

上证 180 价值交易型开放式指数证券投资  
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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商银行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

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>8</b>
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	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
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	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	10
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
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>11</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
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	11
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	11
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>11</b>
6.1 资产负债表	11
6.2 利润表	13
6.3 净资产变动表	14
6.4 报表附注	16
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>36</b>
7.1 期末基金资产组合情况	36
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	36
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	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	39
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	41
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	41

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 .....	41
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 .....	41
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 .....	41
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	41
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	41
7.12 投资组合报告附注 .....	41
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>44</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	44
8.2 期末上市基金前十名持有人 .....	44
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	45
8.4 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 .....	45
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>45</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>45</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	45
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 .....	45
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	46
10.4 基金投资策略的改变 .....	46
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	46
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 .....	46
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	46
10.8 其他重大事件 .....	47
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>47</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	47
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	48
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>48</b>
12.1 备查文件目录 .....	48
12.2 存放地点 .....	48
12.3 查阅方式 .....	48

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	上证 180 价值交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	上证 180 价值 ETF
场内简称	价值 ETF
基金主代码	510030
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2010 年 4 月 23 日
基金管理人	华宝基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	159,729,808.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2010 年 5 月 28 日

### 2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金股票资产投资原则上采用完全复制标的指数的方法跟踪标的指数。 通常情况下，本基金根据标的指数成份股票在指数中的权重确定成份股票的买卖数量，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。在因特殊情况（如成份股停牌、流动性不足、法规法律限制等）导致无法获得足够数量的股票时，本基金可以根据市场情况，结合经验判断，综合考虑相关性、估值、流动性等因素挑选标的指数中其他成份股或备选成份股进行替代（同行业股票优先考虑），以期在规定的风险承受限度之内，尽量缩小跟踪误差。
业绩比较基准	上证 180 价值指数收益率
风险收益特征	本基金为股票基金，其风险和预期收益均高于货币市场基金、债券型基金和混合基金。本基金在股票基金中属于指数基金，紧密跟踪标的指数，属于股票基金中风险较高、收益与标的指数所代表的股票市场水平大致相近的产品。

### 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	中国工商银行股份有限公司
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	95588
传真	021-38505777	(010) 66105798
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	北京市西城区复兴门内大街 55 号

	58 楼	
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 55 号
邮政编码	200120	100140
法定代表人	黄孔威	廖林

## 2.4 信息披露方式

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

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

## § 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)
本期已实现收益	-3,002,942.39
本期利润	17,875,224.04
加权平均基金份额本期利润	0.1054
本期加权平均净值利润率	12.69%
本期基金份额净值增长率	13.45%
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	75,125,326.88
期末可供分配基金份额利润	0.4703
期末基金资产净值	138,862,964.22
期末基金份额净值	0.869
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	137.99%

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

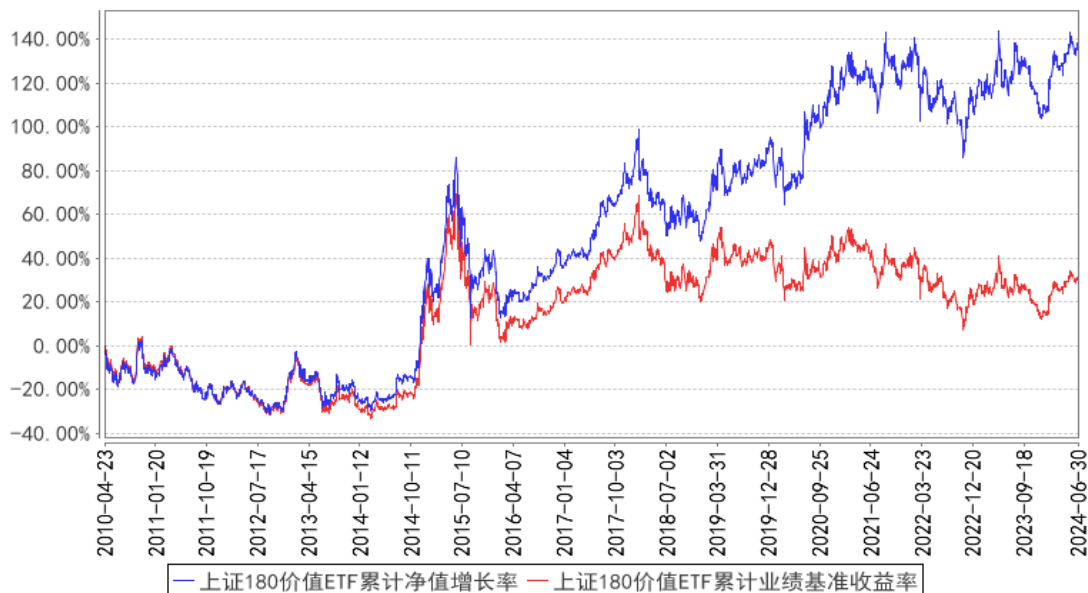
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.00%	0.60%	-0.65%	0.59%	0.65%	0.01%
过去三个月	4.45%	0.72%	4.02%	0.73%	0.43%	-0.01%
过去六个月	13.45%	0.80%	13.23%	0.81%	0.22%	-0.01%
过去一年	8.90%	0.84%	5.51%	0.85%	3.39%	-0.01%
过去三年	6.36%	1.06%	-7.09%	1.08%	13.45%	-0.02%
自基金合同生效起至今	137.99%	1.33%	30.97%	1.35%	107.02%	-0.02%

