

华宝标普香港上市中国中小盘指数证券投资 基金(LOF) 2020 年中期报告

2020 年 6 月 30 日

基金管理人：华宝基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2020 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 8 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自 2020 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 境外投资顾问和境外资产托管人	6
2.5 信息披露方式	7
2.6 其他相关资料	7
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 其他指标	错误!未定义书签。
§ 4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介	12
4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	13
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	16
§ 5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	16
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	16
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	17
6.1 资产负债表	17
6.2 利润表	18
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	19
6.4 报表附注	21
§ 7 投资组合报告	46
7.1 期末基金资产组合情况	46
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布	46

7.3 期末按行业分类的权益投资组合	错误!未定义书签。
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细	错误!未定义书签。
7.5 报告期内权益投资组合的重大变动	72
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合	75
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细	75
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细	75
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细	75
7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细	75
7.11 投资组合报告附注	75
§ 8 基金份额持有人信息	76
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	76
8.2 期末上市基金前十名持有人	77
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	77
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	77
§ 9 开放式基金份额变动	78
§ 10 重大事件揭示	78
10.1 基金份额持有人大会决议	78
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	78
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	78
10.4 基金投资策略的改变	79
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	79
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	79
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	79
10.8 其他重大事件	81
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	82
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	82
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	83
§ 12 备查文件目录	83
12.1 备查文件目录	83
12.2 存放地点	83
12.3 查阅方式	83

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华宝标普香港上市中国中小盘指数证券投资基金 (LOF)	
基金简称	华宝标普香港上市中国中小盘指数 (LOF)	
场内简称	香港中小 LOF	
基金主代码	501021	
基金运作方式	上市契约型开放式 (LOF)	
基金合同生效日	2016 年 6 月 24 日	
基金管理人	华宝基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,116,315,172.59 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	2016 年 7 月 6 日	
下属分级基金的基金简称	香港中小 LOF	华宝香港中小 C
下属分级基金的场内简称	香港中小 LOF	-
下属分级基金的交易代码	501021	006127
报告期末下属分级基金的份额总额	1,102,034,244.69 份	14,280,927.90 份

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最小化。正常情况下，本基金力争控制净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 5%。
投资策略	本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好的跟踪标的指数，实现基金投资目标。1、组合复制策略本基金主要采取复制法，即按照标的指数成份股及其权重构建基金的股票投资组合，并

	<p>根据标的指数成份股及其权重的变动对股票投资组合进行相应地调整。2、替代性策略对于出现市场流动性不足、因法律法规原因个别成份股被限制投资等情况，导致本基金无法获得足够数量的股票时，基金管理人将通过投资成份股、非成份股、成份股个股衍生品等进行替代。3、股指期货投资策略本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，以降低股票仓位调整的交易成本，提高投资效率，从而更好地跟踪标的指数，实现投资目标。本基金基于流动性管理及策略性投资的需要，将适当投资于债券和货币市场工具，固定收益投资的目的是在保证基金资产流动性的同时有效利用基金资产，提高基金资产的投资收益。同时，为更好地实现本基金的投资目标，本基金还将在条件允许的情况下，开展证券借贷业务以及投资于金融衍生品，以期降低跟踪误差水平。本基金投资于金融衍生品的目标是替代跟踪标的指数的成份股，使基金的投资组合更紧密地跟踪标的指数。不得应用于投机交易目的，或用作杠杆工具放大基金的投资。</p>
业绩比较基准	经人民币汇率调整的标普香港上市中国中小盘指数收益率×95%+人民币活期存款利率（税后）×5%。
风险收益特征	本基金为股票型基金，预期风险与预期收益水平高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数基金，跟踪标的指数的表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华宝基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	周雷	李申
	联系电话	021-38505888	021-60637102
	电子邮箱	xxpl@fsfund.com	lishen.zh@ccb.com
客户服务电话		400-700-5588、400-820-5050、 021-38924558	021-60637111
传真		021-38505777	021-60635778
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		200120	100033
法定代表人		孔祥清	田国立

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	-	State Street Bank and Trust Company

	中文	-	美国道富银行有限公司
注册地址		-	One Lincoln Street, Boston, Massachusetts 02111, United States
办公地址		-	One Lincoln Street, Boston, Massachusetts 02111, United States
邮政编码		-	02111

2.5 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

2.6 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 基金管理人	北京市西城区太平桥大街 17 号 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(2020年1月1日-2020年6月30日)	
	香港中小	华宝香港中小 C
本期已实现收益	52,390,327.22	926,387.96
本期利润	-22,332,885.99	1,325,466.14
加权平均基金份额本期利润	-0.0185	0.0583
本期加权平均净值利润率	-1.29%	4.14%
本期基金份额净值增长率	-2.65%	-2.78%

3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020年6月30日)	
期末可供分配利润	316,195,969.12	6,832,533.29
期末可供分配基金份额利润	0.2869	0.4784
期末基金资产净值	1,639,374,366.84	21,113,461.19
期末基金份额净值	1.4876	1.4784
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	48.76%	1.43%

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

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

香港中小

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	7.42%	1.24%	6.66%	1.25%	0.76%	-0.01%
过去三个月	12.59%	1.38%	11.85%	1.38%	0.74%	0.00%
过去六个月	-2.65%	1.98%	-3.05%	2.01%	0.40%	-0.03%
过去一年	10.17%	1.53%	9.66%	1.55%	0.51%	-0.02%
过去三年	23.06%	1.40%	19.92%	1.42%	3.14%	-0.02%
自基金合同生效起至	48.76%	1.27%	52.54%	1.29%	-3.78%	-0.02%

华宝香港中小 C

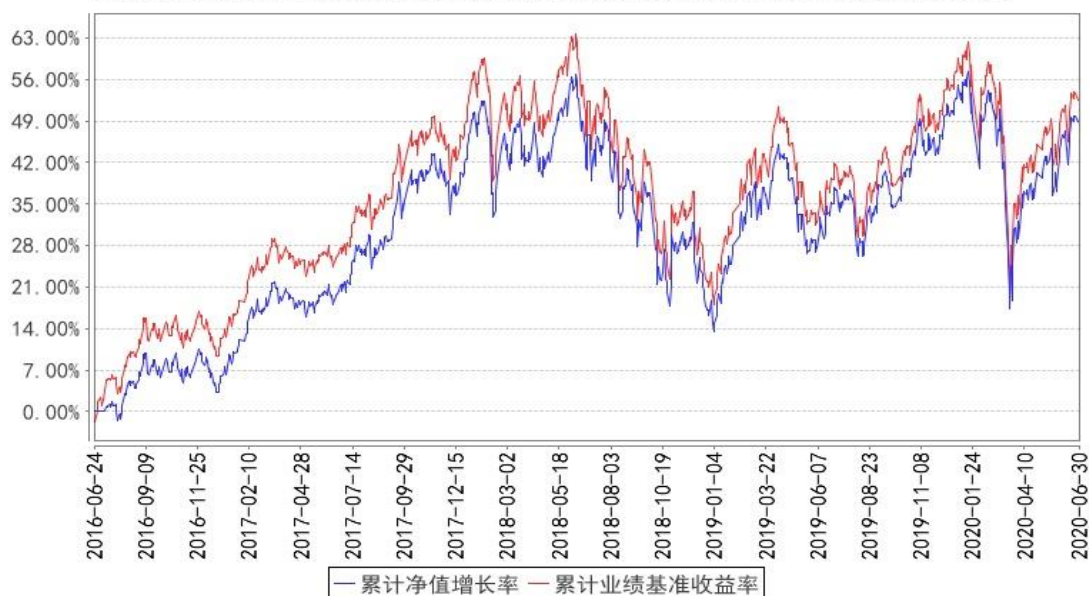
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	7.39%	1.24%	6.66%	1.25%	0.73%	-0.01%
过去三个月	12.47%	1.38%	11.85%	1.38%	0.62%	0.00%
过去六个月	-2.78%	1.98%	-3.05%	2.01%	0.27%	-0.03%
过去一年	9.84%	1.52%	9.66%	1.55%	0.18%	-0.03%
过去三年	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
自基金合同生效起至	1.43%	1.49%	-0.13%	1.51%	1.56%	-0.02%

