

华宝标普香港上市中国中小盘指数证券投资 基金(LOF) 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：中国建设银行股份有限公司

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 2021 年 7 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。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自 2021 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
§ 4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	15
§ 5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	15
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	16
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表	16
6.2 利润表	17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	18
6.4 报表附注	20
§ 7 投资组合报告	43
7.1 期末基金资产组合情况	43
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布	44
7.3 期末按行业分类的权益投资组合	44
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	44

7.5 报告期内权益投资组合的重大变动	70
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合	72
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	72
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	72
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	72
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	72
7.11 投资组合报告附注	72
§ 8 基金份额持有人信息	73
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	73
8.2 期末上市基金前十名持有人	74
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	74
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	74
§ 9 开放式基金份额变动	75
§ 10 重大事件揭示	75
10.1 基金份额持有人大会决议	75
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	75
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	76
10.4 基金投资策略的改变	76
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	76
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	76
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	76
10.8 其他重大事件	79
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	81
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	81
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	81
§ 12 备查文件目录	81
12.1 备查文件目录	81
12.2 存放地点	82
12.3 查阅方式	82

§ 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	483,297,927.21 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	475,847,540.35 份	7,450,386.86 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、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	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。本基金可能通过港股通投资香港证券市场，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。

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		XIAOYI HELEN HUANG	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		-	-

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、中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021年1月1日-2021年6月30日)	
	香港中小	华宝香港中小 C
本期已实现收益	124,309,954.00	6,795,758.14
本期利润	106,792,914.03	425,372.68
加权平均基金份额本期利润	0.1763	0.0098
本期加权平均净值利润率	9.65%	0.54%
本期基金份额净值增长率	10.51%	10.30%
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	6,741,409.64
	期末可供分配基金份额利润	0.9048
	期末基金资产净值	14,191,796.50

期末基金份额净值	1.9245	1.9048
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	92.45%	30.68%

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	2.97%	0.83%	2.54%	0.84%	0.43%	-0.01%
过去三个月	7.54%	0.99%	7.37%	0.99%	0.17%	0.00%
过去六个月	10.51%	1.52%	10.74%	1.53%	-0.23%	-0.01%
过去一年	29.37%	1.44%	30.60%	1.44%	-1.23%	0.00%
过去三年	31.28%	1.47%	30.75%	1.49%	0.53%	-0.02%
自基金合同生效起至今	92.45%	1.31%	99.22%	1.32%	-6.77%	-0.01%

华宝香港中小 C

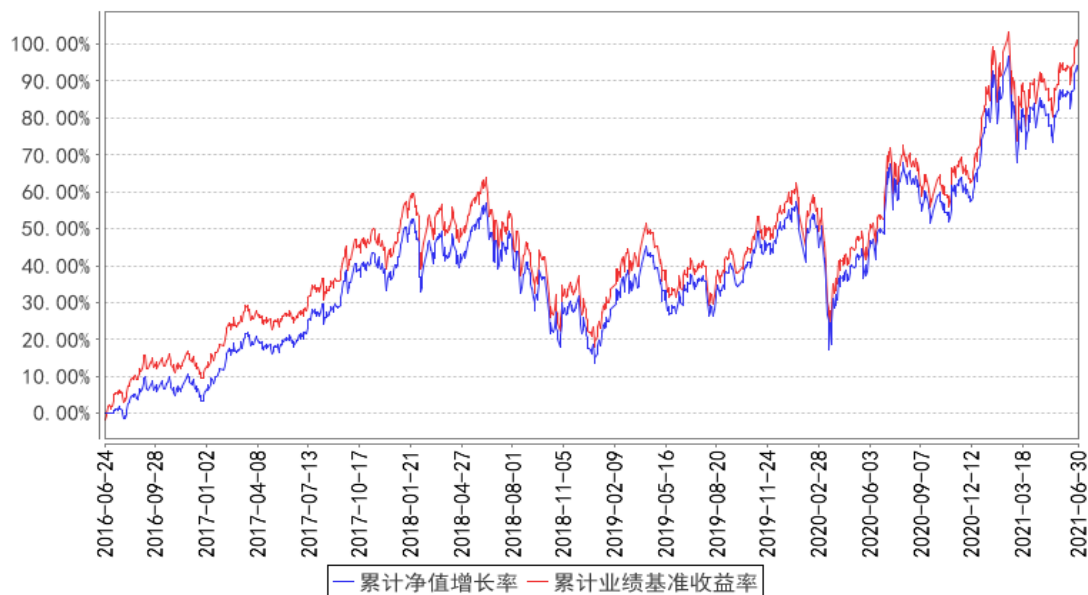
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	2.93%	0.83%	2.54%	0.84%	0.39%	-0.01%
过去三个月	7.42%	0.99%	7.37%	0.99%	0.05%	0.00%
过去六个月	10.30%	1.52%	10.74%	1.53%	-0.44%	-0.01%
过去一年	28.84%	1.44%	30.60%	1.44%	-1.76%	0.00%
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	30.68%	1.47%	30.43%	1.49%	0.25%	-0.02%