注：（1）基金业绩基准：上证 180 价值指数收益率；

（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

上证180价值ETF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 2010 年 10 月 23 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		
丰晨成	本基金基金经理	2015-11-13	-	15 年	硕士。2009 年 7 月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、投资经理等职务。2015 年 11 月起任华宝上证 180 价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金、上证 180 价值交易型开放式指数证券投资基金基金经理，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 月至 2021 年 1 月任华宝中证 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 月至 2020 年 11 月任华宝中证 1000 指数分级证券投资基金基金经理，2020 年 11 月起任华宝中证 1000 指数证券投资基金基金经理，2022 年 2 月起任华宝中证港股通互联网交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2022 年 9 月至 2023 年 3 月任华宝标普中国 A 股质量价值指数证券投资基金 (LOF) 基金经理，2022 年 12 月起任华宝中证港股通互联网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。
--	--	--	--	--	-----------------

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、《上证 180 价值交易型开放式指数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，经济运行总体平稳、稳中有进，新动能新优势加快培育，高质量发展扎实推进，同时也应看到当前外部环境变化带来的不利影响增多，国内有效需求不足，经济运行出现分化，新旧动能转换存在阵痛。A 股市场 1 月受资金面影响出现急跌行情，2 月初到 3 月中旬市场在一系列稳增长政策、资本市场政策和“国家队”入市的支撑下反弹，但在 6 月受汇率及北向流出

影响，风险偏好持续走弱，市场整体下行。上半年来看价值风格相对占优，在 10 年期国债利率走低以及降息降准等外部货币环境下，叠加市场风格偏好，价值股明显跑赢市场，表征大盘价值蓝筹的 180 价值指数整体表现明显强于上证 180 指数、沪深 300 指数、创业板指数等宽基指数。原因来自几方面：当市场弥漫悲观情绪，小市值股票急跌时，以银行股为代表的价值股成为权益类资产投资者的避风港，同时也体现出低波动股票在市场剧烈动荡时相对抗跌，成为稳定宽基指数的“定海神针”，此外市场在低利率环境下对于低估值高股息板块的投资偏好，几大因素叠加，价值 ETF 在上半年接近创出历史新高，从价值 ETF 的长期表现也能看到其在动荡的国内 A 股市场显示出稳健的投资表现。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金份额净值增长率为 13.45%，业绩比较基准收益率为 13.23%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年中央要求宏观政策要持续用力、更加给力，及早储备并适时推出一批增量政策举措。因地制宜发展新质生产力，不断增强新动能新优势，深入挖掘内需潜力，以提振消费为重点扩大国内需求。充分发挥经济体制改革的牵引作用，及时推出一批条件成熟、可感可及的改革举措。尽管面临发展和转型中的问题，但下半年在超长期特别国债，推动大规模设备更新和大宗耐用消费品以旧换新等措施落地，地产产业链政策的改善，经济数据在底部酝酿反弹，在美联储降息周期的可见度提高下，国内再次降息降准的可能性增加，而市场无风险利率持续走低，也客观上有利于价值股的投资偏好提升。180 价值指数与其他蓝筹指数或红利指数相比，因其锚定低估值和高分红，选择“三低一高”价值股的选股理念，是值得信赖的一种投资理念，大盘价值股走势稳健的特点，屡次证明了在市场的“中流砥柱”作用。长期来看，我们应客观理性看待价值股的中长期平均收益，其上涨依赖于自身盈利能力带来的业绩反馈。我们对以 180 价值指数为代表的大盘蓝筹价值股在下半年的表现抱有信心。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

本基金的估值由基金会计负责，基金会计以本基金为会计核算主体，基金会计核算独立于公

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

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

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

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

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对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的有关规定，不存在任何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，本基金的管理人——华宝基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人依法对华宝基金管理有限公司编制和披露的本基金 2024 年中期报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、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：上证 180 价值交易型开放式指数证券投资基金