注：1、本基金业绩比较基准为：经人民币汇率调整的标普香港上市中国中小盘指数收益率×95%+人民币活期存款利率（税后）×5%。

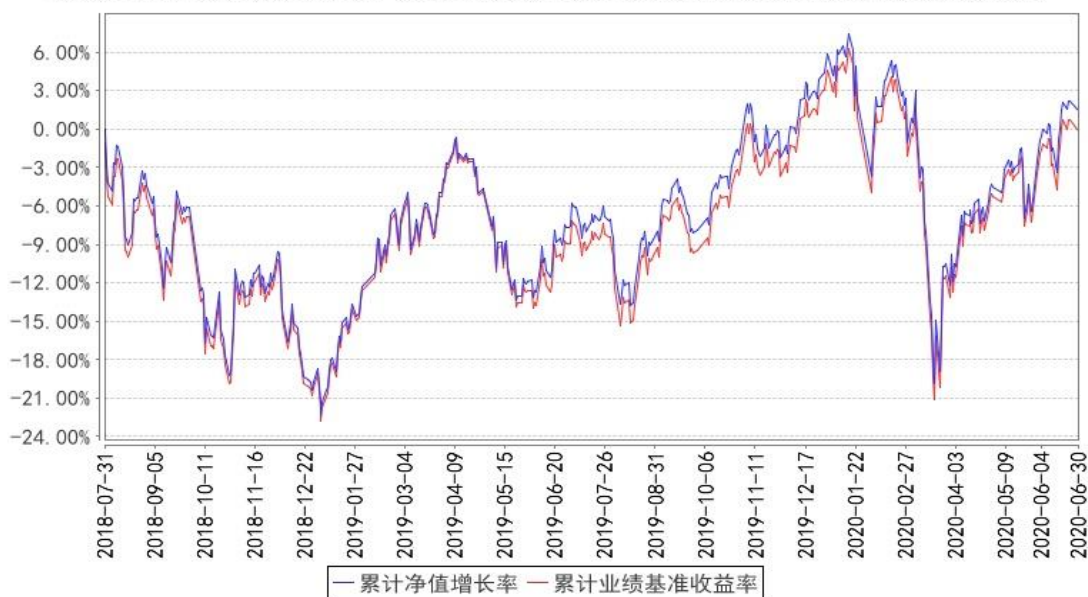
2、净值以及比较基准相关数据计算中涉及天数的，包括所有交易日以及季末最后一自然日（如非交易日）。

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

香港中小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



华宝香港中小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六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 2016 年 12 月 24 日，本基金已达到合同规定的资产配置比例。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

基金管理人是在 2003 年 3 月 7 日正式成立的合资基金管理公司，截至本报告期末（2020 年 6 月 30 日），正在管理运作的证券投资基金分别为：华宝宝康债券投资基金、华宝宝康消费品证券投资基金、华宝宝康灵活配置证券投资基金、华宝多策略增长开放式证券投资基金、华宝现金宝货币市场基金、华宝动力组合混合型证券投资基金、华宝收益增长混合型证券投资基金、华宝先进成长混合型证券投资基金、华宝行业精选混合型证券投资基金、华宝海外中国成长混合型证券投资基金、华宝大盘精选混合型证券投资基金、华宝增强收益债券型证券投资基金、华宝中证 100 指数证券投资基金、华宝上证 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 价值交易型开放式指数证券投资基金、华宝新兴产业混合型证券投资基金、华宝可转债债券型证券投资基金、华宝中证银行交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华宝标普石油天然气上游股票指数证券投资基金 (LOF)、华宝医药生物优选混合型证券投资基金、华宝资源优选混合型证券投资基金、华宝现金添益交易型货币市场基金、华宝服务优选混合型证券投资基金、华宝创新优选混合型证券投资基金、华宝生态中国混合型证券投资基金、华宝量化对冲策略混合型发起式证

券投资基金、华宝高端制造股票型证券投资基金、华宝品质生活股票型证券投资基金、华宝稳健回报灵活配置混合型证券投资基金、华宝事件驱动混合型证券投资基金、华宝国策导向混合型证券投资基金、华宝中证医疗指数分级证券投资基金、华宝新价值灵活配置混合型证券投资基金、华宝中证 1000 指数分级证券投资基金、华宝新机遇灵活配置混合型证券投资基金(LOF)、华宝万物互联灵活配置混合型证券投资基金、华宝转型升级灵活配置混合型证券投资基金、华宝核心优势灵活配置混合型证券投资基金、华宝标普美国品质消费股票指数证券投资基金(LOF)、华宝标普香港上市中国中小盘指数证券投资基金(LOF)、华宝中证军工交易型开放式指数证券投资基金、华宝中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金、华宝新活力灵活配置混合型证券投资基金、华宝未来主导产业灵活配置混合型证券投资基金、华宝沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金、华宝新起点灵活配置混合型证券投资基金、华宝标普中国 A 股红利机会指数证券投资基金(LOF)、华宝新飞跃灵活配置混合型证券投资基金、华宝新优选一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、华宝港股通恒生中国(香港上市)25 指数证券投资基金(LOF)、华宝智慧产业灵活配置混合型证券投资基金、华宝第三产业灵活配置混合型证券投资基金、华宝中证银行交易型开放式指数证券投资基金、华宝价值发现混合型证券投资基金、华宝港股通恒生香港 35 指数证券投资基金(LOF)、华宝中证 500 指数增强型发起式证券投资基金、华宝港股通香港精选混合型证券投资基金、华宝中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、华宝宝丰高等级债券型发起式证券投资基金、华宝绿色主题混合型证券投资基金、华宝标普沪港深中国增强价值指数证券投资基金(LOF)、华宝标普中国 A 股质量价值指数证券投资基金(LOF)、华宝科技先锋混合型证券投资基金、华宝大健康混合型证券投资基金、华宝中短债债券型发起式证券投资基金、华宝宝裕纯债债券型证券投资基金、华宝稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、华宝中证医疗交易型开放式指数证券投资基金、华宝宝盛纯债债券型证券投资基金、华宝消费升级混合型证券投资基金、华宝宝怡纯债债券型证券投资基金、华宝中证科技龙头交易型开放式指数证券投资基金、华宝 MSCI 中国 A 股国际通 ESG 通用指数证券投资基金（LOF）、华宝中证科技龙头交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、华宝浮动净值型发起式货币市场基金、华宝政策性金融债债券型证券投资基金、华宝绿色领先股票型证券投资基金、华宝宝润纯债债券型证券投资基金、华宝致远混合型证券投资基金（QDII）、华宝宝惠纯债 39 个月定期开放债券型证券投资基金、华宝中证消费龙头指数证券投资基金（LOF）、华宝成长策略混合型证券投资基金、华宝红利精选混合型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限	证券从业年限	说明
----	----	-----------------	--------	----

		任职日期	离任日期		
周晶	公司总经理助理/国际业务部总经理、本基金基金经理、华宝油气、美国消费、华宝港股通恒生中国（香港上市）25 指数（场内简称“香港大盘”）、华宝港股通恒生香港 35 指数（场内简称“香港本地”）、华宝标普沪港深中国增强价值指数（场内简称“价值基金”）、华宝致远混合基金经理	2016 年 6 月 24 日	-	15	博士。先后在美国德州奥斯丁市德亚资本、泛太平洋证券（美国）和汇丰证券（美国）从事数量分析、另类投资分析和证券投资研究工作。2005 年至 2007 年任华宝基金管理有限公司内控审计风险管理部主管。2011 年再次加入华宝基金管理有限公司，现任公司总经理助理/国际业务部总经理/首席策略分析师。2013 年 6 月至 2015 年 11 月任华宝成熟市场动量优选证券投资基金基金经理。2014 年 9 月起任华宝标普石油天然气上游股票指数证券投资基金（LOF）基金经理。2015 年 9 月至 2017 年 8 月任华宝中国互联网股票型证券投资基金基金经理。2016 年 3 月起任华宝标普美国品质消费股票指数证券投资基金（LOF）基金经理。2016 年 6 月起任华宝标普香港上市中国中小盘指数证券投资基金（LOF）基金经理。2017 年 4 月起任华宝港股通恒生中国（香港上市）25 指数证券投资基金（LOF）基金经理。2018 年 3 月起任华宝港股通恒生香港 35 指数证券投资基金（LOF）基金经理。2018 年 10 月起任华宝标普沪港深中国增强价值指数证券投资基金（LOF）基金经理。2019 年 11 月起任华宝致远混合型证券投资基金（QDII）基金经理。

注：1、任职日期以及离任日期均以基金公告为准。

2、证券从业含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.3 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 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

-

4.3 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》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》及其各项实施细则、《华宝标普香港上市中国中小盘指数证券投资基金(LOF)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。

4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.4.1 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。

4.4.2 异常交易行为的专项说明

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

本报告期内，本基金未发现异常交易行为。

4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金采用全复制方法跟踪标普香港上市中国中小盘指数，基金仓位一直保持在比较高的位置。2020 年上半年是全球资本市场剧烈波动的半年。新年伊始，出于对中美达成第一阶段贸易协议后经济发展的乐观预期，港股延续了去年 12 月以来的上涨趋势。但步入一月下旬，中国确认 COVID-19 病毒开始蔓延，市场开始调整。此后，由于中国政府在第一时间采取紧急有效的应对措施，境内病毒蔓延态势得到有效控制。A 股在春节开盘后低开高走，带动港股也跟随反弹。然而，

进入二月下旬之后，由于前期境外政府管控措施的拖沓，海外 COVID-19 新冠病毒开始爆发。而此后 OPEC+ 谈判失败，油价暴跌，海外高收益债市场收益率飙升，并导致整个海外信用市场出现短期流动性危机，这样造成美欧美股市发生了自 08 年以来最大幅度的暴跌，港股也被拖累大幅度下挫。面对不利形势，美联储迅速降息到零，并在三月二十三日启动无限量 QE，一定程度上缓解了流动性危机，股市随之开始反弹。步入四月份之后，随着中国抗击疫情取得了明显成效，中国经济在全球率先重启，A 股和港股都开始稳步反弹。四月底之后，随着欧美疫情得到一定程度控制，欧美经济开始重启，美股开始加速上涨，这进一步推动了港股的反弹。但是五月底香港政坛不确定性短期上升，此外五月下旬之后美国疫情感染数字再度反弹，市场担心疫情在欧美二次爆发，港股因此短期下挫。此后随着中国经济逐季改善，经济复苏势头确认，而海外股市基本未受疫情数字影响继续延续反弹趋势，港股再度上扬。在板块表现上，消费和科技等远期向好且近期基本面持续改善的“新经济”板块表现更佳。截止 2020/6/30，标普香港中小盘指数收 3121.87，跌幅 5.22%。恒生指数 20 年上半年下跌 13.35%。标的指数的跌幅显著低于恒生指数的跌幅，主要原因在于指数内部例如信息科技、医疗医药、物业服务、游戏传媒等新经济板块，表现优异。指数年化日均波幅 32.46%，恒生指数 28.1%，波动率较恒生指数波动率略高。

