

# 华宝中证沪港深 500 交易型开放式指数证 券投资基金 2021 年中期报告

2021 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：中国银行股份有限公司

送出日期：2021 年 8 月 27 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 3 月 5 日(基金合同生效日)起至 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 .....	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 .....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	12
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 .....	12
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>12</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 .....	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 .....	12
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>12</b>
6.1 资产负债表 .....	12
6.2 利润表 .....	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表 .....	15
6.4 报表附注 .....	16
<b>§ 7 投资组合报告</b> .....	<b>40</b>
7.1 期末基金资产组合情况 .....	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	40
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 .....	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	54
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	56
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 .....	57
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 .....	57
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 .....	57

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 .....	57
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	57
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	57
7.12 投资组合报告附注 .....	57
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>59</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	59
8.2 期末上市基金前十名持有人 .....	59
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	60
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 .....	60
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>60</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>60</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	60
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 .....	61
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	61
10.4 基金投资策略的改变 .....	61
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	61
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 .....	61
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	61
10.8 其他重大事件 .....	64
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>66</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 .....	66
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	66
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>67</b>
12.1 备查文件目录 .....	67
12.2 存放地点 .....	67
12.3 查阅方式 .....	67

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华宝中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	华宝中证沪港深 500ETF
场内简称	沪港深 ETF500
基金主代码	517060
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2021 年 3 月 5 日
基金管理人	华宝基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	33,767,199.00 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	2021 年 3 月 26 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	本基金主要采取完全复制法，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。对于出现市场流动性不足、港股通额度受限、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。
业绩比较基准	中证沪港深 500 指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。 本基金为被动式投资的股票型指数基金，主要采用组合复制策略，跟踪标的指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。 基金资产投资于港股，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括港股市场股价波动较大的风险、汇率风险、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险等。

### 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	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	周雷	许俊
	联系电话	021-38505888	010-66594319
	电子邮箱	xxpl@fsfund.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-700-5588、400-820-5050、	95566

	021-38924558	
传真	021-38505777	010-66594942
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码	200120	100818
法定代表人	XIAOYI HELEN HUANG	刘连舸

## 2.4 信息披露方式

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

## 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(2021 年 3 月 5 日(基金合同生效日) - 2021 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-598,477.73
本期利润	-140,678.67
加权平均基金份额本期利润	-0.0013
本期加权平均净值利润率	-0.13%
本期基金份额净值增长率	2.04%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	307,609.50
期末可供分配基金份额利润	0.0091
期末基金资产净值	34,456,370.34
期末基金份额净值	1.0204
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	2.04%

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。
- 5、本基金合同在当期生效。

### 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

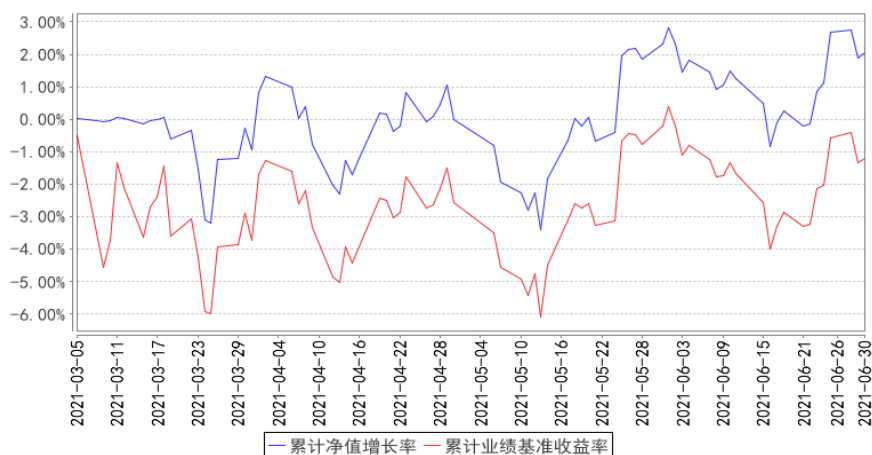
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-0.28%	0.69%	-1.02%	0.73%	0.74%	-0.04%
过去三个月	3.01%	0.82%	2.62%	0.89%	0.39%	-0.07%
过去六个月	-%	-%	-%	-%	-%	-%
过去一年	-%	-%	-%	-%	-%	-%
过去三年	-%	-%	-%	-%	-%	-%
自基金合同生效起至今	2.04%	0.80%	-1.21%	1.05%	3.25%	-0.25%

注：1、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）。

- 2、本基金业绩比较基准为：中证沪港深 500 指数收益率。

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

华宝中证沪港深 500ETF 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： 1、本基金基金合同生效于 2021 年 3 月 5 日，截止报告日本基金基金合同生效未满一年。  
 2、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，截至本报告期末，本基金尚处于建仓期。

## § 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，公司注册资本为人民币 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与美国华平资产管理有限合伙（Warburg Pincus Asset Management, L.P.），持有股权占比分别为 51%和 49%。公司在北京、深圳等地设有分公司，在香港设有子公司——华宝资产管理(香港)有限公司。

截至本报告期末（2021 年 6 月 30 日），本公司正在管理运作的证券投资基金包括：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



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、华宝可转债债券型证券投资基金、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、华宝创新优选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、华宝标普中国 A 股红利机会指数证券投资基金 (LOF)、华宝中证银行交易型开放式指数证券投资基金、华宝绿色主题混合型证券投资基金、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、华宝致远混合型证券投资基金 (QDII)、华宝中证消费龙头指数证券投资基金 (LOF) 等共 108 只基金。

#### 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		
蒋俊阳	本基金基金经理	2021 年 3 月 5 日	-	11 年	硕士。曾先后在上海申银万国证券研究所、光大证券研究所从事资深高级分析师的工作。2018 年 10 月加入华宝基金管理有限公司，先后在量化投资部、指数研发投资部任基金经理助理。2020 年 7 月起任华宝中证电子 50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2020 年 12 月起任华宝中证细分食品饮料产业主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2021 年 3 月起任华宝中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2021 年 6 月起任华宝深证创新 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。

注：1、任职日期以及离任日期均以基金公告为准。

2、证券从业含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《华宝中证沪港深 500 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，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

2021 上半年，全球经济共振复苏是主基调，在疫苗接种加速推进、各国相继推出大规模刺激性财政和货币政策等诸多因素的带动下，上半年全球经济总体恢复势头良好。今年作为“十四五”的开局之年，随着“十四五”规划的正式编制和落地，政策方向逐步明朗，有望注入新的动力。2021 上半年，国内权益市场整体呈现明显的波动行情，不同板块和行业表现差异显著。其中，电气设备、钢铁、化工、采掘等行业表现较好，保险、家用电器、国防军工、房地产等行业表现较弱。本报告期内，作为大盘蓝筹股代表的沪深 300 指数上涨了 0.24%；而作为港股通代表的恒生港股通指数上涨了 7.37%。在本报告期内，中证沪港深 500 指数累计上涨了 2.70%。

本基金成立于 2021 年 3 月 5 日，本报告期涵盖了基金的建仓期。我们在操作中严格遵守基金合同，坚持既定的指数化投资策略，在指数权重调整和基金申赎变动时，应用指数复制和数量化技术降低冲击成本和减少跟踪误差。

#### 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 2.04%，业绩比较基准收益率为-1.21%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观经济与市场方面，展望 2021 年下半年，全球经济复苏的态势或将延续，国内货币政策“稳中趋松”，核心产业的转型升级仍然是国内经济关注的焦点，核心资产的投资仍是资本市场关注的重点领域。证券市场方面，目前市场整体向好，但波动在增加。中证沪港深 500 指数在沪股通、深股通和港股通范围内，选取总市值排名较高的 500 只股票组成样本股，以全面反映沪港深两地三市龙头上市企业股票的整体表现。

作为指数基金的管理人，我们将继续严格遵守基金合同，坚持既定的指数化投资策略，积极应对成分股调整和基金申购赎回，严格控制基金相对目标指数的跟踪误差，实现对中证沪港深 500 指数的有效跟踪。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