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
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	1,889,515.20	1,327,170.65
结算备付金		-	-
存出保证金		335.13	1,096.74
交易性金融资产	6.4.7.2	137,181,022.54	153,916,585.26
其中：股票投资		137,181,022.54	153,916,585.26
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		75.99	3,909.23
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		139,070,948.86	155,248,761.88
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2023 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	53.96
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		56,915.67	62,935.72
应付托管费		11,383.13	12,587.14
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		88.41	88.41
应付利润		-	-

递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	139,597.43	257,138.27
负债合计		207,984.64	332,803.50
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	58,325,135.40	73,843,956.01
未分配利润	6.4.7.8	80,537,828.82	81,072,002.37
净资产合计		138,862,964.22	154,915,958.38
负债和净资产总计		139,070,948.86	155,248,761.88

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额净值 0.869 元，基金份额总额 159,729,808.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：上证 180 价值交易型开放式指数证券投资基金

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 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		18,447,420.36	3,069,371.62
1. 利息收入		1,935.81	2,410.79
其中：存款利息收入	6.4.7.9	1,935.81	2,410.79
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		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-2,432,961.88	2,026,723.38
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-3,739,479.00	-698,934.41
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-	-
资产支持证券投资	6.4.7.12	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	1,306,517.12	2,725,657.79
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	20,878,166.43	1,048,445.45
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	280. 00	-8, 208. 00
<b>减：二、营业总支出</b>		572, 196. 32	545, 653. 12
1. 管理人报酬	6. 4. 10. 2. 1	350, 376. 57	328, 437. 65
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	70, 075. 37	65, 687. 55
3. 销售服务费		-	-
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	151, 744. 38	151, 527. 92
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		17, 875, 224. 04	2, 523, 718. 50
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		17, 875, 224. 04	2, 523, 718. 50
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		17, 875, 224. 04	2, 523, 718. 50

### 6.3 净资产变动表

会计主体：上证 180 价值交易型开放式指数证券投资基金

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	73, 843, 956. 01	-	81, 072, 002. 37	154, 915, 958. 38
二、本期期初净资产	73, 843, 956. 01	-	81, 072, 002. 37	154, 915, 958. 38
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-15, 518, 820. 61	-	-534, 173. 55	-16, 052, 994. 16
（一）、综合收益总额	-	-	17, 875, 224. 04	17, 875, 224. 04
（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）	-15, 518, 820. 61	-	-18, 409, 397. 59	-33, 928, 218. 20

其中：1. 基金申购款	8,398,420.59	-	10,629,892.22	19,028,312.81
2. 基金赎回款	-23,917,241.20	-	-29,039,289.81	-52,956,531.01
(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	58,325,135.40	-	80,537,828.82	138,862,964.22
项目	上年度可比期间			
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	52,482,755.94	-	57,408,297.23	109,891,053.17
二、本期期初净资产	52,482,755.94	-	57,408,297.23	109,891,053.17
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	22,274,071.92	-	31,232,221.14	53,506,293.06
(一)、综合收益总额	-	-	2,523,718.50	2,523,718.50
(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)	22,274,071.92	-	28,708,502.64	50,982,574.56
其中：1. 基金申购款	30,672,492.64	-	39,323,438.92	69,995,931.56
2. 基金赎回款	-8,398,420.72	-	-10,614,936.28	-19,013,357.00
(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	74,756,827.86	-	88,640,518.37	163,397,346.23

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

上证 180 价值交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2010]227 号《关于核准上证 180 价值交易型开放式指数证券投资基金及联接基金募集的批复》核准，由华宝基金管理有限公司（原华宝兴业基金管理有限公司，已于 2017 年 10 月 17 日办理完成工商变更登记）作为管理人依据《中华人民共和国证券投资基金法》和《上证 180 价值交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为交易型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 2,109,157,136.00 元（含募集股票市值），业经安永华明（2010）验字第 60737318\_B04 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《上证 180 价值交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2010 年 4 月 23 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 2,109,182,935.00 份基金份额，其中认购资金利息折合为 25,799.00 份基金份额。本基金的基金管理人为华宝基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《上证 180 价值交易型开放式指数证券投资基金基金合同》等有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括上证 180 价值指数的成份股及其备选成份股、新股（首次公开发行或增发）、存托凭证、债券，以及经中国证监会批准的允许本基金投资的其它金融工具。法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金投资于上证 180 价值指数的成份股和备选成份股的资产比例不低于该基金资产净值的 95%，同时为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于新股、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，该部分资产比例不高于基金资产净值的 5%。

本基金业绩比较基准为标的指数。本基金标的指数变更的，业绩比较基准随之变更并公告。

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	1,889,515.20
等于：本金	1,889,363.09
加：应计利息	152.11
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	1,889,515.20

#### 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	131,137,213.35	-	137,181,022.54	6,043,809.19
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	131,137,213.35	-	137,181,022.54	6,043,809.19