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%。

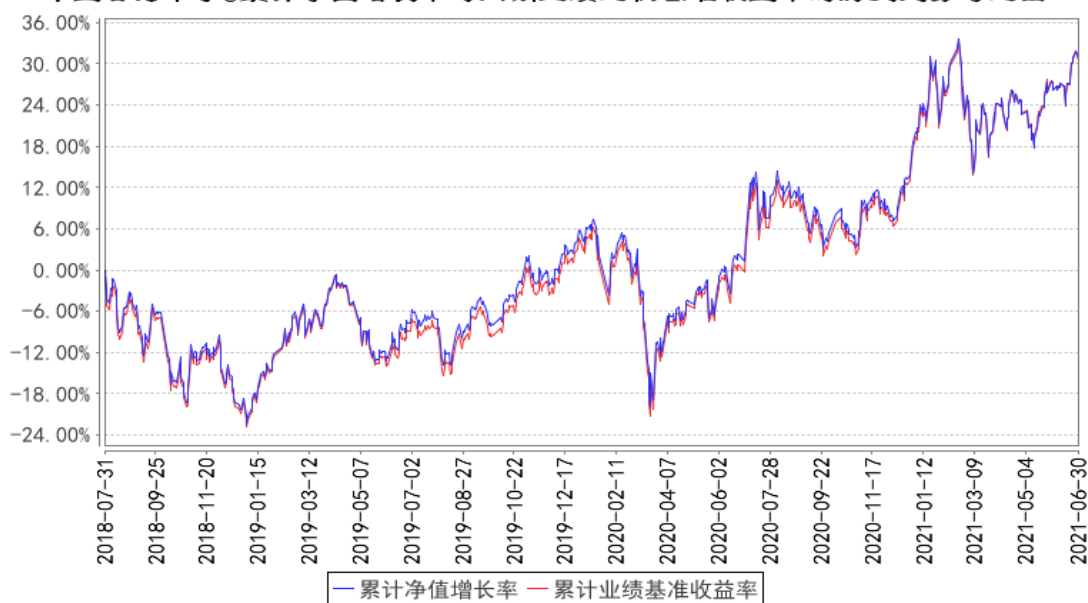
2、净值以及比较基准相关数据计算中涉及天数的，包括所有交易日以及季末最后一自然日（如非交易日）。

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

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		
杨洋	本基金的基金经理	2021 年 5 月 11 日	-	10 年	硕士。曾在法兴银行、东北证券从事证券交易、研究、投资管理工作，2014 年 6 月加入华宝基金管理有限公司，先后担任高级分析师、投资经理等职务。2021 年 5 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）、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）、华宝港股通恒生中国（香港上市）25 指数证券投资基金、华宝港股通恒生香港 35 指数证券投资基金（LOF）、华宝标普沪港深中国增强价值指数证券投资基金（LOF）、华宝英国富时 100 指数发起式证券投资基金基金经理。
周晶	本基金基金经理、公司总经理助理、国际业务部总经理、首席策略分析师	2016 年 6 月 24 日	-	16 年	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。2020 年 11 月起任华宝英国富时 100 指数发起式证券投资基金基金经理。

注：1、任职日期以及离任日期均以基金公告为准。

2、证券从业含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《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。

4.3 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

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。在报告期内按照这一原则比较好的实现了基金跟踪指数表现的目的。以下为对影响标的指数表现的市场因素分析。

整个 2021 年上半年，标普香港中小盘指数表现优异。2021 年一季度，中国 GDP 创下近 30 年来最好一个季度 18% 的同比增速，港股市场一季度在南下资金的推动下表现强劲。然而，二季度市场对经济过热而可能导致的潜在通胀开始关注并有所担忧。事实上，6 月份公布的 5 月份的通胀数据确实验证了市场的担忧。特别是 PPI，同比增速达到了 9%，创 2009 年以来的高位。此外，美联储在 6 月份的 FOMC 会议上意外释放鹰派言论，点阵图预测 2023 年加息概率提升，带动美元

指数强势反弹，拖累港股市场。受两者影响，2021 年二季度整个港股市场有所回落。香港本地股表现较内地股更佳，原因在于其走势和发达国家指数相关性更高。

上半年收 4531.96，涨幅 12.5%。恒生指数上半年上涨 5.9%，该基金跟踪的标普香港中小盘指数涨幅远高于恒生指数。香港中小指数上半年年化波动率为 26.3%，相较恒生指数的 19.3% 更高。

日常操作过程中，人民币汇率方面，2021 年上半年人民币汇率兑港币呈现升值走势。上半年人行中间价从 0.8416 升值至 0.8321，相对于港币升值 1.14%。同期，人民币交易价也相对于港币升值 1.28% 左右。汇率上半年整体而言对基金的人民币计价业绩有负面影响。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金份额 A 净值增长率为 10.51%；本报告期基金份额 C 净值增长率为 10.30%；同期业绩比较基准收益率为 10.74%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在当前时点展望 2021 年下半年，流动性预计将继续保持宽松。从港股上半年的表现来看，结构分化严重。新能源车、医药、体育服饰板块表现出色，估值维持在高位。但是以金融周期、互联网为权重的指数行情却表现不佳，估值依然便宜。我们预计下半年港股市场结构将回归均衡，在前期强势股估值随前期快速上涨已然十分昂贵的背景下，市场风格可能会阶段性向上半年表现较弱但估值合理的互联网和金融周期板块切换。风格切换的持续性和幅度取决于疫苗能够在全球铺开，全球经济能够逐渐从疫情的反复中彻底走出来，病毒变种的风险不再扩散。整体，下半年看，随着全球经济活动的恢复，经济数据依然健康，再叠加疫苗研发成功和周期板块当前较低的估值，下半年港股周期板块有望发挥。香港中小的行业配置均衡，兼顾周期性和成长性，是一个长期表现出色的板块。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

