.01
475	688656	浩欧博	122	2,797.46	0.01
476	688578	艾力斯	33	2,103.42	0.00
477	300487	蓝晓科技	50	2,088.00	0.00
478	688630	芯碁微装	24	1,501.68	0.00
479	300866	安克创新	20	1,424.20	0.00
480	688078	龙软科技	60	1,381.80	0.00
481	688309	恒誉环保	115	1,378.85	0.00
482	300811	铂科新材	28	1,229.20	0.00
483	688314	康拓医疗	47	884.54	0.00
484	688021	奥福环保	93	855.60	0.00
485	688186	广大特材	83	807.59	0.00
486	688081	兴图新科	83	730.40	0.00
487	688676	金盘科技	13	677.95	0.00
488	300031	宝通科技	43	617.91	0.00
489	688526	科前生物	42	616.98	0.00
490	301321	翰博高新	48	552.48	0.00
491	688121	卓然股份	45	540.90	0.00
492	688619	罗普特	74	520.22	0.00
493	603613	国联股份	20	392.20	0.00

494	688068	热景生物	15	387.45	0.00
495	688658	悦康药业	20	356.80	0.00
496	688628	优利德	10	327.70	0.00
497	688377	迪威尔	23	301.30	0.00
498	605287	德才股份	20	251.80	0.00
499	688466	金科环境	20	238.40	0.00
500	688669	聚石化学	14	158.48	0.00
501	300970	华绿生物	13	149.11	0.00
502	300658	延江股份	20	84.40	0.00
503	688299	长阳科技	1	12.79	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	601886	江河集团	1,143,689.00	1.59
2	300783	三只松鼠	997,812.00	1.39
3	600966	博汇纸业	888,837.00	1.24
4	002701	奥瑞金	847,424.00	1.18
5	300251	光线传媒	784,209.00	1.09
6	600861	北京人力	783,644.00	1.09
7	688159	有方科技	781,495.28	1.09
8	601128	常熟银行	773,921.00	1.08
9	300119	瑞普生物	746,790.00	1.04
10	000027	深圳能源	735,774.00	1.02
11	002958	青农商行	733,712.00	1.02
12	002165	红宝丽	732,100.00	1.02
13	600737	中粮糖业	694,734.00	0.97
14	000528	柳工	690,812.00	0.96
15	600872	中炬高新	688,734.00	0.96
16	300677	英科医疗	688,293.00	0.96
17	600711	盛屯矿业	680,527.00	0.95
18	002444	巨星科技	662,774.04	0.92
19	300562	乐心医疗	659,449.00	0.92
20	688016	心脉医疗	648,925.77	0.90

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	600153	建发股份	1,456,320.00	2.02
2	600066	宇通客车	1,286,643.00	1.79

3	600901	江苏金租	1,221,296.60	1.70
4	600623	华谊集团	1,094,170.00	1.52
5	300782	卓胜微	913,626.00	1.27
6	603871	嘉友国际	825,531.00	1.15
7	600872	中炬高新	797,367.00	1.11
8	601717	郑煤机	764,801.00	1.06
9	002027	分众传媒	761,799.00	1.06
10	300709	精研科技	760,565.00	1.06
11	300815	玉禾田	757,047.00	1.05
12	688127	蓝特光学	750,376.39	1.04
13	002078	太阳纸业	749,577.00	1.04
14	600023	浙能电力	740,217.00	1.03
15	000059	华锦股份	725,679.00	1.01
16	600970	中材国际	688,062.00	0.96
17	688169	石头科技	678,815.96	0.94
18	002165	红宝丽	676,203.00	0.94
19	301160	翔楼新材	667,563.00	0.93
20	603050	科林电气	666,013.00	0.93

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	166,536,582.81
卖出股票收入（成交）总额	187,243,248.20

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。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 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

基金管理人没有发现本基金投资的前十名证券的发行主体在报告期内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	116,592.00
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	19,362.20
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	135,954.20

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，合计数可能不等于分项之和。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基 金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份 额比例 (%)	持有份额	占总 份额 比例 (%)
华宝量化 选股混合 发起式 A	99	191,527.39	10,024,209.72	52.87	8,937,002.10	47.13
华宝量化 选股混合 发起式 C	417	77,134.76	397,813.93	1.24	31,767,382.50	98.76
合计	516	99,082.19	10,422,023.65	20.38	40,704,384.60	79.62

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管 理人所有从业 人员持有本基 金	华宝量化选股混合发起式 A	1,574,698.12	8.3048
	华宝量化选股混合发起式 C	497,803.51	1.5476
	合计	2,072,501.63	4.0537

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、 基金投资和研 究部门负责人持有本开放式 基金	华宝量化选股混合发起式 A	10~50
	华宝量化选股混合发起式 C	10~50
	合计	10~50
本基金基金经理持有 本开放式基金	华宝量化选股混合发起式 A	>100
	华宝量化选股混合发起式 C	10~50
	合计	>100

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	发起份额总数	发起份额占 基金总份额	发起份额承 诺持有期限

		份 额 比 例 (%)		比 例 (%)	
基金管理人固有资金	10,001,041.77	19.56	10,001,041.77	19.56	不少于 3 年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,001,041.77	19.56	10,001,041.77	19.56	-

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

2、本基金管理人运用固有资金于 2023 年 2 月 15 日通过本公司直销柜台认购本基金作为发起资金的认购费用为 1,000 元。符合基金合同和招募说明书等法律文件的约定。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华宝量化选股混合发起式 A	华宝量化选股混合发起式 C
基金合同生效日 (2023 年 2 月 20 日)		
基金份额总额	19,742,180.45	74,223,121.88
本报告期期初基金份额总额	21,467,805.54	54,043,807.18
本报告期基金总申购份额	3,154,553.29	12,900,301.42
减：本报告期基金总赎回份额	5,661,147.01	34,778,912.17
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	18,961,211.82	32,165,196.43

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、基金管理人的重大人事变动

本报告期内，基金管理人无重大人事变动。

2、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，无涉及本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产和基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未发生变更。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚的情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人及其高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
中信证券	2	353,779,831.01	100.00	197,446.70	100.00	-

注：1. 基金管理人选择交易单元的标准和程序如下：

(1) 选择标准： 资质雄厚，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

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. 本期交易单元未发生变化。

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	2024-01-19
2	华宝基金管理有限公司旗下部分基金年度报告提示性公告	上海证券报，证券日报，证券时报，中国证券报	2024-03-29
3	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	2024-04-19
4	华宝量化选股混合型发起式证券投资基金（A类份额）基金产品资料概要（更新）	基金管理人网站	2024-06-28
5	华宝量化选股混合型发起式证券投资基金（C类份额）基金产品资料概要（更新）	基金管理人网站	2024-06-28

§ 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	20240517~20240620	10,001,041.77	0.00	0.00	10,001,041.77	19.56
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，加强防范流动性风险、市场风险，保护持有人利益。</p>							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

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

12.2 存放地点

以上文件存于基金管理人及基金托管人办公场所备投资者查阅。

12.3 查阅方式

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

华宝基金管理有限公司

2024 年 8 月 30 日