日常操作过程中，人民币汇率方面，2020 年上半年人民币汇率呈现贬值趋势。人行港币中间价从 0.8958 贬值至 0.9134，相对于港币贬值 1.97%。同期，人民币交易价也相对于港币贬值 2.02% 左右。基金在仓位控制上一直比较谨慎，尽可能使得基金的业绩表现能够和业绩比较基准贴近。2020 上半年，香港中小基金年化跟踪误差（剔除汇率因素）约为 1%。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本报告期基金份额 A 净值收益率为-2.65%，基金份额 C 净值收益率为-2.78%，同期业绩比较基准收益率为-3.05%。基金表现略高于业绩比较基准，高于基准的主要原因来源基金规模波动导致的汇兑损益。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从当前时点展望 2020 年下半年，我们对于港股持谨慎乐观的态度，波动性相对二季度上升的概率有所加大。港股市场将呈现出成长和价值轮动的风格特征，有利于行业分布较为均衡的标普香港中小盘指数的发挥。

流动性方面，国内层面，虽然近期总量和中观经济数据恢复较快，但中小企业压力依然较大，国内流动性边际进一步宽松可能性较小，但大概率依然会维持稳定。国际层面，美国后续联储货币政策大概率维持宽松，欧元区终于通过财政刺激，疫情控制较为良好，欧美经济增长差缩窄，

美元指数持续走弱，有利于包括港股在内的新兴市场。业绩层面，复工逐步推进，三季度信用债额度释放力度可期，中国 PPI 筑底回升带来中国资产业绩上行暨大概率，对于港股形成利好，同时也或将导致港股整体价值和成长风格更为均衡。此外，下半年美股上市中概股有望加速回归港股上市，恒生指数改革也将生效，更多新经济公司有利于对港股和恒生指数的整体业绩增速形成正向促进，同时有利于港股的估值提升。

随着十一月美国大选的临近，中美之间地缘政治风险上升的概率或将加大，这可能在短期内对于市场形成比较大的扰动。但我们认为在流动性充裕和中国经济下半年保持复苏态势的大背景下，短期的市场扰动都有可能形成香港中小基金逢低布局的潜在机会。

4.7 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。

（1）日常估值流程

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

（2）特殊业务估值流程

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

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期亏损，未有应分未分的利润。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，发现个别监督指标不符合基金合同约定并及时通知了基金管理人，基金管理人在合理期限内进行了调整，对基金份额持有人利益未造成损害。

报告期内，本基金未实施利润分配。

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

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

§ 6 半年度财务会计报告 (未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：华宝标普香港上市中国中小盘指数证券投资基金 (LOF)

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	114,400,664.26	116,548,445.76
结算备付金		-	-
存出保证金		3,943,926.25	61,104.04
交易性金融资产	6.4.7.2	1,552,042,460.69	1,667,829,205.70
其中：股票投资		1,552,042,460.69	1,667,829,205.70
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		32,207,463.96	835,991.11
应收利息	6.4.7.5	9,359.39	25,854.99
应收股利		19,325,934.36	624,306.35
应收申购款		3,255,960.33	2,106,582.98
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,725,185,769.24	1,788,031,490.93
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		35,873,402.35	1,356.69
应付赎回款		24,396,122.77	9,945,068.27
应付管理人报酬		1,358,391.95	1,481,616.28
应付托管费		339,597.98	370,404.10
应付销售服务费		7,010.57	2,734.88
应付交易费用	6.4.7.7	1,666,145.47	783,103.24
应交税费		-	-
应付利息		-	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	1,057,270.12	752,733.76
负债合计		64,697,941.21	13,337,017.22
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	1,116,315,172.59	1,161,393,647.92
未分配利润	6.4.7.10	544,172,655.44	613,300,825.79
所有者权益合计		1,660,487,828.03	1,774,694,473.71
负债和所有者权益总计		1,725,185,769.24	1,788,031,490.93

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，基金份额总额 1,116,315,172.59 份，其中香港中小基金份额总额为 1,102,034,244.69 份，基金份额净值 1.4876 元；华宝香港中小 C 基金份额总额为 14,280,927.90 份，基金份额净值 1.4784 元。

6.2 利润表

会计主体：华宝标普香港上市中国中小盘指数证券投资基金(LOF)

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
一、收入		-6,348,121.27	133,610,727.07
1. 利息收入		482,549.55	199,393.90
其中：存款利息收入	6.4.7.11	482,549.55	199,393.90
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		66,897,989.69	6,603,338.24
其中：股票投资收益	6.4.7.12	43,309,616.90	-12,965,089.90
基金投资收益	6.4.7.13	-	-
债券投资收益	6.4.7.14	-	-
资产支持证券投资	6.4.7.14.5	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-	49,715.66
股利收益	6.4.7.17	23,588,372.79	19,518,712.48
3. 公允价值变动收益（损失	6.4.7.18	-74,324,135.03	126,986,108.13

以“-”号填列)			
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列)		9,305.08	-276,792.38
5. 其他收入（损失以“-”号填列)	6.4.7.19	586,169.44	98,679.18
减：二、费用		14,659,298.58	9,003,764.32
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	8,743,559.40	5,887,190.31
2. 托管费	6.4.10.2.2	2,185,889.81	1,471,797.64
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	63,219.62	967.06
4. 交易费用	6.4.7.20	3,108,370.36	1,204,218.85
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	164.05
7. 其他费用	6.4.7.21	558,259.39	439,426.41
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列)		-21,007,419.85	124,606,962.75
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列)		-21,007,419.85	124,606,962.75

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华宝标普香港上市中国中小盘指数证券投资基金(LOF)

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值)	1,161,393,647.92	613,300,825.79	1,774,694,473.71
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润)		-21,007,419.85	-21,007,419.85
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列)	-45,078,475.33	-48,120,750.50	-93,199,225.83
其中：1. 基金申购款	676,900,810.89	245,373,098.32	922,273,909.21
2. 基金赎回	-721,979,286.22	-293,493,848.82	-1,015,473,135.04

回款			
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）			0.00
五、期末所有者权益（基金净值）	1,116,315,172.59	544,172,655.44	1,660,487,828.03
项目	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	790,186,350.60	148,048,377.81	938,234,728.41
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	124,606,962.75	124,606,962.75
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	270,640,688.89	98,977,444.66	369,618,133.55
其中：1. 基金申购款	407,473,421.97	138,637,093.88	546,110,515.85
2. 基金赎回款	-136,832,733.08	-39,659,649.22	-176,492,382.30
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	1,060,827,039.49	371,632,785.22	1,432,459,824.71

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1

至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

黄小蕙

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

华宝标普香港上市中国中小盘指数证券投资基金(LOF)(原名为华宝兴业标普香港上市中国中小盘指数证券投资基金(LOF),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[2016]626号《关于准予华宝兴业标普香港上市中国中小盘指数证券投资基金(LOF)注册的批复》的核准,由华宝基金管理有限公司(原华宝兴业基金管理有限公司,已于2017年10月17日办理完成工商变更登记)依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华宝兴业标普香港上市中国中小盘指数证券投资基金(LOF)基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币431,404,826.85元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2016)第828号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华宝兴业标普香港上市中国中小盘指数证券投资基金(LOF)基金合同》于2016年6月24日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为431,503,809.43份基金份额,其中认购资金利息折合98,982.58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,基金托管人为中国建设银行股份有限公司,境外资产托管人为道富银行(State Street Bank and Trust Company)。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2016]175号核准,本基金219,318,090.00份基金份额于2016年7月6日于上交所挂牌交易。基金份额持有人通过场外代销机构持有的基金份额,需转托管至上交所场内后即可上市流通。

根据《华宝基金管理有限公司关于旗下基金更名事宜的公告》,华宝兴业标普香港上市中国中小盘指数证券投资基金(LOF)于2017年12月30日起更名为华宝标普香港上市中国中小盘指数证券投资基金(LOF)。