（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〈证券投资基金投资受限股票估值指引(试行)〉的通知》等有关规定及本公司的估值制度，对特殊品种或由于特殊原因导致投资品种不存在活跃市场的情况，量化投资部根据估值委员会确定的对停牌股票或异常交易股票估值调整的方法（比如：指数收益法）进行估值，并兼顾行业研究员基于上市公司估值模型计算结果所提出的估值建议或意见。必要时基金经理也会就估值模型及估值方法的确定提出建议和意见，但由估值委员会做最终决策。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，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：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	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	58,529,451.79	71,549,271.30
结算备付金		-	-
存出保证金		26,375.81	93,854.82
交易性金融资产	6.4.7.2	878,937,369.63	1,168,918,438.42
其中：股票投资		878,937,369.63	1,168,918,438.42
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		9,552,876.31	39,181,193.61
应收利息	6.4.7.5	3,898.49	4,059.78
应收股利		8,550,381.38	873,654.69
应收申购款		498,557.44	357,188.86
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		956,098,910.85	1,280,977,661.48
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 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		-	-
应付赎回款		23,710,001.91	43,619,917.71
应付管理人报酬		781,886.18	1,021,722.65
应付托管费		195,471.52	255,430.66
应付销售服务费		6,191.85	5,281.17
应付交易费用	6.4.7.7	967,233.20	934,365.10
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	455,409.88	1,115,182.13
负债合计		26,116,194.54	46,951,899.42
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	483,297,927.21	708,712,922.09
未分配利润	6.4.7.10	446,684,789.10	525,312,839.97
所有者权益合计		929,982,716.31	1,234,025,762.06
负债和所有者权益总计		956,098,910.85	1,280,977,661.48

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额总额 483,297,927.21 份，其中香港中小基金份额总额 475,847,540.35 份，基金份额净值 1.9245 元。华宝香港中小 C 基金份额总额 7,450,386.86 份，基金份额净值 1.9048 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：2021 年 1 月 1 日至 2021 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
		2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		117,104,675.23	-6,348,121.27
1. 利息收入		132,057.76	482,549.55
其中：存款利息收入	6.4.7.11	132,057.76	482,549.55
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）		141,263,001.29	66,897,989.69
其中：股票投资收益	6.4.7.12	130,359,524.45	43,309,616.90
基金投资收益	6.4.7.13	-	-
债券投资收益	6.4.7.14	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-	-
股利收益	6.4.7.17	10,903,476.84	23,588,372.79
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-23,887,425.43	-74,324,135.03
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-722,665.05	9,305.08
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	319,706.66	586,169.44
减：二、费用		9,886,388.52	14,659,298.58
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	5,912,165.29	8,743,559.40
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,478,041.28	2,185,889.81
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	159,585.85	63,219.62
4. 交易费用	6.4.7.20	1,911,489.51	3,108,370.36
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	6.4.7.21	425,106.59	558,259.39
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		107,218,286.71	-21,007,419.85
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		107,218,286.71	-21,007,419.85

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：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 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	708,712,922.09	525,312,839.97	1,234,025,762.06

权益（基金净值）			
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	107,218,286.71	107,218,286.71
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）	-225,414,994.88	-185,846,337.58	-411,261,332.46
其中：1. 基金申购款	211,414,666.13	183,106,658.10	394,521,324.23
2. 基金赎回款	-436,829,661.01	-368,952,995.68	-805,782,656.69
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）	483,297,927.21	446,684,789.10	929,982,716.31
项目	上年度可比期间 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. 基金赎回款	-721,979,286.22	-293,493,848.82	-1,015,473,135.04
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)	1,116,315,172.59	544,172,655.44	1,660,487,828.03

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：

黄小薏

向辉

张幸骏

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《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×95%+人民币活期存款利率(税后)×5%。

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

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 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 年上半年度的经营成果和净值变动情况。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

—

6.4.5.2 会计估计变更的说明

—

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

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 2021年6月30日
活期存款	58,529,451.79
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	58,529,451.79

注：于2021年6月30日，活期存款包括人民币活期存款37,859,976.98元，港元活期存款24,840,730.23元(折合人民币20,669,474.81元)。

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	679,652,656.02	878,937,369.63	199,284,713.61
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	679,652,656.02	878,937,369.63	199,284,713.61

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	3,395.01
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	501.15
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	2.33
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	-
合计	3,898.49

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	967,233.20
银行间市场应付交易费用	-
合计	967,233.20

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	38,964.78
应付证券出借违约金	-
预提费用	120,836.84
应付指数使用费	295,608.26
合计	455,409.88

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

香港中小

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	700,196,646.68	700,196,646.68
本期申购	145,659,873.43	145,659,873.43
本期赎回（以“-”号填列）	-370,008,979.76	-370,008,979.76
-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	475,847,540.35	475,847,540.35

华宝香港中小C

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	8,516,275.41	8,516,275.41
本期申购	65,754,792.70	65,754,792.70
本期赎回（以“-”号填列）	-66,820,681.25	-66,820,681.25
-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	7,450,386.86	7,450,386.86

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	328,596,841.20	190,525,261.67	519,122,102.87
本期利润	124,309,954.00	-17,517,039.97	106,792,914.03
本期基金份额交易产生	-125,526,550.78	-60,445,086.66	-185,971,637.44

的变动数			
其中：基金申购款	73,663,087.50	52,871,028.65	126,534,116.15
基金赎回款	-199,189,638.28	-113,316,115.31	-312,505,753.59
本期已分配利润	-	-	-
本期末	327,380,244.42	112,563,135.04	439,943,379.46

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	6,005,024.59	185,712.51	6,190,737.10
本期利润	6,795,758.14	-6,370,385.46	425,372.68
本期基金份额交易产生的变动数	-5,960,801.52	6,086,101.38	125,299.86
其中：基金申购款	48,159,854.99	8,412,686.96	56,572,541.95
基金赎回款	-54,120,656.51	-2,326,585.58	-56,447,242.09
本期已分配利润	-	-	-
本期末	6,839,981.21	-98,571.57	6,741,409.64