注：股票投资的估值增值和股票投资的公允价值均包含可退替代款估值增值。

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

##### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无

##### 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无

#### 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	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	23,045.05
其中：交易所市场	23,045.05
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	81,552.38
应付指数使用费	35,000.00
合计	139,597.43

#### 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	202,229,808.00	73,843,956.01
本期申购	23,000,000.00	8,398,420.59
本期赎回（以“-”号填列）	-65,500,000.00	-23,917,241.20
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	159,729,808.00	58,325,135.40

#### 6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	98,496,132.48	-17,424,130.11	81,072,002.37
本期期初	98,496,132.48	-17,424,130.11	81,072,002.37
本期利润	-3,002,942.39	20,878,166.43	17,875,224.04

本期基金份额交易产生的变动数	-20,367,863.21	1,958,465.62	-18,409,397.59
其中：基金申购款	10,942,479.26	-312,587.04	10,629,892.22
金赎回款	-31,310,342.47	2,271,052.66	-29,039,289.81
本期已分配利润	-	-	-
本期末	75,125,326.88	5,412,501.94	80,537,828.82

#### 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	1,831.43
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	100.53
其他	3.85
合计	1,935.81

#### 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

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-2,086,627.59
股票投资收益——赎回差价收入	-1,652,851.41
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-3,739,479.00

#### 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	12,173,721.85
减：卖出股票成本总额	14,229,601.18
减：交易费用	30,748.26
买卖股票差价收入	-2,086,627.59

#### 6.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
赎回基金份额对价总额	52,956,531.01
减：现金支付赎回款总额	14,315.01
减：赎回股票成本总额	54,595,067.41
减：交易费用	-
赎回差价收入	-1,652,851.41

#### 6.4.7.10.4 股票投资收益——申购差价收入

无

#### 6.4.7.10.5 股票投资收益——证券出借差价收入

无

#### 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

无

##### 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

无

##### 6.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入

无

#### 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

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

无

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	1,306,517.12
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,306,517.12

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	20,878,166.43
股票投资	20,878,166.43
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	20,878,166.43

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	-
替代损益	280.00
合计	280.00

注：替代损益是指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，补入被替代股票的实际买入成本与申购确认日估值的差额，或强制退款的被替代股票在强制退款计算日与申购确认日估值的差额。



#### 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	21,880.04
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行费用	192.00
指数使用费	70,000.00
合计	151,744.38

#### 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
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	基金托管人
华宝信托有限责任公司(“华宝信托”)	基金管理人的股东
华平资产管理有限合伙(Warburg Pincus Asset Management. L.P.)	基金管理人的股东
江苏省铁路集团有限公司(“江苏铁集”)	基金管理人的股东
中国宝武钢铁集团有限公司(“宝武集团”)	华宝信托的最终控制人
华宝证券股份有限公司(“华宝证券”)	受宝武集团控制的公司, 基金销售机构
华宝投资有限公司(“华宝投资”)	受宝武集团控制的公司
宝武集团财务有限责任公司(“宝武财务”)	受宝武集团控制的公司
华宝上证 180 价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金(“华宝上证 180 价值 ETF 联接”)	本基金的基金管理人管理的其他基金

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行交易。

6.4.10.1.2 债券交易

无

6.4.10.1.3 债券回购交易

无

6.4.10.1.4 权证交易

无

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无

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1月1日至2023年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	350,376.57	328,437.65
其中：应支付销售机构的客户维护费	-	-
应支付基金管理人的净管理费	350,376.57	328,437.65

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 0.50%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	70,075.37	65,687.55

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 0.10%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

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

### 6.4.10.3 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

本报告期内及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2024年6月30日		上年度末 2023年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例（%）	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例（%）
中国工商银行—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	98,068,064.00	61.40	100,924,264.00	49.91

### 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1月1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
中国工商银行	1,889,515.20	1,831.43	3,856,370.13	2,287.87

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期末投资于基金托管人中国工商银行发行的股票——工商银行（证券代码：601398）980,000 股，期末公允价值为人民币 4,801,735.78 元，占本基金期末基金资产净值比例为 3.46%。（上年度末：持有 1,189,500.00 股，期末公允价值为人民币 5,685,810.00 元，占本基金期末基金资产净值比例为 3.67%。）

除以上情况外，无其他需要说明的关联方交易事项。

#### 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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
603325	博隆技术	2024 年 1 月 3 日	6 个月	新股锁定	72.46	68.06	20	1,449.20	1,361.20	-
603341	龙旗科技	2024 年 2 月 23 日	6 个月	新股锁定	26.00	37.49	70	1,820.00	2,624.30	-
603350	安乃达	2024 年 6 月 26 日	6 个月	新股锁定	20.56	20.56	64	1,315.84	1,315.84	-
603350	安乃达	2024 年 6 月 26 日	1 个月内（含）	新股流通受限	20.56	20.56	576	11,842.56	11,842.56	-
603381	永臻股份	2024 年 6 月 19 日	6 个月	新股锁定	23.35	25.13	52	1,214.20	1,306.76	-