##### （1）日常估值流程

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

##### （2）特殊业务估值流程

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

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期亏损，未有应分未分的利润。

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

本报告期内，本基金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，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在华宝中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：华宝中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021年6月30日
<b>资产:</b>		
银行存款	6.4.7.1	2,798,876.50
结算备付金		76,193.70
存出保证金		77,643.65
交易性金融资产	6.4.7.2	31,596,243.63
其中: 股票投资		31,596,243.63
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		1,614,223.55
应收利息	6.4.7.5	381.79
应收股利		101,044.59
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		36,264,607.41
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021年6月30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		-
应付证券清算款		8,897.04
应付赎回款		-
应付管理人报酬		16,097.78
应付托管费		3,219.56
应付销售服务费		-
应付交易费用	6.4.7.7	149,387.15
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	1,630,635.54
负债合计		1,808,237.07
<b>所有者权益:</b>		
实收基金	6.4.7.9	33,767,199.00
未分配利润	6.4.7.10	689,171.34

所有者权益合计		34,456,370.34
负债和所有者权益总计		36,264,607.41

注：1. 本基金合同生效日为 2021 年 03 月 05 日，本报告期自基金合同生效日 2021 年 03 月 05 日起至 2021 年 06 月 30 日止。

2. 报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.0204 元，基金份额总额 33,767,199.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：华宝中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2021 年 3 月 5 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 3 月 5 日（基金合同 生效日）至 2021 年 6 月 30 日
一、收入		725,381.71
1. 利息收入		56,766.59
其中：存款利息收入	6.4.7.11	56,766.59
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）		-119,616.37
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-508,114.95
基金投资收益	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-
股利收益	6.4.7.16	388,498.58
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	457,799.06
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	330,432.43
减：二、费用		866,060.38
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	168,218.93
2. 托管费	6.4.10.2.2	33,643.81
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-
4. 交易费用	6.4.7.19	588,185.26

5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		-
7. 其他费用	6.4.7.20	76,012.38
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-140,678.67
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-140,678.67

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华宝中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2021 年 3 月 5 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 3 月 5 日（基金合同生效日）至 2021 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）	222,767,199.00	-	222,767,199.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-140,678.67	-140,678.67
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）	-189,000,000.00	829,850.01	-188,170,149.99
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-189,000,000.00	829,850.01	-188,170,149.99
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）	33,767,199.00	689,171.34	34,456,370.34

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>黄小意</u>	<u>向辉</u>	<u>张幸骏</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

华宝中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”),系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2021]210 号文《关于准予华宝中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》准予注册,由华宝基金管理有限公司于 2021 年 2 月 18 日至 2021 年 3 月 1 日止期间向社会公开募集,募集期结束经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)验证并出具安永华明(2021)验字第 61471289\_B07 号验资报告后,向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2021 年 3 月 5 日生效。本基金为交易型开放式基金,存续期限为不定期,设立时募集的扣除认购费后的实收基金(本金)为人民币 222,766,000.00 元,折合 222,766,000.00 份基金份额;在募集期间产生利息为人民币 1,199.00 元。以上实收基金合计为人民币 222,767,199.00 元,折合 222,767,199.00 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,基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、截至报告期末最新公告的基金合同及《华宝中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金主要投资于标的指数成份股和备选成份股。为更好地实现基金的投资目标,本基金可能会少量投资于国内依法发行上市的非成份股(包括中小板、创业板、存托凭证、港股通标的股票及其他经中国证监会允许上市的其他股票)、债券(包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、债券回购、货币市场工具、股指期货、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金可根据法律法规的规定参与转融通证券出借业务和融资业务。

本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%,且不低于非现金基金资产的 80%;股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

本基金的业绩比较基准为:中证沪港深 500 指数收益率。

本财务报表由本基金的基金管理人华宝基金管理有限公司于 2021 年 8 月 27 日批准报出。



## 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）和在财务报表附注所列示依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证监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 2 号《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〉》、其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

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 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年 3 月 5 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

## 6.4.4 重要会计政策和会计估计

### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间系 2021 年 3 月 5 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日止期间。

### 6.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

#### (1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

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主要包括股票投资和债券投资等；

#### (2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。

本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

#### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券等，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产

或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

#### 6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 转融通证券出借业务利息收入按出借起始日证券账面价值及出借费率计算的金额，在转融通证券实际出借期间内逐日计提。因借入人未能按期归还产生的罚息，实际发生时计入转融通证券出借业务利息收入；

(6) 股票投资收益/（损失）于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(7) 债券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(8) 资产支持证券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(9) 股指/国债期货投资收益/(损失)于平仓日确认,并按平仓成交金额与其初始合约价值的差额入账;

(10) 权证收益/(损失)于卖出权证成交日确认,并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账;

(11) 股利收益于除息日确认,并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账;

(12) 公允价值变动收益/(损失)系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、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失;

(13) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方,经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 每一基金份额享有同等分配权;

(2) 本基金基金份额的收益分配方式采用现金分红;

(3) 本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点,本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提,收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值;

(4) 若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配;

(5) 法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。证券交易所或基金登记机构对收益分配另有规定的,从其规定。

#### 6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部,以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分:(1)该组成

部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

#### 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

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 6.4.6 税项

##### (1) 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

##### (2) 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，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，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；

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，自 2018 年 1 月 1 日起，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，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。

### (3) 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011 年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

### (4) 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

### (5) 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等

收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自2008年10月9日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自2013年1月1日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂减按25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自2015年9月8日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
活期存款	2,798,876.50
定期存款	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	-
合计	2,798,876.50

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	31,138,444.57	31,596,243.63	457,799.06
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	31,138,444.57	31,596,243.63	457,799.06

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

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 2021年6月30日
应收活期存款利息	256.53
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	88.53
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	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	36.73
合计	381.79

#### 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 2021年6月30日
交易所市场应付交易费用	149,387.15

银行间市场应付交易费用	-
合计	149,387.15

## 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021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	-
预提费用	71,739.19
应退替代款	1,558,896.35
合计	1,630,635.54

## 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年3月5日（基金合同生效日）至2021年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	222,767,199.00	222,767,199.00
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-189,000,000.00	-189,000,000.00
- 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	33,767,199.00	33,767,199.00

## 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-598,477.73	457,799.06	-140,678.67
本期基金份额交易产生的变动数	906,087.23	-76,237.22	829,850.01
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	906,087.23	-76,237.22	829,850.01
本期已分配利润	-	-	-
本期末	307,609.50	381,561.84	689,171.34

## 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年3月5日（基金合同生效日）至2021年6月30日
活期存款利息收入	42,264.33
定期存款利息收入	-

其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	13,529.99
其他	972.27
合计	56,766.59

#### 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 2021年3月5日（基金合同生效日）至2021年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-78,128.52
股票投资收益——赎回差价收入	-429,986.43
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	-508,114.95

##### 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 2021年3月5日（基金合同生效日）至2021年6月30日
卖出股票成交总额	134,448,967.79
减：卖出股票成本总额	134,527,096.31
买卖股票差价收入	-78,128.52

##### 6.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年3月5日（基金合同生效日）至2021年6月30日
赎回基金份额对价总额	188,170,149.99
减：现金支付赎回款总额	123,096,965.99
减：赎回股票成本总额	65,503,170.43
赎回差价收入	-429,986.43

#### 6.4.7.13 债券投资收益

##### 6.4.7.13.1 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。

##### 6.4.7.13.2 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。

##### 6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无债券投资收益。

##### 6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无债券投资收益。

##### 6.4.7.13.5 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。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

##### 6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

##### 6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内无衍生工具收益。

##### 6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

#### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2021年3月5日（基金合同生效日）至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	388,498.58
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	388,498.58

## 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2021年3月5日（基金合同生效日）至2021年6月30日
1. 交易性金融资产	457,799.06
股票投资	457,799.06
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	457,799.06

## 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年3月5日（基金合同生效日）至2021年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	292,278.46
其他	38,153.97
合计	330,432.43

## 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年3月5日（基金合同生效日）至2021年6月30日
交易所市场交易费用	588,185.26
银行间市场交易费用	-
合计	588,185.26

## 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年3月5日（基金合同生效日）至2021年6月30日
审计费用	23,444.24

信息披露费	42,980.32
证券出借违约金	-
银行费用	3,873.19
其他	400.00
IOPV 计算与发布费用	5,314.63
合计	76,012.38

#### 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，本基金无需要披露的重大或有事项。

##### 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
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	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
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
华宝投资有限公司（“华宝投资”）	受宝武集团控制的公司
宝武集团财务有限责任公司（“宝武财务”）	受宝武集团控制的公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内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 2021年3月5日（基金合同生效日）至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	168,218.93
其中：支付销售机构的客户维护费	-

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金的管理费按前一日基金资产净值的0.50%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 2021年3月5日（基金合同生效日）至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	33,643.81