根据《华宝基金管理有限公司关于华宝标普香港上市中国中小盘指数证券投资基金(LOF)增加C类基金份额并修改基金合同的公告》及更新后的《华宝标普香港上市中国中小盘指数证券投资基金(LOF)基金合同》,自2018年7月30日起,本基金根据销售服务费及申购费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资者申购时收取申购费且不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为A类基金份额;在投资者申购时不收取申购费但从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为C类基金份额。A类基金份额和C类基金份额分别设置代码,分别计算并公布基金份额净值和基金份额累计净值。投资人可通过场内、场外两种渠道申购与赎回A类基金份额;可通过场外渠道申购与赎回C类基金份额。A类基金份额参与上市交易,C类基金份额不参与上市交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华宝标普香港上市中国中小盘指数证券投资基金（LOF）基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括标普香港上市中国中小盘指数成份股、备选成份股、已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券市场挂牌交易的其他股票、固定收益类证券、银行存款、货币市场工具、回购、证券借贷、跟踪标普香港上市中国中小盘指数的股指期货等金融衍生品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（但需符合中国证监会相关规定）。本基金在投资香港特别行政区证券市场挂牌交易的股票时，在法律法规允许的前提下，既可通过合格境内机构投资者的额度进行投资，也可通过沪港股票市场互联互通机制进行投资。本基金投资于标普香港上市中国中小盘指数成份股、备选成份股的比例不低于基金资产的 80%；投资于现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为：经人民币汇率调整的标普香港上市中国中小盘指数收益率 $\times 95\%$ +人民币活期存款利率（税后） $\times 5\%$ 。

本基金的财务报表于 2020 年 8 月 31 日已经本基金的基金管理人批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华宝标普香港上市中国中小盘指数证券投资基金（LOF）基金合同》和在财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2020 半年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2020 年 6 月 30 日的财务状况以及 2020 半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关境内外财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

(2) 目前基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收企业所得税。

(3) 目前基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收个人所得税和企业所得税。

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中国结算”）提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所

上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

(4) 基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末
	2020 年 6 月 30 日
活期存款	114,400,664.26
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计	114,400,664.26

注：于 2020 年 6 月 30 日，活期存款包括人民币活期存款 29,949,409.82 元，港元活期存款 92,454,079.57 元（折合人民币 84,451,254.44 元）。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末		
	2020 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,398,564,949.80	1,552,042,460.69	153,477,510.89
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	1,398,564,949.80	1,552,042,460.69	153,477,510.89

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应收活期存款利息	8,130.83
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	1,221.16
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	7.40
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	-
合计	9,359.39

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
交易所市场应付交易费用	1,666,145.47
银行间市场应付交易费用	-
合计	1,666,145.47

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
----	-------------------

应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	53,427.92
应付证券出借违约金	
预提费用	89,507.60
应付指数使用费	857,685.86
应付数据使用费	56,648.74
合计	1,057,270.12

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

香港中小

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	1,155,630,988.32	1,155,630,988.32
本期申购	603,613,158.30	603,613,158.30
本期赎回(以“-”号填列)	-657,209,901.93	-657,209,901.93
-基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	1,102,034,244.69	1,102,034,244.69

华宝香港中小C

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	5,762,659.60	5,762,659.60
本期申购	73,287,652.59	73,287,652.59
本期赎回(以“-”号填列)	-64,769,384.29	-64,769,384.29
-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	14,280,927.90	14,280,927.90

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

香港中小			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	279,301,374.98	330,998,951.22	610,300,326.20
本期利润	52,390,327.22	-74,723,213.21	-22,332,885.99
本期基金份额 交易产生的变	-15,495,733.08	-35,131,584.98	-50,627,318.06

动数			
其中：基金申购款	152,932,345.02	65,350,439.12	218,282,784.14
基金赎回款	-168,428,078.10	-100,482,024.10	-268,910,102.20
本期已分配利润	-	-	-
本期末	316,195,969.12	221,144,153.03	537,340,122.15
华宝香港中小 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,795,618.51	204,881.08	3,000,499.59
本期利润	926,387.96	399,078.18	1,325,466.14
本期基金份额交易产生的变动数	3,809,958.98	-1,303,391.42	2,506,567.56
其中：基金申购款	36,241,057.87	-9,150,743.69	27,090,314.18
基金赎回款	-32,431,098.89	7,847,352.27	-24,583,746.62
本期已分配利润	-	-	-
本期末	7,531,965.45	-699,432.16	6,832,533.29

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
活期存款利息收入	363,978.54
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	76,049.69
其他	42,521.32
合计	482,549.55

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	43,309,616.90
股票投资收益——赎回差价收入	-

股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	43,309,616.90

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2020年1月1日至2020年6月30日
卖出股票成交总额	763,622,655.08
减：卖出股票成本总额	720,313,038.18
买卖股票差价收入	43,309,616.90

6.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

-

6.4.7.13 基金投资收益

本基金本报告期无基金投资收益。

6.4.7.14 债券投资收益

6.4.7.14.1 债券投资收益项目构成

本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

-

6.4.7.14.3 债券投资收益——赎回差价收入

-

6.4.7.14.4 债券投资收益——申购差价收入

-

6.4.7.14.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.15 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.16 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
股票投资产生的股利收益	23,588,372.79
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	23,588,372.79

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
1. 交易性金融资产	-74,324,135.03
股票投资	-74,324,135.03
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	-74,324,135.03

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日

基金赎回费收入	586,169.44
合计	586,169.44

注：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。

6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	3,108,370.36
银行间市场交易费用	-
合计	3,108,370.36

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
审计费用	29,835.26
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行费用	3,610.35
指数使用费	437,177.95
其他	27,963.49
合计	558,259.39

6.4.7.22 分部报告

无。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无其它需作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华宝基金管理有限公司（“华宝基金”）	基金管理人、C 类基金份额注册登记机构、基金销售机构

中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人、基金销售机构
道富银行(State Street Bank and Trust Corporation)	境外资产托管人
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
中国宝武钢铁集团有限公司（“宝武集团”）	华宝信托的最终控制人
华宝证券有限责任公司（“华宝证券”）	受宝武集团控制的公司
华宝投资有限公司（“华宝投资”）	受宝武集团控制的公司
宝钢集团财务有限责任公司（“宝钢财务”）	受宝武集团控制的公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金本期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易。

6.4.10.1 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位进行交易。

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.4 基金交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的基金交易。

6.4.10.1.5 权证交易

本基金本期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6 月30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	8,743,559.40	5,887,190.31
其中：支付销售机构的客户维护费	1,891,793.89	475,206.39

注：支付基金管理人华宝基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6 月30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年 6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	2,185,889.81	1,471,797.64

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联	本期 2020年1月1日至2020年6月30日

方名称	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	香港中小	华宝香港中小 C	合计
华宝基金	-	29,441.28	29,441.28
华宝证券	-	0.54	0.54
合计	-	29,441.82	29,441.82
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	香港中小	华宝香港中小 C	合计
华宝基金	-	650.28	650.28
合计	-	650.28	650.28

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 B 类基金资产净值 0.4% 的年费率计提，逐日累计至

每月月底，按月支付给华宝基金，再由华宝基金计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

日销售服务费 = 前一日 B 类基金资产净值 × 0.4% 当年天数。

基金销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基

金销售服务费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支取。若

遇法定节假日、公休日等 支付日期顺延。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 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自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
	香港中小	华宝香港中小 C
基金合同生效日（2016 年 6 月 24 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	694,444.44	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份 额	-	-
报告期末持有的基金份额	694,444.44	-
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	0.06%	-
项目	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
	香港中小	华宝香港中小 C
基金合同生效日（2016 年 6 月 24 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	694,444.44	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份 额	-	-
报告期末持有的基金份额	694,444.44	-
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	0.07%	-

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

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

香港中小

关联方名称	本期末 2020年6月30日		上年度末 2019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（%）
-	-	-	0.00	0.0000

份额单位：份

华宝香港中小 C

关联方名称	本期末 2020年6月30日		上年度末 2019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（%）
-	-	-	0.00	0.0000

注：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 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019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
美国道富银行有限公司	84,445,075.22	161.92	21,438,750.32	1,341.77
中国建设银行股份有限公司	29,955,589.04	363,816.62	62,699,563.90	159,831.20

注：本基金的银行存款分别由基金托管人中国建设银行和境外资产托管人美国道富银行有限公司保管，按适用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

本基金本期及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.8 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(2020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

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
6863 HK	辉山乳业	2019年 12月 23日	重大事项	0.00	-	-	4,338,000	11,180,745.35	-	-

注：根据香港联合交易所有限公司于2019年12月18日发布的《关于中国辉山乳业控股有限公司取消上市地位》的通告，由2019年12月23日上午9时起，该公司的上市地位将根据除牌程序予以取消。

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

本基金为指数型基金，跟踪标普香港上市中国中小盘指数。本基金在日常经营活动中面临的与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，通过对投资品种的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，本基金无债券投资。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

于本报告期末，除附注中列示的卖出回购金融资产款将在一个月以内到期且计息（该利息金额不重大）外，本基金所承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基

金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息,因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

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

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	114,400,664.26	-	-	-	114,400,664.26
存出保证金	3,943,926.25	-	-	-	3,943,926.25
交易性金融资产	-	-	-	1,552,042,460.69	1,552,042,460.69
应收利息	-	-	-	9,359.39	9,359.39
应收股利	-	-	-	19,325,934.36	19,325,934.36
应收申购款	100,339.49	-	-	3,155,620.84	3,255,960.33
应收证券清算款	-	-	-	32,207,463.96	32,207,463.96
资产总计	118,444,930.00	-	-	1,606,740,839.24	1,725,185,769.24
负债					
应付赎回款	-	-	-	24,396,122.77	24,396,122.77
应付管理人报酬	-	-	-	1,358,391.95	1,358,391.95
应付托管费	-	-	-	339,597.98	339,597.98
应付证券清算款	-	-	-	35,873,402.35	35,873,402.35
应付销售服务费	-	-	-	7,010.57	7,010.57
应付交易费用	-	-	-	1,666,145.47	1,666,145.47
其他负债	-	-	-	1,057,270.12	1,057,270.12
负债总计	-	-	-	64,697,941.21	64,697,941.21
利率敏感度缺口	118,444,930.00	-	-	1,542,042,898.03	1,660,487,828.03
上年度末	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计