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
活期存款利息收入	76,756.68
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	49,199.58
其他	6,101.50
合计	132,057.76

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1月1日至2021年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	130,359,524.45
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	130,359,524.45

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 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	661,191,174.68
减：卖出股票成本总额	530,831,650.23
买卖股票差价收入	130,359,524.45

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

-

6.4.7.14 债券投资收益

本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.14.1 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
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	10,903,476.84
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	10,903,476.84

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
1. 交易性金融资产	-23,887,425.43
股票投资	-23,887,425.43
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-23,887,425.43

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
基金赎回费收入	319,706.66
合计	319,706.66

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
	2021年1月1日至2021年6月30日
交易所市场交易费用	1,911,489.51
银行间市场交易费用	-
合计	1,911,489.51

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
审计费用	35,704.06
信息披露费	59,507.37

证券出借违约金	-
银行费用	405.00
指数使用费	295,608.26
其他	8,211.42
数据使用费	25,670.48
合计	425,106.59

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、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
华宝证券股份有限公司（“华宝证券”）	受宝武集团控制的公司、基金销售机构
华宝投资有限公司（“华宝投资”）	受宝武集团控制的公司
宝武集团财务有限责任公司（“宝武财务”）	受宝武集团控制的公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行交易。

6.4.10.2 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	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	5,912,165.29	8,743,559.40
其中：支付销售机构的客户维护费	1,595,354.56	1,891,793.89

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 1.00%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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.00\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,478,041.28	2,185,889.81

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方名称	本期		
	2021 年 1 月 1 日至 2021 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
华宝证券	0.00	0.02	0.02
华宝基金	0.00	760.76	760.76
合计	0.00	760.78	760.78
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2020 年 1 月 1 日至 2020 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	-	29,441.28	29,441.28
华宝证券	-	0.54	0.54
合计	-	29,441.82	29,441.82

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 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 C 类基金资产净值 × 0.4% / 当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期内及上年度可比期间均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

-

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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 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：报告期内赎回/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	0.15%	-
项目	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	上年度可比期间 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	-
报告期内申购/买入总份额	-	-
报告期内因拆分变动份额	-	-
减：报告期内赎回/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%	-

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 2021年6月30日		上年度末 2020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 (%)
华宝投资有限公司	12,718,901.04	2.67	-	-

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1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020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	20,669,360.42	-	84,445,075.22	161.92
中国建设银行股份有限公司	37,860,091.37	76,756.68	29,955,589.04	363,816.62

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

本基金本报告期内及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末(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
6863 HK	辉山乳业	2019年12月23日	重大事项	0	-	-	4,338,000	11,180,745.35	-	-
1114 HK	BRILLIANCE CHI	2021年3月31日	重大事项	6.07	-	-	1,050,000.00	8,003,402.67	6,377,893.20	-

3800 K	H	GCL-POLY ENERGY HOLDING D	2021 年 4 月 1 日	重 大 事 项	1.6 5	-	-	6,738,000.0 0	12,541,685.3 7	11,100,978.9 8	-
-----------	---	------------------------------------	-------------------------------	------------------	----------	---	---	------------------	-------------------	-------------------	---

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在经营管理和基金运作中的风险进行评估并研究制订相应的控制制度。督察长向董事会负责，总管公司的内控事务并独立地就内控制度的执行情况履行检查、评价、报告和建议职能。风险管理部在督察长指导下对公司内部控制运行情况进行监控，主要针对公司内

部控制制度的总体构架和内部控制的目标进行评估并提出改进意见；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》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 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	58,529,451.79	-	-	-	58,529,451.79
存出保证金	26,375.81	-	-	-	26,375.81
交易性金融资产	-	-	-	878,937,369.63	878,937,369.63
应收利息	-	-	-	3,898.49	3,898.49
应收股利	-	-	-	8,550,381.38	8,550,381.38
应收申购款	4,459.28	-	-	494,098.16	498,557.44
应收证券清算款	-	-	-	9,552,876.31	9,552,876.31
资产总计	58,560,286.88	-	-	897,538,623.97	956,098,910.85
负债					
应付赎回款	-	-	-	23,710,001.91	23,710,001.91
应付管理人报酬	-	-	-	781,886.18	781,886.18
应付托管费	-	-	-	195,471.52	195,471.52
应付销售服务费	-	-	-	6,191.85	6,191.85
应付交易费用	-	-	-	967,233.20	967,233.20
其他负债	-	-	-	455,409.88	455,409.88
负债总计	-	-	-	26,116,194.54	26,116,194.54
利率敏感度缺口	58,560,286.88	-	-	871,422,429.43	929,982,716.31
上年度末 2020年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	71,549,271.30	-	-	-	71,549,271.30
存出保证金	93,854.82	-	-	-	93,854.82
交易性金融资产	-	-	-	1,168,918,438.42	1,168,918,438.42
应收利息	-	-	-	4,059.78	4,059.78
应收股利	-	-	-	873,654.69	873,654.69
应收申购款	8,139.19	-	-	349,049.67	357,188.86

应收证券清算款	-	-	-	39,181,193.61	39,181,193.61
资产总计	71,651,265.31	-	-	1,209,326,396.17	1,280,977,661.48
负债					
应付赎回款	-	-	-	43,619,917.71	43,619,917.71
应付管理人报酬	-	-	-	1,021,722.65	1,021,722.65
应付托管费	-	-	-	255,430.66	255,430.66
应付销售服务费	-	-	-	5,281.17	5,281.17
应付交易费用	-	-	-	934,365.10	934,365.10
其他负债	-	-	-	1,115,182.13	1,115,182.13
负债总计	-	-	-	46,951,899.42	46,951,899.42
利率敏感度缺口	71,651,265.31	-	-	-1,162,374,496.75	1,234,025,762.06