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**

本基金本报告期内未发生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**

本基金本报告期内未发生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**

本报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

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

本基金本期末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

**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 2021年3月5日（基金合同生效日）至2021年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国银行股份有限公司	2,798,876.50	42,264.33

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，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(2021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
002024	苏宁易购	2021年6月16日	重大事项停牌	5.59	2021年7月6日	6.15	1,900	13,681.68	10,621.00	-
01114	BRILLIANCE CHI	2021年3月31日	重大事项停牌	6.07	-	-	20,000	117,795.47	121,483.68	-

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

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

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

#### 6.4.13.2 信用风险

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

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

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

于本报告期末，本基金无债券投资。

### 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、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家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，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；并开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

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

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	2,798,876.50	-	-	-	2,798,876.50
结算备付金	76,193.70	-	-	-	76,193.70
存出保证金	77,643.65	-	-	-	77,643.65
交易性金融资产	-	-	-	31,596,243.63	31,596,243.63

应收利息	-	-	-	381.79	381.79
应收股利	-	-	-	101,044.59	101,044.59
应收证券清算款	-	-	-	1,614,223.55	1,614,223.55
资产总计	2,952,713.85	-	-	33,311,893.56	36,264,607.41
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	16,097.78	16,097.78
应付托管费	-	-	-	3,219.56	3,219.56
应付证券清算款	-	-	-	8,897.04	8,897.04
应付交易费用	-	-	-	149,387.15	149,387.15
其他负债	-	-	-	1,630,635.54	1,630,635.54
负债总计	-	-	-	1,808,237.07	1,808,237.07
利率敏感度缺口	2,952,713.85	-	-	31,503,656.49	34,456,370.34

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金的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

项目	本期末 2021年6月30日			
	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				
交易性金融资产	-	14,730,035.98	-	14,730,035.98
资产合计	-	14,730,035.98	-	14,730,035.98
以外币计价的 负债				
负债合计	-	-	-	-

资产负债表外 汇风险敞口净 额	-	14,730,035.98	-	14,730,035.98
-----------------------	---	---------------	---	---------------

#### 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（2021年6月30日）
分析	1. 所有外币相对人民币升值 5%	736,501.80
	2. 所有外币相对人民币贬值 5%	-736,501.80

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，以复制、跟踪中证沪港深 500 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、备选成份股等进行替代，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中证沪港深 500 指数，通过指数化分散投资降低其他价格风险。本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%，同时为更好地实现投资目标，本基金也可少量于国内依法发行上市的非成份股、债券、货币市场工具、权证、股指期货、资产支持证券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。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 2021年6月30日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	31,596,243.63	91.70
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	31,596,243.63	91.70

## 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于本报告期末，本基金成立尚未满一年，无足够历史经验数据计算其他价格风险对基金资产净值的影响。

## 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

## (1) 公允价值

## (a) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括银行存款、结算备付金、存出保证金、应收证券清算款、应收利息以及其他金融负债，其因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

## (b) 以公允价值计量的金融工具

## (i) 各层次金融工具公允价值

于本报告期末，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人民币 31,464,138.95 元，第二层次的余额为人民币 132,104.68 元，无划分为第三层次的余额。

## (ii) 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。

## (iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

本基金于本报告期初未持有公允价值归属于第三层次的金融工具，本基金本报告期未发生第三层次公允价值转入转出情况。

(2) 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大承诺事项。

(3) 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的其他重要事项。

## § 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	31,596,243.63	87.13
	其中：股票	31,596,243.63	87.13
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	2,875,070.20	7.93
8	其他各项资产	1,793,293.58	4.95
9	合计	36,264,607.41	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，两者在金额上不相等。

2. 通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 14,730,035.98 元，占基金资产净值的比例为 42.75%。

### 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	134,015.00	0.39
B	采矿业	300,903.00	0.87



C	制造业	10,043,395.35	29.15
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	230,915.00	0.67
E	建筑业	152,772.00	0.44
F	批发和零售业	81,299.50	0.24
G	交通运输、仓储和邮政业	443,232.00	1.29
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	525,783.50	1.53
J	金融业	3,611,990.40	10.48
K	房地产业	269,854.00	0.78
L	租赁和商务服务业	261,634.00	0.76
M	科学研究和技术服务业	301,112.20	0.87
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	8,356.00	0.02
Q	卫生和社会工作	436,040.70	1.27
R	文化、体育和娱乐业	64,905.00	0.19
S	综合	-	-
	合计	16,866,207.65	48.95

### 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

本基金本报告期末未持有积极投资部分的股票投资。

### 7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
能源	282,241.54	0.82
原材料	149,558.06	0.43
工业	678,627.79	1.97
非日常生活消费品	2,525,848.74	7.33
日常消费品	547,558.55	1.59
医疗保健	1,056,254.84	3.07
金融	3,951,741.80	11.47
信息技术	935,698.92	2.72
通信服务	2,844,552.84	8.26
公用事业	520,325.42	1.51

房地产	1,237,627.48	3.59
合计	14,730,035.98	42.75

注：本基金对以上行业分类采用全球行业分类标准。

### 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	00700	腾讯控股	5,100	2,478,267.07	7.19
2	03690	美团-W	4,400	1,173,033.10	3.40
3	601318	中国平安	8,800	565,664.00	1.64
3	02318	中国平安	6,000	379,678.10	1.10
4	600519	贵州茅台	400	822,680.00	2.39
5	01299	友邦保险	9,600	770,838.91	2.24
6	600036	招商银行	9,000	487,710.00	1.42
6	03968	招商银行	4,000	220,501.20	0.64
7	00005	汇丰控股	16,000	597,100.61	1.73
8	300750	宁德时代	1,100	588,280.00	1.71
9	00939	建设银行	95,000	482,980.84	1.40
9	601939	建设银行	4,300	28,595.00	0.08
10	000858	五粮液	1,500	446,835.00	1.30
11	00388	香港交易所	1,000	385,086.62	1.12
12	01398	工商银行	68,000	258,011.37	0.75
12	601398	工商银行	21,700	112,189.00	0.33
13	02269	药明生物	3,000	355,214.95	1.03
14	01810	小米集团-W	15,600	350,472.10	1.02
15	601012	隆基股份	2,920	259,412.80	0.75
16	600276	恒瑞医药	3,720	252,848.40	0.73
17	002415	海康威视	3,900	251,550.00	0.73
18	000333	美的集团	3,500	249,795.00	0.72
19	601166	兴业银行	11,900	244,545.00	0.71
20	600030	中信证券	7,800	194,532.00	0.56
20	06030	中信证券	3,000	48,626.76	0.14
21	300760	迈瑞医疗	500	240,025.00	0.70
22	300059	东方财富	6,920	226,906.80	0.66
23	00941	中国移动	5,500	222,186.16	0.64
24	002594	比亚迪	500	125,500.00	0.36
24	01211	比亚迪股份	500	96,604.49	0.28
25	000651	格力电器	3,900	203,190.00	0.59
26	603259	药明康德	1,280	200,435.20	0.58
27	03988	中国银行	65,000	150,897.71	0.44

27	601988	中国银行	12,500	38,500.00	0.11
28	600887	伊利股份	5,000	184,150.00	0.53
29	000001	平安银行	8,100	183,222.00	0.53
30	601888	中国中免	600	180,060.00	0.52
31	00669	创科实业	1,500	169,245.07	0.49
32	603501	韦尔股份	500	161,000.00	0.47
33	02628	中国人寿	8,000	102,512.26	0.30
33	601628	中国人寿	1,700	57,613.00	0.17
34	02331	李宁	2,000	157,762.37	0.46
35	000725	京东方 A	24,800	154,752.00	0.45
36	600031	三一重工	5,300	154,071.00	0.45
37	02020	安踏体育	1,000	152,104.22	0.44
38	600900	长江电力	7,300	150,672.00	0.44
39	000002	万科 A	4,600	109,526.00	0.32
39	02202	万科企业	2,000	40,439.09	0.12
40	002304	洋河股份	700	145,040.00	0.42
41	601328	交通银行	16,900	82,810.00	0.24
41	03328	交通银行	14,000	60,808.41	0.18
42	02382	舜宇光学科技	700	142,934.70	0.41
43	600309	万华化学	1,300	141,466.00	0.41
44	06160	百济神州	800	140,588.24	0.41
45	600436	片仔癀	300	134,490.00	0.39
46	600809	山西汾酒	300	134,400.00	0.39
47	002475	立讯精密	2,900	133,400.00	0.39
48	603288	海天味业	1,020	131,529.00	0.38
49	02313	申洲国际	800	130,536.71	0.38
50	600585	海螺水泥	1,900	77,995.00	0.23
50	00914	海螺水泥	1,500	51,422.54	0.15
51	00002	中电控股	2,000	127,807.49	0.37
52	00001	长和	2,500	125,852.10	0.37
53	601919	中远海控	4,100	125,214.00	0.36
54	600763	通策医疗	300	123,300.00	0.36
55	01114	BRILLIANCE CHI	20,000	121,483.68	0.35
56	002812	恩捷股份	500	117,050.00	0.34
57	000661	长春高新	300	116,100.00	0.34
58	300347	泰格医药	600	115,980.00	0.34
59	002352	顺丰控股	1,700	115,090.00	0.33
60	002230	科大讯飞	1,700	114,886.00	0.33
61	300015	爱尔眼科	1,615	114,632.70	0.33
62	01801	信达生物	1,500	113,017.27	0.33