注：1. 根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票

上市之日起 6 个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

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

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

#### **6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### **6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**

##### **6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

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

##### **6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购**

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

#### **6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券**

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

#### **6.4.13 金融工具风险及管理**

##### **6.4.13.1 风险管理政策和组织架构**

本基金为 ETF 基金，采用完全复制策略，跟踪上证 180 价值指数。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与跟踪指数相同的风险收益目标。本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，公司内部监督和反馈系统包括内部控制委员会、督察长、合规审计部、风险管理部、各部门负责人和风险控制联络人、各业务岗位。内部控制委员会负责对公司经营管理及基金运作中的风险进行评估并研究制订相应的控制制度。督察长向董事会负责，总管公司的内控事务并独立地就内控制度的执行情况履行检查、评价、报告和建议职能。风险管理部在督察长指导下对公司内部控制运行情况进行监控，主要针对公司内部控制制度的总体构架和内部控制

的目标进行评估并提出改进意见；合规审计部在督察长的领导下对各部门和岗位的内部控制执行情况进行监督和核查，同时对内控的失控点进行查漏并责令改正。

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

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

#### 6.4.13.2 信用风险

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

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

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

于本报告期末，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券和资产支持证券占基金净资产的比例较低（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来自调整基金投资组合时，由于部分成份股流动性差，导致本基金难以及时完成组合调整，或承受较大市场冲击成本，从而造成基金投资组合收益偏离标的指数收益的风险。于本报告期末，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上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制）。

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

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

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

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

### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的

变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或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	1,889,515.20	-	-	-	1,889,515.20
存出保证金	335.13	-	-	-	335.13
交易性金融资产	-	-	-	137,181,022.54	137,181,022.54
应收清算款	-	-	-	75.99	75.99
资产总计	1,889,850.33	-	-	137,181,098.53	139,070,948.86
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	56,915.67	56,915.67
应付托管费	-	-	-	11,383.13	11,383.13
应交税费	-	-	-	88.41	88.41
其他负债	-	-	-	139,597.43	139,597.43
负债总计	-	-	-	207,984.64	207,984.64
利率敏感度缺口	1,889,850.33	-	-	-136,973,113.89	138,862,964.22
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	1,327,170.65	-	-	-	1,327,170.65
存出保证金	1,096.74	-	-	-	1,096.74
交易性金融资产	-	-	-	153,916,585.26	153,916,585.26
应收清算款	-	-	-	3,909.23	3,909.23
资产总计	1,328,267.39	-	-	153,920,494.49	155,248,761.88
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	62,935.72	62,935.72
应付托管费	-	-	-	12,587.14	12,587.14
应付清算款	-	-	-	53.96	53.96



应交税费	-	-	-	88.41	88.41
其他负债	-	-	-	257,138.27	257,138.27
负债总计	-	-	-	332,803.50	332,803.50
利率敏感度缺口	1,328,267.39	-	-	-153,587,690.99	154,915,958.38

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，以复制、跟踪 180 价值指数的方法为原则，根据标的指数成份股票在指数中的权重确定成份股票的买卖数量，并根据标的指数成份及其权重的变动进行相应调整。在因特殊情况（如成份股停牌、流动性不足、法规法律限制等）导致无法获得足够数量的股票时，本基金可以根据市场情况，结合经验判断，综合考虑相关性、估值、流动性等因素挑选标的指数中其他成份股或备选成份股进行替代（同行业股票优先考虑），以期在规定的风险承受限度之内，尽量缩小跟踪误差。

本基金采用完全复制法进行指数化投资，股票资产跟踪的标的指数为 180 价值指数，通过指数化分散投资降低其他价格风险。本基金投资于上证 180 价值指数的成份股和备选成份股的资产比例不低于该基金资产净值的 95%，同时为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于新股、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，该部分资产比例不高于基金资产净值的 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	137,181,022.54	98.79	153,916,585.26	99.35
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	137,181,022.54	98.79	153,916,585.26	99.35

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（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）
	业绩比较基准上升5%	6,858,002.12	7,598,786.23
	业绩比较基准下降5%	-6,858,002.12	-7,598,786.23

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	137,162,571.88	153,904,637.86
第二层次	13,158.40	-
第三层次	5,292.26	11,947.40
合计	137,181,022.54	153,916,585.26