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约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

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				
银行存款	-	20,669,474.81	-	20,669,474.81
交易性金融资产	-	878,937,369.63	-	878,937,369.63
应收股利	-	508,476.92	-	508,476.92

应收证券清算款	-	835,427.08	-	835,427.08
资产合计	-	900,950,748.44	-	900,950,748.44
以外币计价的负债				
其他负债	25,625.41	-	-	25,625.41
负债合计	25,625.41	-	-	25,625.41
资产负债表外汇风险敞口净额	-25,625.41	900,950,748.44	-	900,925,123.03
	上年度末 2020 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	-	44,853,434.29	-	44,853,434.29
交易性金融资产	-	1,168,918,438.42	-	1,168,918,438.42
应收证券清算款	-	3,733,552.02	-	3,733,552.02
资产合计	-	1,217,505,424.73	-	1,217,505,424.73
以外币计价的负债				
其他负债	52,282.98	-	-	52,282.98
负债合计	52,282.98	-	-	52,282.98
资产负债表外汇风险敞口净额	-52,282.98	1,217,505,424.73	-	1,217,453,141.75

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）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）	

分析	1. 所有外币相对人民币升值 5%	45,046,256.15	60,872,657.09
	2. 所有外币相对人民币贬值 5%	-45,046,256.15	-60,872,657.09

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 2021年6月30日		上年度末 2020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	878,937,369.63	94.51	1,168,918,438.42	94.72
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	878,937,369.63	94.51	1,168,918,438.42	94.72

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 (2021 年 6 月 30 日)	上年度末 (2020 年 12 月 31 日)
分析	1. 业绩比较基准上升 5%	46,334,317.46	60,434,517.47
	2. 业绩比较基准下降 5%	-46,334,317.46	-60,434,517.47

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 861,458,497.45 元, 属于第三层次的余额为零元, 第二层次的余额为 17,478,872.18 元(上年度末: 第一层次 1,168,918,438.42 元, 第三层次零元, 无第二层次)。

(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，本报告期内未发生金额变动。（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）。

(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	878,937,369.63	91.93
	其中：普通股	878,937,369.63	91.93
	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	58,529,451.79	6.12
8	其他各项资产	18,632,089.43	1.95
9	合计	956,098,910.85	100.00

注：通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 769,177,447.04 元，占基金资产净值的比例为

82.71%。

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	878,937,369.63	94.51
合计	878,937,369.63	94.51

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（%）
能源	5,634,912.33	0.61
原材料	41,952,092.34	4.51
工业	113,551,289.69	12.21
非日常生活消费品	187,536,457.82	20.17
日常消费品	99,866,882.31	10.74
医疗保健	125,175,369.65	13.46
金融	42,600,117.91	4.58
信息技术	146,482,142.37	15.75
通信服务	10,692,893.67	1.15
公用事业	50,173,117.65	5.40
房地产	55,272,093.89	5.94
合计	878,937,369.63	94.51

注：本基金对以上行业分类采用全球行业分类标准。

7.3.2 期末积极投资按行业分类的权益投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资。

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	LI NING CO LTD	李宁	2331 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	513,00 0	40466047 .39	4.3 5
2	SUNNY OPTICAL TECH	舜宇光学科 技	2382 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	176,80 0	36101221 .98	3.8 8
3	COUNTRY GARDEN SERVICE S HOLD	碧桂园服务	6098 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	438,00 0	30577442 .26	3.2 9
4	SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	申洲国际	2313 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	186,30 0	30398736 .43	3.2 7
5	GEELY AUTOMOBILE HOLDI NGS LT	吉利汽车	175 H K	香港 联合 交易所	中国 香港	1,412, 000	28726230 .67	3.0 9
6	CHINA MENGNIU DAIRY C O	蒙牛乳业	2319 HK	香港 联合 交	中国 香港	675,00 0	26369655 .3	2.8 4

				易所				
7	CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LTD	石药集团	1093 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	2,226, 960	20827819 .78	2.2 4
8	XINYI GLASS HOLDINGS LTD	信义玻璃	868 H K	香港 联合 交易所	中国 香港	632,00 0	16643929 .82	1.7 9
9	GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	长城汽车	2333 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	768,50 0	16050282 .35	1.7 3
10	INNOVENT BIOLOGICS INC	信达生物	1801 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	213,00 0	16048451 .77	1.7 3
11	XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	信义光能	968 H K	香港 联合 交易所	中国 香港	1,048, 000	14615052 .52	1.5 7
12	SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	融创中国	1918 HK	香港	中国	624,00 0	13837157 .57	1.4 9

				联合交易所	香港			
13	WH GROUP LTD	万洲国际	288 K H	香港联合交易所	中国香港	2,339,500	13587625 .1	1.4 6
14	KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	金蝶国际	268 K H	香港联合交易所	中国香港	602,000	13199035 .42	1.4 2
15	NONGFU SPRING CO LTD-H	农夫山泉	9633 HK	香港联合交易所	中国香港	387,000	12542482 .69	1.3 5
16	ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	紫金矿业	2899 HK	香港联合交易所	中国香港	1,422,000	12352793 .41	1.3 3
17	CHINA GAS HOLDINGS LTD	中国燃气	384 K H	香港联合交易所	中国香港	611,400	12056988 .97	1.3 0