63	01113	长实集团	2,500	111,498.72	0.32
64	00386	中国石油化工股份	24,000	78,481.79	0.23
64	600028	中国石化	7,400	32,264.00	0.09
65	09633	农夫山泉	3,400	110,192.35	0.32
66	01288	农业银行	24,000	53,918.78	0.16
66	601288	农业银行	17,700	53,631.00	0.16
67	00003	香港中华煤气	10,600	106,369.78	0.31
68	01109	华润置地	4,000	104,675.66	0.30
69	00027	银河娱乐	2,000	103,427.54	0.30
70	002714	牧原股份	1,700	103,394.00	0.30
71	00011	恒生银行	800	103,244.49	0.30
72	00883	中国海洋石油	14,000	102,861.73	0.30
73	00175	吉利汽车	5,000	101,721.78	0.30
74	601601	中国太保	1,800	52,146.00	0.15
74	02601	中国太保	2,400	48,826.45	0.14
75	02388	中银香港	4,500	98,663.89	0.29
76	02688	新奥能源	800	98,385.14	0.29
77	002142	宁波银行	2,500	97,425.00	0.28
78	06618	京东健康	1,050	97,241.03	0.28
79	00016	新鸿基地产	1,000	96,271.66	0.28
80	002271	东方雨虹	1,700	94,044.00	0.27
81	00857	中国石油股份	20,000	62,905.25	0.18
81	601857	中国石油	5,400	28,566.00	0.08
82	601088	中国神华	2,700	52,704.00	0.15
82	01088	中国神华	3,000	37,992.77	0.11
83	01928	金沙中国有限公司	3,200	87,068.85	0.25
84	06690	海尔智家	2,000	45,098.74	0.13
84	600690	海尔智家	1,600	41,456.00	0.12
85	300142	沃森生物	1,400	86,380.00	0.25
86	300782	卓胜微	160	86,000.00	0.25
87	002371	北方华创	300	83,214.00	0.24
88	601899	紫金矿业	8,500	82,365.00	0.24
89	601688	华泰证券	5,200	82,160.00	0.24
90	600000	浦发银行	8,200	82,000.00	0.24
91	300274	阳光电源	700	80,542.00	0.23
92	00981	中芯国际	4,000	79,546.85	0.23
93	300896	爱美客	100	78,888.00	0.23

94	000568	泸州老窖	334	78,803.96	0.23
95	601816	京沪高铁	14,800	78,292.00	0.23
96	02319	蒙牛乳业	2,000	78,132.31	0.23
97	600438	通威股份	1,800	77,886.00	0.23
98	002049	紫光国微	500	77,095.00	0.22
99	01177	中国生物制药	12,000	76,085.40	0.22
100	01997	九龙仓置业	2,000	75,136.82	0.22
101	01093	石药集团	8,000	74,820.63	0.22
102	600016	民生银行	13,100	57,771.00	0.17
102	01988	民生银行	5,500	17,024.36	0.05
103	300122	智飞生物	400	74,692.00	0.22
104	002821	凯莱英	200	74,520.00	0.22
105	300601	康泰生物	500	74,500.00	0.22
106	000338	潍柴动力	4,100	73,267.00	0.21
107	300014	亿纬锂能	700	72,751.00	0.21
108	00960	龙湖集团	2,000	72,390.96	0.21
109	00066	港铁公司	2,000	71,974.92	0.21
110	06969	思摩尔国际	2,000	71,642.09	0.21
111	000100	TCL 科技	9,300	71,145.00	0.21
112	06098	碧桂园服务	1,000	69,811.51	0.20
113	06186	中国飞鹤	5,000	69,728.30	0.20
114	000538	云南白药	600	69,432.00	0.20
115	601799	星宇股份	300	67,716.00	0.20
116	01918	融创中国	3,000	66,524.80	0.19
117	000063	中兴通讯	2,000	66,460.00	0.19
118	00268	金蝶国际	3,000	65,775.92	0.19
119	300759	康龙化成	300	65,097.00	0.19
120	01658	邮储银行	11,000	47,869.56	0.14
120	601658	邮储银行	3,300	16,566.00	0.05
121	01833	平安好医生	800	64,369.71	0.19
122	002027	分众传媒	6,800	63,988.00	0.19
123	603882	金城医学	400	63,908.00	0.19
124	601211	国泰君安	3,700	63,418.00	0.18
125	01066	威高股份	4,000	60,309.16	0.18
126	00384	中国燃气	3,000	59,160.89	0.17
127	00688	中国海外发展	4,000	58,711.56	0.17
128	002791	坚朗五金	300	58,215.00	0.17
129	600745	闻泰科技	600	58,140.00	0.17
130	00853	微创医疗	1,000	57,954.37	0.17
131	02007	碧桂园	8,000	57,912.77	0.17

132	002129	中环股份	1,500	57,900.00	0.17
133	600600	青岛啤酒	500	57,825.00	0.17
134	00241	阿里健康	4,000	57,313.67	0.17
135	601668	中国建筑	12,300	57,195.00	0.17
136	03692	翰森制药	2,000	56,581.44	0.16
137	600660	福耀玻璃	1,000	55,850.00	0.16
138	00968	信义光能	4,000	55,782.64	0.16
139	00267	中信股份	8,000	55,716.08	0.16
140	03908	中金公司	2,000	34,780.94	0.10
140	601995	中金公司	300	18,450.00	0.05
141	600588	用友网络	1,600	53,216.00	0.15
142	00868	信义玻璃	2,000	52,670.66	0.15
143	300124	汇川技术	700	51,982.00	0.15
144	300454	深信服	200	51,896.00	0.15
145	300595	欧普康视	500	51,775.00	0.15
146	09992	泡泡玛特	800	51,256.13	0.15
147	300866	安克创新	300	50,241.00	0.15
148	601229	上海银行	6,100	50,020.00	0.15
149	002841	视源股份	400	49,716.00	0.14
150	00004	九龙仓集团	2,000	49,259.14	0.14
151	002460	赣锋锂业	400	48,436.00	0.14
152	02018	瑞声科技	1,000	48,343.85	0.14
153	002050	三花智控	2,000	47,960.00	0.14
154	00101	恒隆地产	3,000	47,079.09	0.14
155	600048	保利地产	3,800	45,752.00	0.13
156	603799	华友钴业	400	45,680.00	0.13
157	603986	兆易创新	240	45,096.00	0.13
158	00998	中信银行	10,000	30,620.54	0.09
158	601998	中信银行	2,800	14,280.00	0.04
159	600919	江苏银行	6,300	44,730.00	0.13
160	00992	联想集团	6,000	44,582.85	0.13
161	00019	太古股份公 司 A	1,000	43,809.01	0.13
162	01821	ESR	2,000	43,600.99	0.13
163	600019	宝钢股份	5,700	43,548.00	0.13
164	01579	颐海国际	1,000	43,392.97	0.13
165	01044	恒安国际	1,000	43,268.16	0.13
166	300529	健帆生物	500	43,180.00	0.13
167	00772	阅文集团	600	43,110.06	0.13
168	601100	恒立液压	500	42,960.00	0.12
169	300999	金龙鱼	500	42,480.00	0.12
170	00285	比亚迪电子	1,000	42,436.08	0.12