#### 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	137,181,022.54	98.64
	其中：股票	137,181,022.54	98.64
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	1,889,515.20	1.36
8	其他各项资产	411.12	0.00
9	合计	139,070,948.86	100.00

注：1、此处股票投资项含可退替代款估值增值，而 7.2 的合计项不含可退替代款估值增值，两者在金额上可能不相等。

2、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 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

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	16,371,464.50	11.79
C	制造业	14,340,232.81	10.33
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,955,553.00	3.57
E	建筑业	9,719,772.94	7.00
F	批发和零售业	590,499.00	0.43
G	交通运输、仓储和邮政业	5,284,217.10	3.81
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,885,510.50	5.68

J	金融业	76,267,053.79	54.92
K	房地产业	1,748,268.24	1.26
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	137,162,571.88	98.78

### 7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

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	-	-
C	制造业	18,450.66	0.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-

S	综合	-	-
	合计	18,450.66	0.01

### 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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	301,006	12,449,608.16	8.97
2	600036	招商银行	346,058	11,831,723.02	8.52
3	601166	兴业银行	406,552	7,163,446.24	5.16
4	601328	交通银行	768,300	5,739,201.00	4.13
5	601398	工商银行	980,000	5,586,000.00	4.02
6	601088	中国神华	92,200	4,090,914.00	2.95
7	601288	农业银行	892,624	3,891,840.64	2.80
8	601857	中国石油	316,900	3,270,408.00	2.36
9	601668	中国建筑	581,978	3,090,303.18	2.23
10	600919	江苏银行	410,480	3,049,866.40	2.20
11	601985	中国核电	264,100	2,815,306.00	2.03
12	601225	陕西煤业	108,500	2,796,045.00	2.01
13	601919	中远海控	178,290	2,761,712.10	1.99
14	601988	中国银行	589,254	2,722,353.48	1.96
15	600941	中国移动	25,200	2,709,000.00	1.95
16	600000	浦发银行	328,300	2,701,909.00	1.95
17	601728	中国电信	434,070	2,669,530.50	1.92
18	601601	中国太保	95,704	2,666,313.44	1.92
19	600028	中国石化	408,300	2,580,456.00	1.86
20	601766	中国中车	337,800	2,536,878.00	1.83
21	600050	中国联通	533,400	2,506,980.00	1.81
22	601169	北京银行	411,101	2,400,829.84	1.73
23	600016	民生银行	594,900	2,254,671.00	1.62
24	600089	特变电工	140,434	1,947,819.58	1.40
25	600938	中国海油	58,500	1,930,500.00	1.39
26	601390	中国中铁	285,300	1,860,156.00	1.34
27	600104	上汽集团	128,635	1,782,881.10	1.28
28	601688	华泰证券	142,000	1,759,380.00	1.27
29	601006	大秦铁路	245,500	1,757,780.00	1.27
30	600048	保利发展	199,574	1,748,268.24	1.26
31	601211	国泰君安	125,200	1,696,460.00	1.22
32	601818	光大银行	518,951	1,645,074.67	1.18
33	600019	宝钢股份	245,700	1,633,905.00	1.18

34	600585	海螺水泥	66,715	1,573,806.85	1.13
35	601658	邮储银行	308,200	1,562,574.00	1.13
36	600795	国电电力	247,700	1,483,723.00	1.07
37	601628	中国人寿	46,400	1,440,720.00	1.04
38	600438	通威股份	75,100	1,435,161.00	1.03
39	600999	招商证券	103,150	1,434,816.50	1.03
40	601939	建设银行	186,496	1,380,070.40	0.99
41	601669	中国电建	239,200	1,337,128.00	0.96
42	601916	浙商银行	421,800	1,164,168.00	0.84
43	601186	中国铁建	127,768	1,094,971.76	0.79
44	601800	中国交建	98,900	884,166.00	0.64
45	600188	兖矿能源	38,050	864,876.50	0.62
46	601168	西部矿业	46,700	838,265.00	0.60
47	601117	中国化学	101,700	838,008.00	0.60
48	601872	招商轮船	90,500	764,725.00	0.55
49	600176	中国巨石	66,700	737,035.00	0.53
50	601336	新华保险	23,100	693,693.00	0.50
51	600096	云天化	35,700	693,294.00	0.50
52	600362	江西铜业	29,000	686,720.00	0.49
53	600027	华电国际	94,600	656,524.00	0.47
54	601618	中国中冶	198,400	615,040.00	0.44
55	601607	上海医药	30,900	590,499.00	0.43
56	601998	中信银行	85,900	575,530.00	0.41
57	600332	白云山	19,600	574,868.00	0.41
58	688599	天合光能	30,659	518,750.28	0.37
59	601319	中国人保	88,700	456,805.00	0.33
60	603688	石英股份	7,400	219,114.00	0.16