18	LENOVO GROUP LTD	联想集团	992 HK	香港联合交易所	中国香港	1,552,000	11532096.27	1.24
19	PING AN HEALTHCARE AND TECHN	平安好医生	1833 HK	香港联合交易所	中国香港	142,200	11441715.74	1.23
20	GCL-POLY ENERGY HOLDINGS LTD	保利协鑫能源	3800 HK	香港联合交易所	中国香港	6,738,000	11100978.98	1.19
21	CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	海螺创业	586 HK	香港联合交易所	中国香港	407,000	11074069.51	1.19
22	CHINA FEIHE LTD	中国飞鹤	6186 HK	香港联合交易所	中国香港	709,000	9887473.51	1.06
23	PICC PROPERTY & CASUALTY-H	中国财险	2328 HK	香港联合交易所	中国香港	1,710,000	9675426.24	1.04

				交易所				
24	MICROPORT SCIENTIFIC CORPORATION	微创医疗	853 HK	香港联合交易所	中国香港	162,000	9388608.26	1.01
25	KINGSOFT CORPORATION LTD	金山软件	3888 HK	香港联合交易所	中国香港	234,800	9094584.48	0.98
26	SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	威高股份	1066 HK	香港联合交易所	中国香港	584,000	8805137.13	0.95
27	CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	龙源电力	916 HK	香港联合交易所	中国香港	770,000	8572587.41	0.92
28	AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	瑞声科技	2018 HK	香港联合交易所	中国香港	177,000	8556861.1	0.92
29	CHINA RESOURCES GAS GROUP	华润燃气	1193	香	中	212,000	8220284.	0.8

	ROUP LT		HK	香港 联合 交易所	国 香港	0	74	8
30	TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	青岛啤酒	168 HK	香港 联合 交易所	中 国 香港	108,000	7512683.9	0.81
31	AKESO INC	康方生物	9926 HK	香港 联合 交易所	中 国 香港	144,000	7506692.93	0.81
32	HENGAN INTL GROUP CO LTD	恒安国际	1044 HK	香港 联合 交易所	中 国 香港	172,000	7442123.52	0.80
33	GENSCRIPT BIOTECH CORP	金斯瑞生物科技	1548 HK	香港 联合 交易所	中 国 香港	262,000	7390368.14	0.79
34	CHINA NATIONAL BUILDING MATERIALS LTD-H	中国建材	3323 HK	香港 联合 交易所	中 国 香港	960,000	7285026.82	0.78

				所					
35	WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	中国旺旺	151 K	H	香港联合交易所	中国香港	1,523,000	6969918.12	0.75
36	WEICHAI POWER CO LTD-H	潍柴动力	2338 HK		香港联合交易所	中国香港	482,000	6922339.79	0.74
37	FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	福耀玻璃	3606 HK		香港联合交易所	中国香港	150,400	6845422.31	0.74
38	ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	中升控股	881 K	H	香港联合交易所	中国香港	126,500	6799674.55	0.73
39	SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICALS-H	复星医药	2196 HK		香港联合交易所	中国香港	127,500	6651855.54	0.72
40	BYD ELECTRONIC INTERNATIONAL LTD	比亚迪电子	285 K	H	香港联	中国香港	156,500	6641246.52	0.71

				合 交 易 所	港			
41	GUANGDONG INVESTMENT LTD	粤海投资	270 K H	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	714,000	6630213.14	0.71
42	CHINASOFT INTERNATIONAL LTD	中国软件国际	354 K H	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	561,000	6609843.82	0.71
43	SINOPHARM GROUP CO-H	国药控股	1099 HK	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	332,800	6396764.77	0.69
44	BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	BRILLIANCE CHI	1114 HK	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	1,050,000	6377893.2	0.69
45	CHINA LITERATURE LTD	阅文集团	772 K H	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	88,400	6351549.55	0.68

46	WEIMOB INC	微盟集团	2013 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	422,00 0	6011478. 45	0.6 5
47	TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	康师傅控股	322 H K	香港 联合 交易所	中国 香港	460,00 0	5932730. 4	0.6 4
48	CHINA INTERNATIONAL CA PITA-H	中金公司	3908 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	340,00 0	5912760. 48	0.6 4
49	KUNLUN ENERGY CO LTD	昆仑能源	135 H K	香港 联合 交易所	中国 香港	988,00 0	5886200. 49	0.6 3
50	ESR CAYMAN LTD	ESR 开曼有限公司	1821 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	250,40 0	5458844. 2	0.5 9
51	MINTH GROUP LTD	敏实集团	425 H K	香港 联合 交	中国 香港	176,00 0	5403860. 35	0.5 8

				易所				
52	PHARMARON BEIJING CO LTD-H	康龙化成	3759 HK	香港联合交易所	中国香港	31,200	5373905.47	0.58
53	ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRI-H	中车时代电气	3898 HK	香港联合交易所	中国香港	135,700	5182718.45	0.56
54	ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	众安在线	6060 HK	香港联合交易所	中国香港	133,800	4893054.76	0.53
55	SHIMAO GROUP HOLDINGS LTD	世茂集团	813 HK	香港联合交易所	中国香港	307,000	4863740.58	0.52
56	GANFENG LITHIUM CO LTD-H	赣锋锂业	1772 HK	香港联合交易所	中国香港	50,000	4826064	0.52
57	SUNAC SERVICES HOLDINGS LTD	融创服务	1516 HK	香港	中国	200,000	4801101.6	0.52

				联合交易所	香港			
58	CIFI HOLDINGS GROUP C O LTD	旭辉控股集团	884 H K	香港 联合交易所	中国 香港	940,00 0	4739860. 51	0.5 1
59	HYGEIA HEALTHCARE HOLD INGS C	海吉亚医疗	6078 HK	香港 联合交易所	中国 香港	55,200	4684943. 23	0.5 0
60	CHINA MEIDONG AUTO HO LDINGS	美东汽车	1268 HK	香港 联合交易所	中国 香港	132,00 0	4651493. 62	0.5 0
61	HANGZHOU TIGERMED CONS ULTI-H	泰格医药	3347 HK	香港 联合交易所	中国 香港	30,500	4618876. 08	0.5 0
62	MING YUAN CLOUD GROUP HOLDIN	明源云	909 H K	香港 联合交易所	中国 香港	143,00 0	4586965. 81	0.4 9