2019 年 12 月 31 日					
------------------	--	--	--	--	--

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日				
----	------------------------	--	--	--	--

资产					
银行存款	116,548,445.76	-	-	-	116,548,445.76
存出保证金	61,104.04	-	-	-	61,104.04
交易性金融资产	-	-	-	1,667,829,205.70	1,667,829,205.70
应收利息	-	-	-	25,854.99	25,854.99
应收股利	-	-	-	624,306.35	624,306.35
应收申购款	30,486.37	-	-	2,076,096.61	2,106,582.98
应收证券清算款	-	-	-	835,991.11	835,991.11
资产总计	116,640,036.17	-	-	1,671,391,454.76	1,788,031,490.93
负债					
应付赎回款	-	-	-	9,945,068.27	9,945,068.27
应付管理人报酬	-	-	-	1,481,616.28	1,481,616.28
应付托管费	-	-	-	370,404.10	370,404.10
应付证券清算款	-	-	-	1,356.69	1,356.69
应付销售服务费	-	-	-	2,734.88	2,734.88
应付交易费用	-	-	-	783,103.24	783,103.24
其他负债	-	-	-	752,733.76	752,733.76
负债总计	-	-	-	13,337,017.22	13,337,017.22
利率敏感度缺口	116,640,036.17	-	-	1,658,054,437.54	1,774,694,473.71

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。本基金持有不以记账本位币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的 资产				
银行存款	-	84,451,254.44	-	84,451,254.44
交易性金融资 产	-	1,552,042,460. 69	-	1,552,042,460.69
应收股利	-	1,330,184.47	-	1,330,184.47
应收利息	-	49.92	-	49.92
资产合计	-	1,637,823,949. 52	-	1,637,823,949.52
以外币计价的 负债				
应付证券清算 款	-	35,873,093.89	-	35,873,093.89
其他负债	56,648.74	-	-	56,648.74
负债合计	56,648.74	35,873,093.89	-	35,929,742.63
资产负债表外 汇风险敞口净 额	-56,648.7 4	1,601,950,855. 63	-	1,601,894,206.89
	上年度末 2019 年 12 月 31 日			
项目	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的 资产				
银行存款	-	17,488,205.82	-	17,488,205.82
交易性金融资 产	-	1,667,829,205. 70	-	1,667,829,205.70
应收利息	-	112.24	-	112.24
资产合计	-	1,685,317,523. 76	-	1,685,317,523.76
以外币计价的 负债				

其他负债	28,059.95	-	-	28,059.95
负债合计	28,059.95	-	-	28,059.95
资产负债表外 汇风险敞口净 额	-28,059.9 5	1,685,317,523. 76	-	1,685,289,463.81

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变		
	相关风险变量的变 动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2020年6月30日）	上年度末（2019年12月 31日）
分析	1. 所有外币相对 人民币升值 5%	80,094,710.34	84,264,473.19
	2. 所有外币相对 人民币贬值 5%	-80,094,710.34	-84,264,473.19

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于标普香港上市中国中小盘指数成份股、备选成份股的比例不低于基金资产的 80%；投资于现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在一年以内的政府债券的比例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 2020年6月30日		上年度末 2019年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	1,552,042,460.69	93.47	1,667,829,205.70	93.98
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,552,042,460.69	93.47	1,667,829,205.70	93.98

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位：人民币元)		
	本期末 (2020年6月30日)	上年度末 (2019年12月31日)	
分析	1. 业绩比较基准上升 5%	80,769,747.82	85,454,183.20
	2. 业绩比较基准下降 5%	-80,769,747.82	-85,454,183.20

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

- (1) 公允价值
- (a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于本报告期末，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 1,542,873,958.32 元，属于第三层次的余额为零元，属于第二层次的余额为 9,168,502.37 元。（上年度末：第一层次 1,667,829,205.70 元，属于第三层次的余额为零元，无属于第二层次的余额）。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

于本报告期末，本基金持有公允价值归属于第三层次的金融工具的金量为零元。（上年度末：本基金持有公允价值归属于第三层次的金融工具的金量为零元，计入损益的损失为 1,596,401.36 元，计入损益的损失计入利润表中的公允价值变动收益等项目。使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值采用成本法及相关估值技术确定，不可观察输入值为净资产，与公允价值之间为正相关）。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

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

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	1,552,042,460.69	89.96
	其中：普通股	1,552,042,460.69	89.96
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	114,400,664.26	6.63
8	其他各项资产	58,742,644.29	3.41
9	合计	1,725,185,769.24	100.00

7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家（地区）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
中国香港	1,552,042,460.69	93.47
合计	1,552,042,460.69	93.47

7.3 期末按行业分类的权益投资组合

7.3.1 期末指数投资按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
房地产	168,173,131.50	10.13
非日常生活消费品	209,250,937.52	12.60
工业	162,618,525.36	9.79
公用事业	101,235,687.41	6.10
金融	69,630,991.36	4.19
能源	12,092,867.74	0.73

日常消费品	240,064,482.19	14.46
通信服务	19,631,780.36	1.18
信息技术	230,647,107.61	13.89
医疗保健	223,031,480.64	13.43
原材料	71,814,399.77	4.32
合计	1,508,191,391.46	90.83

7.3.2 期末积极投资按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
房地产	7,321,075.45	0.44
非日常生活消费品	4,372,459.15	0.26
金融	4,223,984.06	0.25
日常消费品	5,160,552.36	0.31
通信服务	4,815,582.60	0.29
信息技术	663,376.67	0.04
医疗保健	9,399,524.13	0.57
原材料	7,894,514.81	0.48
合计	43,851,069.23	2.64

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

7.4.1 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权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称 (英文)	公司名称 (中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家 (地区)	数量 (股)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	SUNNY OPTICAL TECH	舜宇光学科 技	2382 HK	香港联合交易所	中国香港	437,800	49,588,099.97	2.99
2	CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	石药集团	1093 HK	香港联合交易所	中国香港	3,613,600	48,323,811.32	2.91
3	SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	中芯国际	981 HK	香港	中国香港	1,913,500	47,192,420.88	2.84

				联合交易所				
4	CHINA MENGNIU DAIRY CO	蒙牛乳业	2319 HK	香港联合交易所	中国香港	1,688,000	45,639,846.91	2.75
5	SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	融创中国	1918 HK	香港联合交易所	中国香港	1,471,000	43,602,099.29	2.63
6	WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	药明生物	2269 HK	香港联合交易所	中国香港	328,500	42,549,222.67	2.56
7	WH GROUP LTD	万洲国际	288 HK	香港联合交易所	中国香港	5,902,000	35,797,055.92	2.16
8	GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	吉利汽车	175 HK	香港联合交易所	中国香港	3,168,000	35,304,090.62	2.13
9	CHINA RESOURCES BEER HOLDING	华润啤酒	291 HK	香港联合交	中国香港	850,000	33,541,516.80	2.02

				易所				
10	CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	海螺创业	586 HK	香港联合交易所	中国香港	1,007,000	30,078,574.42	1.81
11	LI NING CO LTD	李宁	2331 HK	香港联合交易所	中国香港	1,278,500	28,728,692.78	1.73
12	SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	申洲国际	2313 HK	香港联合交易所	中国香港	291,700	24,886,471.84	1.50
13	HENGAN INTL GROUP CO LTD	恒安国际	1044 HK	香港联合交易所	中国香港	438,500	24,312,986.81	1.46
14	INNOVENT BIOLOGICS INC	信达生物	1801 HK	香港联合交易所	中国香港	449,000	23,582,737.20	1.42
15	COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	碧桂园服务	6098 HK	香港联合交易所	中国香港	716,000	23,544,829.44	1.42
16	SHANDONG WEIGAO	威高股份	1066	香	中国	1,472,000	23,180,622.64	1.40

	GP MEDICAL-H		HK	香港联合交易所	香港			
17	KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	金蝶国际	268 HK	香港联合交易所	中国香港	1,386,000	22,813,821.68	1.37
18	GUANGDONG INVESTMENT LTD	粤海投资	270 HK	香港联合交易所	中国香港	1,796,000	21,819,158.59	1.31
19	WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	中国旺旺	151 HK	香港联合交易所	中国香港	3,958,000	21,150,063.79	1.27
20	SHIMAO GROUP HOLDINGS LTD	世茂集团	813 HK	香港联合交易所	中国香港	688,000	20,613,052.42	1.24
21	KINGSOFT CORP LTD	金山软件	3888 HK	香港联合交易所	中国香港	604,000	19,889,425.25	1.20
22	AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	瑞声科技	2018 HK	香港联合	中国香港	440,000	19,110,991.68	1.15