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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	603350	安乃达	640	13,158.40	0.01
2	603341	龙旗科技	70	2,624.30	0.00
3	603325	博隆技术	20	1,361.20	0.00
4	603381	永臻股份	52	1,306.76	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	601006	大秦铁路	1,784,061.00	1.15
2	601916	浙商银行	1,215,832.00	0.78
3	601168	西部矿业	839,815.00	0.54

4	601998	中信银行	775,320.00	0.50
5	600362	江西铜业	712,959.00	0.46
6	601318	中国平安	645,454.00	0.42
7	688599	天合光能	636,838.61	0.41
8	600036	招商银行	598,383.00	0.39
9	601166	兴业银行	361,886.00	0.23
10	601398	工商银行	276,147.00	0.18
11	603688	石英股份	274,792.50	0.18
12	601328	交通银行	271,466.00	0.18
13	600941	中国移动	263,207.00	0.17
14	601088	中国神华	236,318.00	0.15
15	601288	农业银行	169,574.00	0.11
16	601857	中国石油	162,688.00	0.11
17	601988	中国银行	155,181.00	0.10
18	601225	陕西煤业	151,409.00	0.10
19	601601	中国太保	140,026.00	0.09
20	601985	中国核电	136,874.00	0.09

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	600030	中信证券	4,876,653.55	3.15
2	600837	海通证券	2,198,381.00	1.42
3	601377	兴业证券	966,932.40	0.62
4	601998	中信银行	626,962.00	0.40
5	600028	中国石化	618,332.00	0.40
6	601881	中国银河	617,489.00	0.40
7	600919	江苏银行	610,898.00	0.39
8	688303	大全能源	508,565.00	0.33
9	600016	民生银行	259,376.00	0.17
10	601155	新城控股	220,594.00	0.14
11	600036	招商银行	181,980.00	0.12
12	601318	中国平安	102,466.00	0.07
13	601166	兴业银行	77,808.00	0.05
14	601628	中国人寿	75,928.00	0.05
15	601225	陕西煤业	62,622.00	0.04
16	601328	交通银行	47,610.00	0.03
17	601398	工商银行	47,260.00	0.03
18	603341	龙旗科技	32,722.20	0.02
19	603381	永臻股份	16,918.74	0.01
20	603325	博隆技术	15,995.08	0.01



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	12,301,010.44
卖出股票收入（成交）总额	12,173,721.85

注：买入股票成本、卖出股票收入均不包括相关交易费用。

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券投资。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

### 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金未投资股指期货。

### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金未投资国债期货。

#### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

### 7.12 投资组合报告附注

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

上证 180 价值 ETF 截止 2024 年 06 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中，江苏银行股份有限公司因报送的互联网保险业务数据不真实，未按规定披露互联网保险信息；于 2023 年 08 月 10 日收到国家金融监督管理总局江苏监管局警告，罚款的处罚措施。

上证 180 价值 ETF 截止 2024 年 06 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中，中国农业银行股份

有限公司因：一、农户贷款发放后流入房地产企业二、农村个人生产经营贷款贷后管理不到位三、农户小额贷款发放后转为定期存款四、违规向房地产开发企业提供融资五、违规发放流动资金贷款六、装修贷款发放不审慎七、商业用房贷款发放不审慎八、违规向关系人发放信用贷款九、贷款风险分类不准确导致不良率失实十、违规发放固定资产贷款十一、对不具备法人资格的分支公司客户单独办理授信十二、集团客户统一授信管理不到位十三、贷款回流用于归还本行贷款十四、贷款回流用于缴纳银承保证金十五、贷款回流用于转存定期存款十六、贴现资金回流出票人十七、信贷资金流入证券账户十八、贷后管理不尽责导致信贷资金实质被关联企业占用十九、扶贫小额贷款贷户贷企用；于 2023 年 08 月 15 日收到国家金融监督管理总局罚款, 没收违法所得的处罚措施。

上证 180 价值 ETF 截止 2024 年 06 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中, 中国农业银行股份有限公司因：一、流动资金贷款被用于固定资产投资二、贷款受托支付问题整改不到位三、贷款风险分类不准确四、个别精准扶贫贷款被挪用五、不良资产转让流程问题整改不到位六、小微企业划型不准确七、贷款资金转存银承汇票保证金问题整改不到位八、个人贷款违规流入房地产市场问题整改不到位九、审计人员配备不足问题未整改十、非现场数据报送不准确, 整改不到位十一、人员内部问责不到位十二、向关系人发放信用贷款十三、个人贷款管理不到位, 部分贷款资金被挪用；于 2023 年 11 月 16 日收到国家金融监督管理总局罚款, 没收违法所得的处罚措施。