171	601169	北京银行	8,700	42,369.00	0.12
172	603899	晨光文具	500	42,280.00	0.12
173	600760	中航沈飞	700	42,210.00	0.12
174	002236	大华股份	2,000	42,200.00	0.12
175	600346	恒力石化	1,600	41,984.00	0.12
176	601766	中国中车	6,800	41,344.00	0.12
177	300433	蓝思科技	1,400	41,174.00	0.12
178	00586	海螺创业	1,500	40,813.52	0.12
179	002311	海大集团	500	40,800.00	0.12
180	00083	信和置业	4,000	40,738.64	0.12
181	06666	恒大物业	5,000	40,563.90	0.12
182	600837	海通证券	3,500	40,250.00	0.12
183	600132	重庆啤酒	200	39,590.00	0.11
184	600741	华域汽车	1,500	39,405.00	0.11
185	000776	广发证券	2,600	39,364.00	0.11
186	603160	汇顶科技	300	38,889.00	0.11
187	03888	金山软件	1,000	38,733.32	0.11
188	601233	桐昆股份	1,600	38,544.00	0.11
189	01038	长江基建集团	1,000	38,525.30	0.11
190	600547	山东黄金	2,000	38,440.00	0.11
191	600926	杭州银行	2,600	38,350.00	0.11
192	600298	安琪酵母	700	38,066.00	0.11
193	300661	圣邦股份	150	37,909.50	0.11
194	00288	万洲国际	6,500	37,751.47	0.11
195	300677	英科医疗	300	37,440.00	0.11
196	600570	恒生电子	400	37,300.00	0.11
197	00270	粤海投资	4,000	37,144.05	0.11
198	300888	稳健医疗	300	37,086.00	0.11
199	300676	华大基因	300	35,580.00	0.10
200	600104	上汽集团	1,600	35,152.00	0.10
201	00522	ASM PACIFIC	400	35,013.93	0.10
202	601009	南京银行	3,300	34,716.00	0.10
203	601390	中国中铁	6,600	34,584.00	0.10
204	601818	光大银行	9,100	34,398.00	0.10
205	300413	芒果超媒	500	34,300.00	0.10
206	06862	海底捞	1,000	34,032.07	0.10
207	02328	中国财险	6,000	33,948.86	0.10
208	603589	口子窖	500	33,845.00	0.10
209	300033	同花顺	300	33,834.00	0.10
210	00788	中国铁塔	38,000	33,832.37	0.10
211	603517	绝味食品	400	33,716.00	0.10

212	600872	中炬高新	800	33,616.00	0.10
213	00017	新世界发展	1,000	33,574.43	0.10
214	300628	亿联网络	400	33,520.00	0.10
215	00656	复星国际	3,500	32,559.29	0.09
216	603369	今世缘	600	32,496.00	0.09
217	300558	贝达药业	300	32,472.00	0.09
218	00909	明源云	1,000	32,076.68	0.09
219	600958	东方证券	3,200	31,968.00	0.09
220	06110	滔搏	3,000	31,752.17	0.09
221	00813	世茂集团	2,000	31,685.61	0.09
222	000157	中联重科	3,400	31,416.00	0.09
223	600143	金发科技	1,500	31,290.00	0.09
224	002601	龙佰集团	900	31,122.00	0.09
225	601377	兴业证券	3,200	30,912.00	0.09
225	603816	顾家家居	400	30,912.00	0.09
226	01378	中国宏桥	3,500	30,637.19	0.09
227	00012	恒基地产	1,000	30,620.54	0.09
228	01876	百威亚太	1,500	30,578.94	0.09
229	03323	中国建材	4,000	30,354.28	0.09
230	002241	歌尔股份	700	29,918.00	0.09
231	300253	卫宁健康	1,830	29,774.10	0.09
232	000860	顺鑫农业	700	29,526.00	0.09
233	00728	中国电信	12,000	29,056.23	0.08
234	600009	上海机场	600	28,878.00	0.08
235	600196	复星医药	400	28,852.00	0.08
236	601021	春秋航空	500	28,450.00	0.08
237	601225	陕西煤业	2,400	28,440.00	0.08
238	603833	欧派家居	200	28,392.00	0.08
239	002508	老板电器	600	27,900.00	0.08
240	00151	中国旺旺	6,000	27,458.64	0.08
241	603659	璞泰来	200	27,320.00	0.08
242	002410	广联达	400	27,280.00	0.08
243	01691	JS 环球生活	1,500	27,271.42	0.08
244	601901	方正证券	2,900	27,144.00	0.08
245	01972	太古地产	1,400	26,967.71	0.08
246	00881	中升控股	500	26,876.18	0.08
247	002736	国信证券	2,500	26,875.00	0.08
248	01209	华润万象生活	600	26,535.03	0.08
249	300450	先导智能	440	26,461.60	0.08
250	000066	中国长城	1,800	26,280.00	0.08
251	000938	紫光股份	1,200	26,256.00	0.08



252	600406	国电南瑞	1,120	26,028.80	0.08
253	002493	荣盛石化	1,500	25,905.00	0.08
254	00966	中国太平	2,400	25,801.14	0.07
255	00322	康师傅控股	2,000	25,794.48	0.07
256	002202	金风科技	2,100	25,536.00	0.07
257	002001	新和成	880	25,238.40	0.07
258	300144	宋城演艺	1,500	25,200.00	0.07
259	02689	玖龙纸业	3,000	24,862.55	0.07
260	601600	中国铝业	4,600	24,380.00	0.07
261	01516	融创服务	1,000	24,005.51	0.07
262	000596	古井贡酒	100	23,950.00	0.07
263	00135	昆仑能源	4,000	23,830.77	0.07
264	000768	中航西飞	900	23,652.00	0.07
265	601878	浙商证券	1,800	23,544.00	0.07
266	002405	四维图新	1,600	23,520.00	0.07
267	600118	中国卫星	800	23,408.00	0.07
268	300308	中际旭创	600	23,112.00	0.07
269	600999	招商证券	1,200	22,824.00	0.07
270	600536	中国软件	400	22,772.00	0.07
271	600010	包钢股份	14,600	22,630.00	0.07
272	002180	纳思达	700	22,540.00	0.07
273	300003	乐普医疗	700	22,484.00	0.07
274	003816	中国广核	8,400	22,428.00	0.07
275	600061	国投资本	2,640	22,413.60	0.07
276	002916	深南电路	200	22,226.00	0.06
277	603939	益丰药房	390	21,875.10	0.06
278	601966	玲珑轮胎	500	21,870.00	0.06
279	601633	长城汽车	500	21,795.00	0.06
280	000703	恒逸石化	1,800	21,510.00	0.06
281	600893	航发动力	400	21,276.00	0.06
282	300869	康泰医学	300	21,246.00	0.06
283	300408	三环集团	500	21,210.00	0.06
284	00762	中国联通	6,000	21,168.12	0.06
284	00880	澳博控股	3,000	21,168.12	0.06
285	600038	中直股份	400	21,096.00	0.06
286	603806	福斯特	200	21,026.00	0.06
287	601111	中国国航	2,700	21,006.00	0.06
288	601555	东吴证券	2,500	20,850.00	0.06
289	000069	华侨城 A	2,800	20,832.00	0.06
290	01128	永利澳门	2,000	20,336.04	0.06
291	002600	领益智造	2,200	20,218.00	0.06
292	603195	公牛集团	100	20,200.00	0.06

293	600886	国投电力	2,100	20,181.00	0.06
294	00884	旭辉控股集团	4,000	20,169.62	0.06
295	000166	申万宏源	4,300	20,124.00	0.06
296	600845	宝信软件	390	19,851.00	0.06
297	600079	人福医药	700	19,789.00	0.06
298	601989	中国重工	4,700	19,364.00	0.06
299	601669	中国电建	5,000	19,350.00	0.06
300	03380	龙光集团	2,000	19,337.54	0.06
301	600703	三安光电	600	19,230.00	0.06
302	00144	招商局港口	2,000	18,871.57	0.05
303	300498	温氏股份	1,300	18,681.00	0.05
304	600111	北方稀土	900	18,630.00	0.05
305	300832	新产业	300	18,480.00	0.05
306	000963	华东医药	400	18,404.00	0.05
307	601336	新华保险	400	18,364.00	0.05
308	002007	华兰生物	500	18,340.00	0.05
309	002044	美年健康	2,000	18,220.00	0.05
310	002938	鹏鼎控股	500	17,940.00	0.05
311	600352	浙江龙盛	1,300	17,862.00	0.05
312	01929	周大福	1,200	17,713.32	0.05
313	600050	中国联通	4,100	17,712.00	0.05
314	002385	大北农	2,600	17,680.00	0.05
315	00836	华润电力	2,000	17,640.10	0.05
316	002127	南极电商	1,800	17,586.00	0.05
317	00817	中国金茂	8,000	17,307.26	0.05
318	601456	国联证券	1,100	16,940.00	0.05
319	00008	电讯盈科	5,000	16,932.83	0.05
320	600332	白云山	500	16,925.00	0.05
321	03333	中国恒大	2,000	16,841.30	0.05
322	002555	三七互娱	700	16,814.00	0.05
323	03383	雅居乐集团	2,000	16,741.45	0.05
324	002157	正邦科技	1,400	16,730.00	0.05
325	601155	新城控股	400	16,640.00	0.05
326	002294	信立泰	500	16,450.00	0.05
326	300146	汤臣倍健	500	16,450.00	0.05
327	02588	中银航空租赁	300	16,350.37	0.05
328	601808	中海油服	1,100	15,796.00	0.05
329	000786	北新建材	400	15,700.00	0.05
330	002673	西部证券	1,900	15,675.00	0.05
331	02282	美高梅中国	1,600	15,656.42	0.05