				交易所				
23	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	中国建材	3323 HK	香港联合交易所	中国香港	2,434,400	18,345,346.27	1.10
24	CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	华润燃气	1193 HK	香港联合交易所	中国香港	524,000	18,068,756.64	1.09
25	SUN ART RETAIL GROUP LTD	高鑫零售	6808 HK	香港联合交易所	中国香港	1,357,000	16,411,484.18	0.99
26	CHINA FEIHE LTD	中国飞鹤	6186 HK	香港联合交易所	中国香港	1,153,000	16,345,606.89	0.98
27	HAIER ELECTRONICS GROUP CO	海尔电器	1169 HK	香港联合交易所	中国香港	755,000	16,172,226.84	0.97
28	YIHAI INTERNATIONAL HOLDING	颐海国际	1579 HK	香港联合交易所	中国香港	212,000	15,385,435.30	0.93

29	LENOVO GROUP LTD	联想集团	992 HK	香港联合交易所	中国香港	3,874,000	15,180,879.54	0.91
30	SINOPHARM GROUP CO-H	国药控股	1099 HK	香港联合交易所	中国香港	825,600	14,962,059.51	0.90
31	CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	中国金茂	817 HK	香港联合交易所	中国香港	3,002,000	14,944,700.50	0.90
32	XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	信义光能	968 HK	香港联合交易所	中国香港	2,094,000	14,039,536.26	0.85
33	XINYI GLASS HOLDINGS LTD	信义玻璃	868 HK	香港联合交易所	中国香港	1,574,000	13,658,668.32	0.82
34	WEICHAI POWER CO LTD-H	潍柴动力	2338 HK	香港联合交易所	中国香港	1,018,000	13,427,494.92	0.81
35	TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	康师傅控股	322 HK	香港联	中国香港	1,164,000	12,780,194.80	0.77

				合交易所				
36	CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	旭辉控股集团	884 HK	香港联合交易所	中国香港	2,304,000	12,711,577.19	0.77
37	TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	青岛啤酒	168 HK	香港联合交易所	中国香港	234,000	12,290,335.20	0.74
38	ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	中升控股	881 HK	香港联合交易所	中国香港	310,000	12,147,838.56	0.73
39	CHINA INTERNATIONAL CAPITAL-H	中金公司	3908 HK	香港联合交易所	中国香港	854,800	11,883,905.55	0.72
40	CHINA RESOURCES CEMENT	华润水泥控股	1313 HK	香港联合交易所	中国香港	1,350,000	11,702,536.56	0.70
41	ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	紫金矿业	2899 HK	香港联合交易所	中国香港	3,548,000	11,699,595.28	0.70

				所				
42	BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	BRILLIANCE CHI	1114 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	1,828,000	11,588,192.14	0.70
43	KUNLUN ENERGY CO LTD	昆仑能源	135 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	2,488,000	11,408,646.37	0.69
44	CHINA TELECOM CORP LTD-H	中国电信	728 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	5,642,000	11,183,373.80	0.67
45	PING AN HEALTHCARE AND TECHN	平安好医生	1833 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	98,600	10,618,685.19	0.64
46	BEIJING ENTERPRISES WATER GR	北控水务集 团有限公司	371 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	3,724,000	10,272,984.69	0.62
47	CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	中国太平	966 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	896,600	10,171,859.58	0.61
48	LOGAN GROUP CO LTD	龙光集团	3380 HK	香港	中国 香港	783,000	9,812,866.69	0.59

				联合交易所				
49	CGN POWER CO LTD-H	中国广核	1816 HK	香港联合交易所	中国香港	6,368,000	9,306,857.47	0.56
50	CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	华润电力	836 HK	香港联合交易所	中国香港	1,116,000	9,286,725.25	0.56
51	GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	广汽集团	2238 HK	香港联合交易所	中国香港	1,762,000	8,997,000.36	0.54
52	GENSCRIPT BIOTECH CORP	金斯瑞生物科技	1548 HK	香港联合交易所	中国香港	610,000	8,881,742.50	0.53
53	MINTH GROUP LTD	敏实集团	425 HK	香港联合交易所	中国香港	438,000	8,821,912.18	0.53
54	GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	长城汽车	2333 HK	香港联合交	中国香港	1,938,500	8,570,204.65	0.52

				易所				
55	KWG GROUP HOLDINGS LTD	合景泰富集团	1813 HK	香港联合交易所	中国香港	713,500	8,485,647.51	0.51
56	CHINA EVERBRIGHT INTL LTD	中国光大国际	257 HK	香港联合交易所	中国香港	2,213,000	8,267,700.72	0.50
57	CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	中国银河	6881 HK	香港联合交易所	中国香港	2,156,000	8,251,688.12	0.50
58	TONGCHENG-ELONG HOLDINGS LTD	同程艺龙	780 HK	香港联合交易所	中国香港	609,600	7,773,389.02	0.47
59	CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	龙源电力	916 HK	香港联合交易所	中国香港	1,951,000	7,752,228.26	0.47
60	KINGBOARD HOLDINGS LTD	建滔集团	148 HK	香港联合交易所	中国香港	421,000	7,729,620.62	0.47
61	CHINA CINDA	中国信达	1359	香	中国	5,449,000	7,565,548.53	0.46

	ASSET MANAGEMENT		HK	香港 联合交易所	香港			
62	SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL	复星医药	2196 HK	香港 联合交易所	中国 香港	319,500	7,558,761.67	0.46
63	SINOTRUK HONG KONG LTD	中国重汽	3808 HK	香港 联合交易所	中国 香港	412,000	7,545,562.46	0.45
64	AGILE GROUP HOLDINGS LTD	雅居乐集团	3383 HK	香港 联合交易所	中国 香港	894,000	7,447,532.08	0.45
65	CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	康哲药业	867 HK	香港 联合交易所	中国 香港	861,000	7,180,487.90	0.43
66	BEIJING ENTERPRISES HLDGS	北京控股	392 HK	香港 联合交易所	中国 香港	299,000	7,073,770.70	0.43
67	NEW CHINA LIFE INSURANCE CO	新华保险	1336 HK	香港 联合交易所	中国 香港	293,300	6,952,315.15	0.42

				交易所				
68	CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	招商局港口	144 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	822,000	6,877,764.75	0.41
69	SEAZEN GROUP LTD	新城发展	1030 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	1,116,000	6,860,555.54	0.41
70	HAITONG SECURITIES CO LTD-H	海通证券	6837 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	1,191,600	6,813,728.95	0.41
71	NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	玖龙纸业	2689 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	1,048,000	6,710,568.69	0.40
72	SHENZHEN INTL HOLDINGS	深圳国际	152 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	594,000	6,695,478.66	0.40
73	ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	众安在线	6060 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	189,000	6,620,750.14	0.40

74	GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	富力地产	2777 HK	香港 联合 交易 所	中国 香港	801,200	6,601,270.11	0.40
75	DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	东风集团股 份	489 HK	香港 联合 交易 所	中国 香港	1,546,000	6,538,385.25	0.39
76	CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	中国通信服 务	552 HK	香港 联合 交易 所	中国 香港	1,482,000	6,524,921.15	0.39
77	TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	中国民航信 息网络	696 HK	香港 联合 交易 所	中国 香港	517,000	6,441,469.27	0.39
78	CHINA OILFIELD SERVICES-H	中海油服	2883 HK	香港 联合 交易 所	中国 香港	1,012,000	6,433,832.91	0.39
79	GREENTOWN SERVICE GROUP CO L	绿城服务	2869 HK	香港 联合 交易 所	中国 香港	768,000	6,404,895.13	0.39
80	WEIMOB INC	微盟集团	2013 HK	香港 联	中国 香港	717,000	6,372,531.95	0.38

				合交易所				
81	BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	比亚迪电子	285 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	390,500	6,327,828.20	0.38
82	A-LIVING SERVICES CO LTD-H	雅生活服务	3319 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	176,250	6,286,807.89	0.38
83	HUANENG POWER INTL INC-H	华能国际	902 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	2,350,000	6,246,559.44	0.38
84	CHINA LITERATURE LTD	阅文集团	772 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	130,600	6,227,212.78	0.38
85	SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	上海医药	2607 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	522,400	6,212,897.35	0.37
86	ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRI-H	中车时代电 气	3898 HK	香港 联合 交易	中国 香港	342,400	6,161,408.56	0.37

				所				
87	GF SECURITIES CO LTD-H	广发证券	1776 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	788,800	5,980,328.22	0.36
88	TIMES CHINA HOLDINGS LTD	时代中国控 股	1233 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	457,000	5,977,770.59	0.36
89	HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	华虹半导体	1347 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	241,000	5,921,740.18	0.36
90	GREENTOWN CHINA HOLDINGS	绿城中国	3900 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	819,000	5,790,350.97	0.35
91	ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD	正荣地产	6158 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	1,304,000	5,776,959.94	0.35
92	YANZHOU COAL MINING CO-H	兖州煤业	1171 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	1,070,000	5,659,034.83	0.34
93	CHINA AOYUAN GROUP LTD	中国奥园	3883 HK	香港	中国 香港	660,000	5,648,895.65	0.34