上证 180 价值 ETF 截止 2024 年 06 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中, 中国农业银行股份有限公司因：1. 办理经常项目资金收付, 未对交易单证的真实性及其与外汇收支的一致性进行合理审查 2. 违反规定办理资本项目资金收付 3. 违反规定办理结汇、售汇业务 4. 未按照规定报送财务会计报告、统计报表等资料；于 2023 年 11 月 17 日收到国家外汇管理局北京市分局警告, 罚款, 没收违法所得的处罚措施。

上证 180 价值 ETF 截止 2024 年 06 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中, 招商银行股份有限公司因办理经常项目资金收付, 未对交易单证的真实性及其与外汇收支的一致性进行合理审查行为、违反规定办理结汇、售汇业务行为、违反规定办理资本项目资金收付行为；于 2023 年 11 月 27 日收到国家外汇管理局深圳市分局警告, 罚款, 没收违法所得的处罚措施。

上证 180 价值 ETF 截止 2024 年 06 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中, 招商银行股份有限公司因违规经营, 涉嫌违反法律法规, 违反结汇、售汇及付汇管理规定；于 2023 年 11 月 27 日收到

国家外汇管理局深圳市分局警告, 罚款, 没收违法所得的处罚措施。

上证 180 价值 ETF 截止 2024 年 06 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中, 交通银行股份有限公司因一、安全测试存在薄弱环节二、运行管理存在漏洞三、数据安全管理制度不足四、灾备管理不足; 于 2024 年 06 月 03 日收到国家金融监督管理总局罚款的处罚措施。

上证 180 价值 ETF 截止 2024 年 06 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中, 招商银行股份有限公司因招商银行理财业务存在以下违法违规行为: 一、未能有效穿透识别底层资产二、信息披露不规范; 于 2024 年 06 月 24 日收到国家金融监督管理总局罚款的处罚措施。

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

### 7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位: 人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	335.13
2	应收清算款	75.99
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	411.12

### 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

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	603350	安乃达	13,158.40	0.01	新股流通受限
2	603341	龙旗科技	2,624.30	0.00	新股锁定
3	603325	博隆技术	1,361.20	0.00	新股锁定
4	603381	永臻股份	1,306.76	0.00	新股锁定

### 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

#### 8.1.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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 (%)
1,678	95,190.59	108,747,770.00	68.08	50,982,038.00	31.92

#### 8.1.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

项目	持有份额 (份)	占总份额比例 (%)
中国工商银行—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	98,068,064.00	61.40

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	广发证券股份有限公司	6,180,784.00	3.87
2	中国国际金融股份有限公司	2,170,380.00	1.36
3	汤峰	1,944,800.00	1.22
4	聂秀梅	1,434,888.00	0.90
5	白红霞	1,358,352.00	0.85

6	岳韧锋	1,329,752.00	0.83
7	谢凡	1,267,400.00	0.79
8	胡煜军	1,050,000.00	0.66
9	朱铭	788,700.00	0.49
10	赵燕军	780,000.00	0.49
11	中国工商银行—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	98,068,064.00	61.40

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	0.00	0.0000

### 8.4 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	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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2010 年 4 月 23 日） 基金份额总额	2,109,182,935.00
本报告期期初基金份额总额	202,229,808.00
本报告期基金总申购份额	23,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	65,500,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	159,729,808.00

## § 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、基金财产和基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未发生变更。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

基金管理人为本基金聘任的会计师事务所向本基金提供的审计服务持续期限为：2019 年 11 月 20 日起至本报告期末。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚的情况。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
申万宏源	1	24,417,094.96	100.00	23,096.28	100.00	-
光大证券	1	-	-	-	-	-

注：1. 基金管理人选择交易单元的标准和程序如下：

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

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

2. 本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	华宝基金关于旗下部分交易型开放式指数证券投资基金新增华源证券股份有限公司为一级交易商的公告	基金管理人网站, 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2024-03-18
3	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
4	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
5	上证 180 价值交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要(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(%)
中国工商银行股份有限公司-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	1	20240101~20240630	100,924,264.00	2,000,000.00	4,856,200.00	98,068,064.00	61.40

#### 产品特有风险

报告期内本基金出现单一投资者持有基金份额比例超过 20%的情况。在单一投资者持有基金份额比例较高的情况下,如该投资者集中赎回,可能会增加基金的流动性风险。此外,由于基金在遇到大额赎回的时候可能需要变现部分资产,可能对持有资产的价格形成冲击,增加基金的市场风险。基金管理人将专业审慎、勤勉尽责地运作基金资产,加强防范流

动性风险、市场风险，保护持有人利益。

## 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

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；  
上证 180 价值交易型开放式指数证券投资基金基金合同；  
上证 180 价值交易型开放式指数证券投资基金招募说明书；  
上证 180 价值交易型开放式指数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