332	002064	华峰化学	1,100	15,620.00	0.05
333	002185	华天科技	1,000	15,390.00	0.04
334	001979	招商蛇口	1,400	15,330.00	0.04
335	601985	中国核电	2,900	14,674.00	0.04
336	000425	徐工机械	2,300	14,651.00	0.04
337	601698	中国卫通	900	14,571.00	0.04
338	603866	桃李面包	460	14,352.00	0.04
339	601788	光大证券	800	14,312.00	0.04
340	600089	特变电工	1,100	14,135.00	0.04
341	601186	中国铁建	1,900	14,117.00	0.04
342	000783	长江证券	1,900	13,908.00	0.04
343	03808	中国重汽	1,000	13,845.81	0.04
344	06993	蓝月亮集团	1,500	13,704.36	0.04
345	600161	天坛生物	400	13,700.00	0.04
346	600219	南山铝业	3,800	13,680.00	0.04
347	601990	南京证券	1,300	13,676.00	0.04
348	688009	中国通号	2,400	13,656.00	0.04
349	601877	正泰电器	400	13,352.00	0.04
350	600848	上海临港	740	13,246.00	0.04
351	600177	雅戈尔	2,000	13,180.00	0.04
352	002153	石基信息	560	13,165.60	0.04
353	000625	长安汽车	500	13,140.00	0.04
354	01813	合景泰富集团	1,500	12,980.45	0.04
355	600176	中国巨石	829	12,857.79	0.04
356	600705	中航产融	3,300	12,771.00	0.04
357	002032	苏泊尔	200	12,758.00	0.04
358	000895	双汇发展	400	12,720.00	0.04
359	600029	南方航空	2,100	12,642.00	0.04
360	603707	健友股份	300	12,525.00	0.04
361	600015	华夏银行	2,000	12,380.00	0.04
362	300136	信维通信	400	12,352.00	0.04
363	01313	华润水泥控股	2,000	12,281.50	0.04
364	603233	大参林	240	12,266.40	0.04
365	01030	新城发展	2,000	12,248.22	0.04
366	603658	安图生物	160	12,123.20	0.04
367	002008	大族激光	300	12,117.00	0.04
368	002252	上海莱士	1,600	11,984.00	0.03
369	000728	国元证券	1,500	11,955.00	0.03
369	002624	完美世界	500	11,955.00	0.03
370	002299	圣农发展	500	11,940.00	0.03

371	601865	福莱特	300	11,859.00	0.03
372	603338	浙江鼎力	200	11,738.00	0.03
373	601238	广汽集团	900	11,655.00	0.03
374	600025	华能水电	2,000	11,580.00	0.03
375	002773	康弘药业	500	11,565.00	0.03
376	00392	北京控股	500	11,461.90	0.03
377	600426	华鲁恒升	370	11,451.50	0.03
378	601838	成都银行	900	11,376.00	0.03
379	600584	长电科技	300	11,304.00	0.03
380	000977	浪潮信息	400	11,252.00	0.03
381	603019	中科曙光	400	11,044.00	0.03
382	002414	高德红外	400	11,032.00	0.03
383	601618	中国中冶	3,700	11,026.00	0.03
384	00293	国泰航空	2,000	10,916.89	0.03
385	603087	甘李药业	100	10,658.00	0.03
386	002024	苏宁易购	1,900	10,621.00	0.03
387	601607	上海医药	500	10,565.00	0.03
388	601108	财通证券	1,000	10,490.00	0.03
389	601800	中国交建	1,600	10,368.00	0.03
390	603392	万泰生物	40	10,367.20	0.03
391	600699	均胜电子	400	10,208.00	0.03
392	000987	越秀金控	800	10,128.00	0.03
393	601231	环旭电子	600	10,086.00	0.03
394	600522	中天科技	1,000	10,000.00	0.03
395	600066	宇通客车	800	9,992.00	0.03
396	601198	东兴证券	900	9,837.00	0.03
397	06808	高鑫零售	2,000	9,618.84	0.03
398	600989	宝丰能源	700	9,576.00	0.03
399	601066	中信建投	300	9,429.00	0.03
400	600183	生益科技	400	9,364.00	0.03
401	603993	洛阳钼业	1,800	9,288.00	0.03
402	601916	浙商银行	2,300	9,131.00	0.03
403	002146	荣盛发展	1,600	9,024.00	0.03
404	600362	江西铜业	400	8,952.00	0.03
405	000876	新希望	600	8,802.00	0.03
406	600369	西南证券	1,800	8,766.00	0.03
407	002065	东华软件	1,100	8,723.00	0.03
408	601138	工业富联	700	8,687.00	0.03
409	601360	三六零	700	8,547.00	0.02
410	601077	渝农商行	2,100	8,379.00	0.02
411	002607	中公教育	400	8,356.00	0.02
412	600521	华海药业	400	8,352.00	0.02

413	002373	千方科技	500	8,350.00	0.02
414	002602	世纪华通	1,300	8,346.00	0.02
415	000708	中信特钢	400	8,336.00	0.02
415	002384	东山精密	400	8,336.00	0.02
416	600150	中国船舶	500	8,255.00	0.02
417	601696	中银证券	400	8,236.00	0.02
418	002013	中航机电	800	8,056.00	0.02
419	600233	圆通速递	800	8,008.00	0.02
420	002422	科伦药业	400	7,980.00	0.02
421	002179	中航光电	100	7,902.00	0.02
422	600340	华夏幸福	1,500	7,860.00	0.02
423	600011	华能国际	1,800	7,596.00	0.02
424	601933	永辉超市	1,600	7,568.00	0.02
425	000656	金科股份	1,300	7,527.00	0.02
426	600498	烽火通信	400	7,452.00	0.02
427	600895	张江高科	400	7,308.00	0.02
428	600299	安迪苏	600	7,176.00	0.02
429	600383	金地集团	700	7,168.00	0.02
430	600018	上港集团	1,500	7,155.00	0.02
431	601577	长沙银行	800	7,152.00	0.02
432	600115	中国东航	1,400	7,112.00	0.02
433	002456	欧菲光	800	7,104.00	0.02
434	600801	华新水泥	400	7,028.00	0.02
435	600489	中金黄金	800	6,896.00	0.02
436	601236	红塔证券	500	6,780.00	0.02
437	002120	韵达股份	500	6,765.00	0.02
438	002926	华西证券	700	6,741.00	0.02
439	600372	中航电子	400	6,620.00	0.02
440	601881	中国银河	600	6,468.00	0.02
441	600109	国金证券	500	6,345.00	0.02
442	002463	沪电股份	400	6,188.00	0.02
443	600188	兖州煤业	400	6,144.00	0.02
444	601117	中国化学	700	6,132.00	0.02
445	300383	光环新网	400	5,756.00	0.02
446	601216	君正集团	1,100	5,599.00	0.02
447	002939	长城证券	500	5,565.00	0.02
448	000800	一汽解放	500	5,410.00	0.02
449	300251	光线传媒	500	5,405.00	0.02
450	002558	巨人网络	400	5,320.00	0.02
451	600606	绿地控股	900	4,905.00	0.01
452	000961	中南建设	800	4,736.00	0.01
453	601727	上海电气	1,100	4,664.00	0.01

454	601872	招商轮船	1,000	4,620.00	0.01
455	600918	中泰证券	400	4,328.00	0.01
456	000050	深天马 A	300	4,254.00	0.01
457	601319	中国人保	700	4,151.00	0.01
458	601162	天风证券	800	3,888.00	0.01
459	600027	华电国际	1,100	3,784.00	0.01