				联合交易所				
94	AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	中航科工	2357 HK	香港联合交易所	中国香港	1,730,000	5,546,681.71	0.33
95	DALI FOODS GROUP CO LTD	达利食品	3799 HK	香港联合交易所	中国香港	1,279,000	5,490,961.87	0.33
96	CHINA EVERBRIGHT LTD	中国光大控股	165 HK	香港联合交易所	中国香港	526,000	5,390,867.12	0.32
97	FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	福耀玻璃	3606 HK	香港联合交易所	中国香港	315,600	5,321,679.52	0.32
98	CHINA MOLYBDENUM CO LTD-H	洛阳钼业	3993 HK	香港联合交易所	中国香港	2,262,000	5,227,489.24	0.31
99	JIANGXI COPPER CO LTD-H	江西铜业	358 HK	香港联合交	中国香港	715,000	5,100,785.98	0.31

				易所				
100	AIR CHINA LTD-H	中国国航	753 HK	香港 联合 交易 所	中国 香港	1,200,000	5,064,111.36	0.30
101	BOSIDENG INTL HLDGS LTD	波司登	3998 HK	香港 联合 交易 所	中国 香港	2,282,000	5,002,728.19	0.30
102	LUYE PHARMA GROUP LTD	绿叶制药	2186 HK	香港 联合 交易 所	中国 香港	1,084,500	4,695,565.72	0.28
103	CHINA STATE CONSTRUCTION INT	中国建筑国际	3311 HK	香港 联合 交易 所	中国 香港	1,102,000	4,549,881.18	0.27
104	BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	北京首都机场股份	694 HK	香港 联合 交易 所	中国 香港	1,024,000	4,536,508.42	0.27
105	ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	招金矿业	1818 HK	香港 联合 交易 所	中国 香港	547,000	4,521,847.70	0.27
106	ZHEJIANG	浙江沪杭甬	576	香	中国	886,000	4,435,006.96	0.27

	EXPRESSWAY CO-H		HK	香港 联合交易所	香港			
107	AK MEDICAL HOLDINGS LTD	爱康医疗	1789 HK	香港 联合交易所	中国 香港	194,000	4,368,161.42	0.26
108	JINXIN FERTILITY GROUP LTD	锦欣生殖	1951 HK	香港 联合交易所	中国 香港	400,000	4,289,514.24	0.26
109	3SBIO INC	三生制药	1530 HK	香港 联合交易所	中国 香港	476,500	4,274,195.85	0.26
110	CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	华润医药	3320 HK	香港 联合交易所	中国 香港	1,014,000	4,140,239.88	0.25
111	CHINASOFT INTERNATIONAL LTD	中国软件国际	354 HK	香港 联合交易所	中国 香港	1,059,000	4,101,491.75	0.25
112	PHARMARON BEIJING CO LTD-H	康龙化成	3759 HK	香港 联合交易所	中国 香港	54,200	3,960,675.84	0.24

				交易所				
113	SHANDONG GOLD MINING CO LT-H	山东黄金	1787 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	263,250	3,958,022.29	0.24
114	KINGBOARD LAMINATES HLDG LTD	建滔积层板	1888 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	548,000	3,899,402.28	0.23
115	CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD	中海物业	2669 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	515,000	3,857,457.12	0.23
116	TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	滔搏	6110 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	420,000	3,798,083.52	0.23
117	CHINA LESSO GROUP HOLDINGS L	中国联塑	2128 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	399,000	3,673,782.60	0.22
118	KAISA GROUP HOLDINGS LTD	佳兆业集团	1638 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	1,335,000	3,560,771.81	0.21

119	CHINA YUHUA EDUCATION CORP L	宇华教育	6169 HK	香港 联合 交易 所	中国 香港	596,000	3,462,449.13	0.21
120	CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	南方航空	1055 HK	香港 联合 交易 所	中国 香港	1,104,000	3,458,941.52	0.21
121	CHINA SCE GROUP HOLDINGS LTD	中骏集团控 股	1966 HK	香港 联合 交易 所	中国 香港	1,109,000	3,403,696.67	0.20
122	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	中国铝业	2600 HK	香港 联合 交易 所	中国 香港	2,460,000	3,258,240.48	0.20
123	CHINA EASTERN AIRLINES CO-H	东方航空	670 HK	香港 联合 交易 所	中国 香港	1,266,000	3,191,705.51	0.19
124	POLY PROPERTY DEVELOPMENT -H	保利物业	6049 HK	香港 联合 交易 所	中国 香港	43,200	3,077,927.42	0.19
125	ZOOMLION HEAVY INDUSTRY - H	中联重科	1157 HK	香港 联	中国 香港	561,200	3,060,356.49	0.18

				合交易所				
126	KOOLEARN TECHNOLOGY HOLDING	新东方在线	1797 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	98,000	2,783,982.43	0.17
127	GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHARM-H	白云山	874 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	140,000	2,501,364.10	0.15
128	XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	金风科技	2208 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	410,294	2,488,532.24	0.15
129	CHINA EAST EDUCATION HOLDING	中国东方教育	667 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	176,500	2,260,334.69	0.14
130	XD INC	心动公司	2400 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	81,600	2,221,193.78	0.13
131	COMBA TELECOM SYSTEMS HOLDIN	京信通信	2342 HK	香港 联合 交易	中国 香港	706,000	2,037,848.10	0.12

				所				
132	JIUMAOJIU INTERNATIONAL HOLD	九毛九	9922 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	161,000	1,967,714.18	0.12
133	YICHANG HEC CHANGJIANG PHA-H	东阳光药	1558 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	121,000	1,750,735.64	0.11
134	Q TECHNOLOGY GROUP CO LTD	丘钛科技	1478 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	159,000	1,466,893.30	0.09
135	ANGANG STEEL CO LTD-H	鞍钢股份	347 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	747,200	1,289,967.28	0.08
136	COFCO MEAT HOLDINGS LTD	中粮肉食	1610 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	393,000	918,993.72	0.06
137	TIMES NEIGHBORHOOD HOLDINGS	时代邻里	9928 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	83,000	797,579.27	0.05
138	CHINA HUIZHAN DAIRY HOLDINGS	辉山乳业	6863 HK	香港	中国 香港	4,338,000	-	0.00

				联合交易所				
--	--	--	--	-------	--	--	--	--

7.4.2 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权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	公司名称（中文）	证券代码	所在证券市场	所属国家（地区）	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	WUXI APPTec CO LTD-H	药明康德	2359 HK	香港联合交易所	中国香港	74,240.00	6,828,848.21	0.41
2	ALIBABA PICTURES GROUP LTD	阿里影业	1060 HK	香港联合交易所	中国香港	4,320,000.00	4,064,442.62	0.24
3	UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	统一企业中国	220 HK	香港联合交易所	中国香港	414,000.00	2,919,427.32	0.18
4	YUEXIU PROPERTY CO LTD	越秀地产	123 HK	香港联合交易所	中国香港	2,050,000.00	2,584,121.76	0.16
5	SSY GROUP LTD	石四药集团	2005 HK	香港联	中国香港	532,000.00	2,570,675.92	0.15

				合交易所				
6	HEALTH AND HAPPINESS H&H INT	H&H 国际控股	1112 HK	香港联合交易所	中国香港	70,000.00	2,241,125.04	0.14
7	CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	渝农商行	3618 HK	香港联合交易所	中国香港	774,000.00	2,156,357.81	0.13
8	CHINA HUARONG ASSET MANAGE-H	中国华融	2799 HK	香港联合交易所	中国香港	2,902,000.00	2,067,626.25	0.12
9	CHINA EDUCATION GROUP HOLDIN	中教控股	839 HK	香港联合交易所	中国香港	168,000.00	1,912,085.68	0.12
10	YUZHOU GROUP HOLDINGS CO LTD	禹洲集团	1628 HK	香港联合交易所	中国香港	588,000.00	1,799,294.11	0.11
11	SINO-OCEAN GROUP HOLDING LTD	远洋集团	3377 HK	香港联合交易所	中国香港	1,034,000.00	1,756,764.35	0.11

				所				
12	SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	上海 石化	338 HK	香港 联合 交易 所	中 国 香 港	1,018,000.00	1,729,580.37	0.10
13	CHINA HONGQIAO GROUP LTD	中 国 宏 桥	1378 HK	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	539,000.00	1,693,663.91	0.10
14	BAIC MOTOR CORP LTD-H	北 京 汽 车	1958 HK	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	525,500.00	1,608,042.61	0.10
15	LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN	理 文 造 纸	2314 HK	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	420,000.00	1,595,962.37	0.10
16	JIAYUAN INTERNATIONAL GROUP	佳 源 国 际 控 股	2768 HK	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	404,000.00	1,180,895.23	0.07
17	MAANSHAN IRON & STEEL-H	马 钢 股 份	323 HK	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	572,000.00	1,086,774.37	0.07
18	MMG LTD	五 矿 资 源	1208 HK	香 港	中 国 香 港	720,000.00	1,052,282.88	0.06

				联合交易所				
19	SKYWORTH GROUP LTD	创维集团	751 HK	香港联合交易所	中国香港	430,000.00	852,330.86	0.05
20	MEITU INC	美图公司	1357 HK	香港联合交易所	中国香港	541,000.00	751,139.98	0.05
21	CHINA ORIENTAL GROUP CO LTD	中国东方集团	581 HK	香港联合交易所	中国香港	382,000.00	736,250.91	0.04
22	YANGTZE OPTICAL FIBRE AND-H	长飞光纤	6869 HK	香港联合交易所	中国香港	51,000.00	663,376.67	0.04

7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	2313 HK	25,379,726.15	1.43
2	SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	1918 HK	18,561,421.95	1.05