63	TONGCHENG-ELONG HOLDING S LTD	同程艺龙	780 HK	香港联合交易所	中国香港	278,000	4496826.59	0.48
64	GREENTOWN SERVICE GROUP CO L	绿城服务	2869 HK	香港联合交易所	中国香港	442,000	4435419.08	0.48
65	YIHAI INTERNATIONAL HOLDING	颐海国际	1579 HK	香港联合交易所	中国香港	101,000	4382690.17	0.47
66	NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	新华保险	1336 HK	香港联合交易所	中国香港	197,400	4352693.69	0.47
67	POP MART INTERNATIONAL GROUP	泡泡玛特	9992 HK	香港联合交易所	中国香港	66,000	4228630.56	0.45
68	A-LIVING SMART CITY SERVICES	雅生活服务	3319 HK	香港联合交易所	中国香港	130,250	4188825.94	0.45

				交易所				
69	JINXIN FERTILITY GROUP LTD	锦欣生殖	1951 HK	香港联合交易所	中国香港	254,000	4142427.07	0.45
70	HAITONG SECURITIES CO LTD-H	海通证券	6837 HK	香港联合交易所	中国香港	726,800	4112339.06	0.44
71	GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	广汽集团	2238 HK	香港联合交易所	中国香港	700,000	4059718.32	0.44
72	CANSINO BIOLOGICS INC-H	康希诺生物股份公司	6185 HK	香港联合交易所	中国香港	11,600	3982468.01	0.43
73	CHINA YONGDA AUTOMOBILES SER	永达汽车	3669 HK	香港联合交易所	中国香港	343,000	3967107.82	0.43
74	CHINA LESSO GROUP HOL	中国联塑	2128	香	中	246,00	3921892.	0.4

	DINGS L		HK	香港 联合 交易所	国 香港	0	59	2
75	CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	华润电力	836 H K	香港 联合 交易所	中 国 香 港	442,00 0	3898461. 22	0.4 2
76	CHINA TAIPING INSURANC E HOLD	中国太平	966 H K	香港 联合 交易所	中 国 香 港	356,40 0	3831468. 79	0.4 1
77	ZTE CORP-H	中兴通讯	763 H K	香港 联合 交易所	中 国 香 港	187,40 0	3781345. 96	0.4 1
78	JIANGXI COPPER CO LTD -H	江西铜业	358 H K	香港 联合 交易所	中 国 香 港	282,00 0	3730880. 3	0.4 0
79	HUATAI SECURITIES CO LTD-H	华泰证券	6886 HK	香港 联合 交易	中 国 香 港	392,00 0	3718399. 1	0.4 0

				所				
80	BOSIDENG INTL HLDGS LTD	波司登	3998 HK	香港 联合 交易 所	中 国 香 港	776,00 0	3583602. 14	0.3 9
81	HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	华虹半导体	1347 HK	香港 联合 交易 所	中 国 香 港	100,00 0	3569623. 2	0.3 8
82	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	608,00 0	3531214. 39	0.3 8
83	KINGBOARD LAMINATES HDG LTD	建滔积层板	1888 HK	香港 联合 交易 所	中 国 香 港	240,00 0	3478760. 06	0.3 7
84	NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	玖龙纸业	2689 HK	香港 联合 交易 所	中 国 香 港	419,00 0	3472469. 54	0.3 7
85	CHINA MOLYBDENUM CO LTD-H	洛阳钼业	3993 HK	香港 联	中 国 香	897,00 0	3440792. 25	0.3 7

				合 交 易 所	港			
86	YADEA GROUP HOLDINGS LTD	雅迪控股	1585 HK	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	246,00 0	3418351. 06	0.3 7
87	XD INC	心动公司	2400 HK	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	59,600	3397049. 81	0.3 7
88	JIUMAOJIU INTERNATIONAL HOLD	九毛九	9922 HK	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	126,00 0	3328736. 04	0.3 6
89	YANZHOU COAL MINING CO-H	兖州煤业	1171 HK	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	382,00 0	3318401. 61	0.3 6
90	CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	中国银河	6881 HK	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	860,00 0	3313176. 14	0.3 6

91	CHINA RESOURCES CEMENT	华润水泥控 股	1313 HK	香港 联合 交易 所	中国 香港	536,00 0	3291442. 21	0.3 5
92	CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	中国中铁	390 HK	香港 联合 交易 所	中国 香港	960,00 0	3235127. 04	0.3 5
93	CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT	光大环境	257 HK	香港 联合 交易 所	中国 香港	883,00 0	3232797. 22	0.3 5
94	CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	招商局港口	144 HK	香港 联合 交易 所	中国 香港	336,00 0	3170424. 5	0.3 4
95	CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	中国金茂	817 HK	香港 联合 交易 所	中国 香港	1,384, 000	2994156. 67	0.3 2
96	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	210,00 0	2928588. 77	0.3 1

				易所				
97	EVER SUNSHINE LIFESTYLE SERV	永升生活服务	1995 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	182,00 0	2919735. 44	0.3 1
98	GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	富力地产	2777 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	390,80 0	2881067. 02	0.3 1
99	GF SECURITIES CO LTD-H	广发证券	1776 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	333,40 0	2790799. 65	0.3 0
100	TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	滔搏	6110 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	261,00 0	2762439. 03	0.3 0
101	SEAZEN GROUP LTD	新城发展	1030 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	446,00 0	2731352. 52	0.2 9
102	BEIJING ENTERPRISES HDGS	北京控股	392 HK	香港	中国	119,00 0	2727932. 68	0.2 9