### 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

本基金本报告期末未持有积极投资部分的股票投资。

## 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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	00700	腾讯控股	20,613,899.67	59.83
2	600519	贵州茅台	13,888,244.00	40.31
3	601318	中国平安	5,742,971.00	16.67
3	02318	中国平安	3,261,520.81	9.47
4	03690	美团-W	6,613,707.54	19.19
5	01299	友邦保险	5,611,666.70	16.29
6	600036	招商银行	3,893,146.00	11.30
6	03968	招商银行	1,315,452.72	3.82
7	00005	汇丰控股	4,617,885.75	13.40
8	00939	建设银行	3,801,635.86	11.03
8	601939	建设银行	268,995.00	0.78
9	000858	五粮液	3,780,523.60	10.97
10	01398	工商银行	2,196,271.67	6.37
10	601398	工商银行	1,088,972.00	3.16
11	00388	香港交易所	2,828,871.03	8.21
12	000333	美的集团	2,434,293.00	7.06
13	300750	宁德时代	2,410,148.00	6.99
14	601888	中国中免	2,105,593.00	6.11
15	601166	兴业银行	2,068,708.00	6.00
16	01810	小米集团-W	2,031,512.65	5.90
17	600276	恒瑞医药	1,971,915.00	5.72
18	002594	比亚迪	1,163,520.00	3.38
18	01211	比亚迪股份	634,591.40	1.84
19	000651	格力电器	1,788,805.00	5.19
20	03988	中国银行	1,184,304.42	3.44
20	601988	中国银行	396,226.00	1.15
21	00941	中国移动	1,497,767.27	4.35
22	000568	泸州老窖	1,468,031.21	4.26

23	000002	万科 A	1,177,166.00	3.42
24	600887	伊利股份	1,447,698.00	4.20
25	002714	牧原股份	1,425,481.00	4.14
26	600030	中信证券	1,245,408.00	3.61
27	02269	药明生物	1,374,088.09	3.99
28	600031	三一重工	1,329,868.00	3.86
29	000001	平安银行	1,251,237.00	3.63
30	002415	海康威视	1,247,387.21	3.62
31	601012	隆基股份	1,231,693.00	3.57
32	601601	中国太保	802,504.00	2.33
33	300122	智飞生物	1,201,828.00	3.49
34	300059	东方财富	1,197,128.00	3.47
35	601328	交通银行	733,966.00	2.13
36	600900	长江电力	1,091,911.00	3.17
37	603288	海天味业	1,081,856.00	3.14
38	600585	海螺水泥	763,018.00	2.21
39	000725	京东方 A	1,028,229.00	2.98
41	300760	迈瑞医疗	989,868.00	2.87
42	600309	万华化学	979,995.00	2.84
43	603259	药明康德	978,680.00	2.84
44	00669	创科实业	872,091.00	2.53
45	002352	顺丰控股	863,624.00	2.51
46	601899	紫金矿业	849,848.00	2.47
49	002475	立讯精密	835,603.00	2.43
51	00016	新鸿基地产	781,531.47	2.27
52	00001	长和	779,243.05	2.26
53	000100	TCL 科技	778,762.00	2.26
54	00175	吉利汽车	767,233.94	2.23
55	00027	银河娱乐	738,818.62	2.14
56	09633	农夫山泉	718,961.03	2.09
57	600000	浦发银行	714,564.53	2.07
58	00883	中国海洋石油	703,417.58	2.04
59	02313	申洲国际	694,795.34	2.02
60	00002	中电控股	689,594.59	2.00

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	00700	腾讯控股	17,359,518.60	50.38
2	03690	美团-W	4,930,588.66	14.31
3	01299	友邦保险	4,828,840.47	14.01

4	00005	汇丰控股	3,973,331.86	11.53
5	000858	五粮液	3,521,147.00	10.22
6	00939	建设银行	3,247,089.54	9.42
6	601939	建设银行	7,200.00	0.02
7	02318	中国平安	2,623,989.11	7.62
7	601318	中国平安	506,894.00	1.47
8	00388	香港交易所	2,473,542.29	7.18
9	300750	宁德时代	2,158,482.00	6.26
10	000333	美的集团	2,056,631.95	5.97
11	01398	工商银行	1,852,511.38	5.38
11	601398	工商银行	15,260.00	0.04
12	01810	小米集团-W	1,679,358.17	4.87
13	002594	比亚迪	1,078,857.00	3.13
13	01211	比亚迪股份	542,664.40	1.57
14	000651	格力电器	1,534,282.00	4.45
15	000568	泸州老窖	1,491,827.00	4.33
16	02269	药明生物	1,338,921.64	3.89
17	002714	牧原股份	1,259,010.04	3.65
18	00941	中国移动	1,188,799.34	3.45
19	03968	招商银行	1,088,294.36	3.16
19	600036	招商银行	94,812.00	0.28
20	300122	智飞生物	1,173,642.00	3.41
21	000002	万科 A	945,138.00	2.74
22	000001	平安银行	1,117,476.00	3.24
23	002415	海康威视	1,107,448.00	3.21
24	300059	东方财富	1,106,390.00	3.21
25	03988	中国银行	1,053,043.24	3.06
26	000725	京东方 A	927,591.00	2.69
27	300760	迈瑞医疗	917,192.00	2.66
28	00669	创科实业	754,539.86	2.19
29	002475	立讯精密	708,654.00	2.06
30	00016	新鸿基地产	694,515.86	2.02

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	231,168,711.31
卖出股票收入（成交）总额	134,448,967.79

注：买入股票成本、卖出股票收入均不包括相关交易费用。

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。



## 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金未投资股指期货。

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金未投资股指期货。

## 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 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金未投资国债期货。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1

沪港深 500ETF 基金截至 2021 年 6 月 30 日持仓前十名证券中的招商银行（600036）的发行人招商银行股份有限公司于 2021 年 5 月 21 日公告，因公司存在以下违规行为：一、为同业投资提供第三方信用担保、为非保本理财产品出具保本承诺，部分未按规定计提风险加权资产；二、违规协助无衍生产品交易业务资格的银行发行结构性衍生产品；三、理财产品之间风险隔离不到位；四、理财资金投资非标准化债权资产认定不准确，实际余额超监管标准；五、同业投资接受第三方金融机构信用担保；六、理财资金池化运作；七、利用理财产品准备金调节收益；八、高净值客户认定不审慎；九、并表管理不到位，通过关联非银机构的内部交易，违规变相降低理财产品销售门槛；十、投资集合资金信托计划的理财产品未执行合格投资者标准；十一、投资集合资金

信托计划人数超限；十二、面向不合格个人投资者销售投资高风险资产或权益性资产的理财产品；十三、信贷资产非真实转让；十四、全权委托业务不规范；十五、未按要求向监管机构报告理财投资合作机构，被监管否决后仍未及时停办业务；十六、通过关联机构引入不合格投资者，受让以本行信用卡债权设立的信托次级受益权；十七、“智能投资受托计划业务”通过其他方式规避整改，扩大业务规模，且业务数据和材料缺失；十八、票据转贴现假卖断屡查屡犯；十九、贷款、理财或同业投资资金违规投向土地储备项目；二十、理财资金违规提供棚改项目资本金融资，向地方政府提供融资并要求地方政府提供担保；二十一、同业投资、理财资金等违规投向地价款或四证不全的房地产项目；二十二、理财资金认购商业银行增发的股票；二十三、违规为企业发行短期融资券提供搭桥融资，并用理财产品投资本行主承债券以承接表内类信贷资产；二十四、为定制公募基金提供投资顾问；二十五、为本行承销债券兑付提供资金支持；二十六、协助发行人以非市场化的价格发行债券；二十七、瞒报案件信息；于 2021 年 5 月 17 日收到中国银行保险监督管理委员会罚款 7170 万元的处罚。

沪港深 500ETF 基金截至 2021 年 6 月 30 日持仓前十名证券中的建设银行（0939.HK）的发行人中国建设银行股份有限公司于 2020 年 08 月 28 日公告，因公司存在以下违规行为：（一）内控管理不到位，支行原负责人擅自为同业投资违规提供担保并发生案件；（二）理财资金违规投资房地产，用于缴交或置换土地出让金及提供土地储备融资；（三）逆流程开展业务操作；（四）本行理财产品之间风险隔离不到位；（五）未做到理财业务与自营业务风险隔离；（六）个人理财资金违规投资；（七）违规为理财产品提供隐性担保；（八）同业投资违规接受担保；于 2020 年 07 月 13 日收到中国银行保险监督管理委员会罚款合计 3920 万元的处罚。