3	CHINA MENGNIU DAIRY CO	2319 HK	17,205,280.62	0.97
4	SUNNY OPTICAL TECH	2382 HK	16,667,456.90	0.94
5	CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	1093 HK	16,636,243.72	0.94
6	CHINA FEIHE LTD	6186 HK	16,402,575.35	0.92
7	WH GROUP LTD	288 HK	13,885,494.61	0.78
8	GEEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	175 HK	13,130,681.76	0.74
9	WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	2269 HK	12,493,558.69	0.7
10	LI NING CO LTD	2331 HK	12,378,049.59	0.7
11	CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	586 HK	12,092,137.63	0.68
12	CHINA TELECOM CORP LTD-H	728 HK	11,610,658.57	0.65
13	INNOVENT BIOLOGICS INC	1801 HK	10,952,255.47	0.62
14	CHINA RESOURCES BEER HOLDING	291 HK	10,512,983.05	0.59
15	HENGAN INTL GROUP CO LTD	1044 HK	9,487,920.00	0.53
16	WEICHAI POWER CO LTD-H	2338 HK	9,317,442.65	0.53
17	YIHAI INTERNATIONAL HOLDING	1579 HK	9,315,860.02	0.52
18	GUANGDONG INVESTMENT LTD	270 HK	8,761,236.55	0.49
19	SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	981 HK	8,455,411.08	0.48
20	SINOPHARM GROUP CO-H	1099 HK	8,207,802.38	0.46

注：买入金额不包括相关交易费用。

7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称 (英文)	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	SUNNY OPTICAL	2382 HK	21,436,967.84	1.21

	TECH			
2	SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	1918 HK	20,264,608.37	1.14
3	CHINA MENGNIU DAIRY CO	2319 HK	19,666,858.11	1.11
4	ZTE CORP-H	763 HK	19,065,150.88	1.07
5	CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	1093 HK	18,898,277.71	1.06
6	WH GROUP LTD	288 HK	18,677,281.05	1.05
7	WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	2269 HK	16,848,987.08	0.95
8	GEEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	175 HK	16,707,381.87	0.94
9	INNOVENT BIOLOGICS INC	1801 HK	15,510,107.03	0.87
10	YIHAI INTERNATIONAL HOLDING	1579 HK	15,309,862.71	0.86
11	CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	586 HK	14,498,349.73	0.82
12	CHINA RESOURCES BEER HOLDING	291 HK	13,193,141.16	0.74
13	WEICHAI POWER CO LTD-H	2338 HK	13,132,851.99	0.74
14	SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	981 HK	12,249,623.59	0.69
15	LI NING CO LTD	2331 HK	12,118,075.52	0.68
16	HENGAN INTL GROUP CO LTD	1044 HK	11,196,835.14	0.63
17	GUANGDONG INVESTMENT LTD	270 HK	11,173,310.57	0.63
18	WUXI APPTec CO LTD-H	2359 HK	10,522,453.63	0.59
19	HUANENG RENEWA-H	958 HK	9,885,960.23	0.56
20	COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	6098 HK	9,856,363.14	0.56

注：卖出金额不包括相关交易费用。

7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	678,850,428.20
卖出收入（成交）总额	763,622,655.08

注：买入股票成本、卖出股票收入均不包括相关交易费用。

7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1

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。

7.11.2

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.11.3 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	3,943,926.25
2	应收证券清算款	32,207,463.96
3	应收股利	19,325,934.36
4	应收利息	9,359.39
5	应收申购款	3,255,960.33
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	58,742,644.29

7.11.4 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。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.11.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	公司名称	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	1093 HK	石药集团	8,018,307.86	0.48	送股流通受限

7.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前五名积极股票中不存在流通受限情况。

7.11.6 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（%）
香港中小	159,715	6,900.00	460,171,086.24	41.76	641,863,158.45	58.24
华宝香港中小C	5,552	2,572.21	-	-	14,280,927.90	100.00
合计	165,267	6,754.62	460,171,086.24	41.22	656,144,086.35	58.78

8.2 期末上市基金前十名持有人

香港中小

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例（%）
1	冀燕彬	2,751,000.00	3.29
2	张自然	2,314,002.00	2.77
3	邓荣	2,231,312.00	2.67
4	宁波万坤投资管理合伙企业（有限合伙）— 万坤东方点钰指数增强 1 号私募证券投资基金	2,185,532.00	2.62
5	张巍	1,613,436.00	1.93
6	史文婕	1,483,154.00	1.78
7	陈庆林	1,324,075.00	1.59
8	朱庆华	1,299,627.00	1.56
9	郭昕	1,157,800.00	1.39
10	王琪	1,156,396.00	1.38

华宝香港中小 C

8.3 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	香港中小	149,183.07	0.0135
	华宝香港中小 C	1,454.78	0.0102
	合计	150,637.85	0.0135

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	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	香港中小	0
	华宝香港中小 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	香港中小	0
	华宝香港中小 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	香港中小	华宝香港中小 C
基金合同生效日 (2016 年 6 月 24 日) 基金份额总额	431,503,809.43	-
本报告期期初基金份 额总额	1,155,630,988.32	5,762,659.60
本报告期基金总申购 份额	603,613,158.30	73,287,652.59
减：本报告期基金总 赎回份额	657,209,901.93	64,769,384.29
本报告期基金拆分变 动份额（份额减少以 “-”填列）	-	-
本报告期期末基金份 额总额	1,102,034,244.69	14,280,927.90

§ 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

2020 年 5 月 20 日，基金管理人发布高级管理人员变更公告，经公司董事会审议通过，聘任周雷为公司督察长。公司总经理黄小蕙自 2020 年 5 月 20 日起不再代任督察长职务。

2、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金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：本基金合同生效之日起至本报告期末。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、托管人及其高级管理人员未有受到稽查或处罚的情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
招商证券	1	1,186,809,319.14	82.28%	949,452.50	90.28%	-
Daiwa Securities	1	151,356,080.32	10.49%	60,542.43	5.76%	-
SMBC Singapore Ltd						
J. P. Morgan Securities (Asia	1	104,307,683.75	7.23%	41,723.12	3.97%	-

Pacific) Limited						
BOCI Securities Ltd	1	-	-	-	-	-
China Tnternational Capital corporation HK Securities Ltd	1	-	-	-	-	-
Nomura International (HK) Ltd	1	-	-	-	-	-

注：1、基金管理人选择交易单元的标准和程序如下：

（1）选择标准： 资质雄厚，信誉良好；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、本报告期无新增交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期 债券 成交总 额的比例	成交金额	占当期债 券回购 成交总额 的比例	成交金额	占当期 权证 成交总 额的比例	成交金额	占当期 基金 成交总 额的比例

招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
Daiwa Securities SMBC Singapore Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-
J. P. Morgan Securities (Asia Pacific) Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
BOCI Securities Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-
China International Capital corporation HK Securities Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-
Nomura International (HK) Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-

注：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	关于华宝标普香港上市中国中小盘指数证券投资基金（LOF）2020 年开放日的提示性公告	上海证券报、基金管理人网站	2020-01-14
2	华宝标普香港上市中国中小盘指数证券投资基金（LOF）2019 年第 4 季度报告	基金管理人网站	2020-01-21
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、基金管理人网站	2020-01-21
4	华宝基金关于华宝标普香港上市中国中小盘指数证券投资基金（LOF）新增海通证券为代销机构的公告	上海证券报、基金管理人网站	2020-03-03
5	华宝基金关于旗下部分开放式基金新增东方财富证券为代销机构的公告	上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报、基金管理人网站	2020-03-06
6	华宝标普香港上市中国中小盘指数证	基金管理人网站	2020-03-30

	券投资基金 (LOF) 2019 年年度报告		
7	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、基金管理人网站	2020-03-30
8	华宝标普香港上市中国中小盘基金（LOF）因香港交易所休市暂停申购赎回及定期定额投资业务的公告	上海证券报、基金管理人网站	2020-04-07
9	华宝基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加大连网金基金销售有限公司为代销机构及费率优惠的公告	上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报、基金管理人网站	2020-04-14
10	华宝标普香港上市中国中小盘指数证券投资基金 (LOF) 2020 年第 1 季度报告	基金管理人网站	2020-04-21
11	华宝标普香港上市中国中小盘指数证券投资基金 (LOF) 因香港交易所休市暂停申购、赎回及定期定额投资业务的公告	上海证券报、基金管理人网站	2020-04-27
12	华宝基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加上海中欧财富基金销售有限公司为代销机构及费率优惠的公告	上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报、基金管理人网站	2020-05-27
13	华宝基金关于旗下部分基金新增陆享基金公司为代销机构的公告	上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报、基金管理人网站	2020-05-27
14	华宝标普香港上市中国中小盘指数证券投资基金 (LOF) 因香港交易所休市暂停申购、赎回及定期定额投资业务的公告	上海证券报、基金管理人网站	2020-06-29

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20200329-20200329	15,154,201.71	24,205,260.60	39,359,462.31	-	0.00
个人	-	-	-	-	-	-	-

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；

华宝标普香港上市中国中小盘指数证券投资基金（LOF）基金合同；

华宝标普香港上市中国中小盘指数证券投资基金（LOF）招募说明书；

华宝标普香港上市中国中小盘指数证券投资基金（LOF）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

2020 年 8 月 31 日