本基金管理人通过对上述上市公司进行进一步了解和视为，认为上述处分不会对公司的投资价值构成实质性影响，因此本基金管理人对上述证券的投资判断未发生改变。报告期内，本基金投资的前十名证券的其余八名证券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	77,643.65
2	应收证券清算款	1,614,223.55

3	应收股利	101,044.59
4	应收利息	381.79
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,793,293.58

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

##### 7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

##### 7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

#### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，合计数可能不等于分项之和。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

#### 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 (%)
1,020	33,105.10	7,450,699.00	22.06	26,316,500.00	77.94

### 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	中国国际金融股份有 限公司	4,718,299.00	13.97
2	福州开发区数为资产 管理有限公司一数为 道策套利一号私募证 券投资基金	1,500,000.00	4.44

3	中信证券股份有限公司	1,232,400.00	3.65
4	王新明	1,000,000.00	2.96
5	李亨堃	718,800.00	2.13
6	赖筱玲	697,900.00	2.07
7	贺伟	600,000.00	1.78
8	葛金萍	520,000.00	1.54
9	张冬梅	500,000.00	1.48
10	余丕玉	500,000.00	1.48
11	吴美玲	500,000.00	1.48

### 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

### 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 (2021 年 3 月 5 日) 基金份额总额	222,767,199.00
基金合同生效日起至报告期期末基金 总申购份额	-
减：基金合同生效日起至报告期期末 基金总赎回份额	189,000,000.00
基金合同生效日起至报告期期末基金 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	33,767,199.00

注：本基金合同生效日为 2021 年 03 月 05 日。

## § 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

报告期内本基金管理人无重大人事变动。

### 2、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，无涉及本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

## 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金资产和基金托管业务的诉讼事项。

## 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未发生变更。

## 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

基金管理人为本基金聘任的会计师事务所向本基金提供的审计服务持续期限为：本基金合同生效之日起至本报告期末。

## 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、托管人及其高级管理人员未有受到稽查或处罚的情况。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国金证券	2	200,204,842.40	54.76%	163,090.32	51.69%	-
开源证券	2	68,870,891.98	18.84%	64,065.06	20.30%	-
海通证券	2	43,880,747.43	12.00%	40,002.27	12.68%	-
东方财富	2	12,851,289.86	3.51%	11,968.63	3.79%	-
广发证券	2	9,032,020.04	2.47%	8,231.05	2.61%	-

方正证券	1	5,681,593.80	1.55%	5,177.67	1.64%	-
中金公司	2	5,034,969.60	1.38%	4,588.28	1.45%	-
中银国际	2	3,995,953.00	1.09%	3,641.49	1.15%	-
浙商证券	2	2,610,023.85	0.71%	2,400.68	0.76%	-
财通证券	2	2,314,119.00	0.63%	2,141.47	0.68%	-
光大证券	2	2,297,141.00	0.63%	2,093.42	0.66%	-
长江证券	1	2,166,281.88	0.59%	2,017.48	0.64%	-
华创证券	2	1,470,552.00	0.40%	1,340.17	0.42%	-
国联证券	3	1,254,337.00	0.34%	1,143.05	0.36%	-
天风证券	4	1,050,250.26	0.29%	957.12	0.30%	-
招商证券	1	755,595.00	0.21%	688.57	0.22%	-
中信建投	1	728,200.00	0.20%	678.16	0.21%	-
宏信证券	2	418,405.00	0.11%	381.28	0.12%	-
国泰君安	1	356,423.00	0.10%	331.94	0.11%	-
兴业证券	2	343,055.00	0.09%	319.49	0.10%	-
国元证券	2	223,978.00	0.06%	204.11	0.06%	-
华金证券	1	77,010.00	0.02%	71.74	0.02%	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
国海证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	3	-	-	-	-	-
太平洋证 券	1	-	-	-	-	-
新时代证 券	2	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中信金通	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-

注：1、基金管理人选择交易单元的标准和程序如下：

(1) 选择标准： 资质雄厚，信誉良好，注册资本不少于 5 亿元人民币；财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；经营行为规范，最近两年未因重大违规行为受到中国证监会和中国人民银行处罚；内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；具备基金运作所需要的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需 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、本报告期租用的证券公司交易单元均为新增。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

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	
	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
国金证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
宏信证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-

华金证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
太平洋证 券	-	-	-	-	-	-
新时代证 券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信金通	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

注：本基金本报告期内未租用证券公司交易单元进行其它证券投资。

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华宝中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金基金份额发售公告	基金管理人网站, 中国证券报	2021-2-6
2	华宝中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要	基金管理人网站	2021-2-6
3	华宝中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同	基金管理人网站	2021-2-6
4	华宝中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金托管协议	基金管理人网站	2021-2-6
5	华宝中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书	基金管理人网站	2021-2-6
6	华宝基金关于华宝中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金新增网下现金认购、网下股票换购发售代理机构的公告	基金管理人网站, 中国证券报	2021-2-22
7	华宝中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金上网发售提示性公告	基金管理人网站, 中国证券报	2021-2-25
8	华宝中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同生效公告	基金管理人网站, 中国证券报	2021-3-6
9	华宝基金管理有限公司关于华宝中证沪港深 500 交易型开放式指数证	基金管理人网站, 中国证券报	2021-3-8



	券投资基金变更基金扩位简称的公告		
10	华宝中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书	基金管理人网站, 中国证券报	2021-3-23
11	华宝中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书提示性公告	基金管理人网站, 中国证券报	2021-3-23
12	华宝中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金开放日常申购、赎回业务的公告	基金管理人网站, 中国证券报	2021-3-23
13	华宝中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金上市交易提示性公告	基金管理人网站, 中国证券报	2021-3-26
14	华宝基金关于华宝中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金新增中金公司为一二级交易商的公告	基金管理人网站, 中国证券报	2021-3-26
15	华宝中证沪港深 500 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	2021-3-29
16	华宝中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金关于非港股通交易日暂停申购、赎回业务的公告	基金管理人网站, 中国证券报	2021-3-30
17	华宝基金关于华宝中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金新增海通证券为一二级交易商的公告	基金管理人网站, 中国证券报	2021-3-30
18	华宝中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同	基金管理人网站	2021-3-31
19	华宝中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金托管协议	基金管理人网站	2021-3-31
20	华宝中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书 (更新)	基金管理人网站	2021-3-31
21	华宝中证沪港深 500 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	2021-3-31
22	华宝基金管理有限公司关于旗下部分基金根据《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号-指数基金指引》、《存托凭证发行与交易管理办法 (试行)》修改基金合同部分条款的公告	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	2021-3-31
23	华宝中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金暂停申购、赎回的公告	基金管理人网站, 中国证券报	2021-4-26

24	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湘财证券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	2021-4-28
25	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中金财富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	2021-5-13
26	华宝中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金暂停申购、赎回的公告	基金管理人网站, 中国证券报	2021-5-17
27	华宝中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金暂停申购、赎回的公告	基金管理人网站, 中国证券报	2021-6-28
28	华宝中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金暂停申购、赎回的公告	基金管理人网站, 中国证券报	2021-6-29

## § 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	20210628~20210628	0.00	38,895,099.00	34,176,800.00	4,718,299.00	13.97
	2	20210305~20210330	0.00	50,000,000.00	50,000,000.00	0.00	0.00
个人	1	20210331~20210420	0.00	255,032,100.00	254,313,300.00	718,800.00	2.13
产品特有风险							
<p>报告期内本基金出现单一投资者持有基金份额比例超过 20%的情况。在单一投资者持有基金份额比例较高的情况下, 如该投资者集中赎回, 可能会增加基金的流动性风险。此外, 由于基金在遇到大额赎回的时候可能需要变现部分资产, 可能对持有资产的价格形成冲击, 增加基金的市场风险。基金管理人将专业审慎、勤勉尽责地运作基金资产, 加强防范流动性风险、市场风险, 保护持有人利益。</p>							

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

根据《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号-指数基金指引》、《存托凭证发行与交易

管理办法（试行）》的要求，2021 年 3 月 31 日，基金管理人布关于修订旗下部分基金基金合同的公告，对基金管理人旗下 34 只指数基金基金合同部分条款进行相应更新，具体内容可详见相关公告，请投资者予以关注。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

中国证监会批准基金设立的文件；  
华宝中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同；  
华宝中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书；  
华宝中证沪港深 500 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住所备投资者查阅

### 12.3 查阅方式

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

华宝基金管理有限公司

2021 年 8 月 27 日