				联合交易所	香港			
103	GOME RETAIL HOLDINGS LTD	国美零售	493 HK	香港联合交易所	中国香港	3,250,000	2704260	0.29
104	SUN ART RETAIL GROUP LTD	高鑫零售	6808 HK	香港联合交易所	中国香港	544,000	2616325.79	0.28
105	AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	中航科工	2357 HK	香港联合交易所	中国香港	601,000	2570411.61	0.28
106	KWG GROUP HOLDINGS LTD	合景泰富集团	1813 HK	香港联合交易所	中国香港	292,000	2526860.54	0.27
107	ZOOMLION HEAVY INDUSTRY - H	中联重科	1157 HK	香港联合交易所	中国香港	345,200	2335212.55	0.25

108	CHINA OILFIELD SERVICE S-H	中海油服	2883 HK	香港 联合 交易 所	中国 香港	400,00 0	2316510. 72	0.2 5
109	SINOTRUK HONG KONG LTD	中国重汽	3808 HK	香港 联合 交易 所	中国 香港	164,50 0	2277635. 94	0.2 4
110	AIR CHINA LTD-H	中国国航	753 HK	香港 联合 交易 所	中国 香港	476,00 0	2261560. 16	0.2 4
111	CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD	中海物业	2669 HK	香港 联合 交易 所	中国 香港	320,00 0	2210004. 48	0.2 4
112	HUANENG POWER INTL INC-H	华能国际	902 HK	香港 联合 交易 所	中国 香港	862,00 0	2180449	0.2 3
113	FLAT GLASS GROUP CO LTD-H	福莱特	6865 HK	香港 联合 交易 所	中国 香港	79,000	2103498. 24	0.2 3

				交易所				
11 4	ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	招金矿业	1818 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	336,500	2066362.51	0.22
11 5	TIANNENG POWER INTL LTD	天能动力	819 H K	香港 联合 交易所	中国 香港	178,000	2011337.06	0.22
11 6	BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	北京首都机场股份	694 H K	香港 联合 交易所	中国 香港	466,000	1996908.79	0.21
11 7	LOGAN GROUP CO LTD	龙光集团	3380 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	205,000	1982097.77	0.21
11 8	XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	金风科技	2208 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	191,694	1936387.59	0.21
11	CHINA COMMUNICATIONS S	中国通信服	552 H	香	中	592,00	1911254.	0.2

9	ERVI-H	务股份有限 公司	K	港 联 合 交 易 所	国 香 港	0	48	1
12 0	GREENTOWN CHINA HOLDINGS	绿城中国	3900 HK	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	191,500	1905746.11	0.20
12 1	LUYE PHARMA GROUP LTD	绿叶制药	2186 HK	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	430,000	1828329.38	0.20
12 2	REMEGEN CO LTD-H	荣昌生物	9995 HK	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	18,500	1822588.03	0.20
12 3	YEAHKA LTD	移卡	9923 HK	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	44,800	1820990.44	0.20
12 4	CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	南方航空	1055 HK	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	424,000	1700505.25	0.18

				所				
12 5	CHINA YUHUA EDUCATION CORP L	宇华教育	6169 HK	香港 联合 交易 所	中 国 香 港	282,00 0	1649565. 31	0.1 8
12 6	CHINA AOYUAN GROUP LT D	中国奥园	3883 HK	香港 联合 交易 所	中 国 香 港	301,00 0	1640487. 32	0.1 8
12 7	KWG LIVING GROUP HOLD INGS LT	合景悠活	3913 HK	香港 联合 交易 所	中 国 香 港	185,00 0	1533190. 61	0.1 6
12 8	SHANDONG GOLD MINING CO LT-H	山东黄金	1787 HK	香港 联合 交易 所	中 国 香 港	130,00 0	1486261. 3	0.1 6
12 9	VINDA INTERNATIONAL HO LDINGS	维达国际	3331 HK	香港 联合 交易 所	中 国 香 港	74,000	1471616. 69	0.1 6
13 0	VIVA BIOTECH HOLDINGS	维亚生物	1873 HK	香港 联	中 国 香	176,50 0	1459809. 47	0.1 6

				合 交 易 所	港			
13 1	3SBIO INC	三生制药	1530 HK	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	177,00 0	1413870. 34	0.1 5
13 2	Q TECHNOLOGY GROUP CO LTD	丘钛科技	1478 HK	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	105,00 0	1390904. 93	0.1 5
13 3	AK MEDICAL HOLDINGS L TD	爱康医疗	1789 HK	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	122,00 0	1390738. 51	0.1 5
13 4	POLY PROPERTY SERVICES CO-H	保利物业服 务股份有限 公司	6049 HK	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	26,600	1166426. 39	0.1 3
13 5	COFCO JOYCOME FOODS L TD	中粮家佳康	1610 HK	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	445,00 0	1151557. 12	0.1 2

13 6	CHINA EASTERN AIRLINES CO-H	中国东航	670 K	H	香港 联合 交易 所	中国 香港	386,00 0	1056691. 68	0.1 1
13 7	JOY SPREADER INTERACTI VE TEC	乐享互动	6988 HK		香港 联合 交易 所	中国 香港	358,00 0	944294.3 1	0.1 0
13 8	COMBA TELECOM SYSTEMS HOLDIN	京信通信	2342 HK		香港 联合 交易 所	中国 香港	444,00 0	749970.3 5	0.0 8
13 9	KOOLEARN TECHNOLOGY HO LDING	新东方在线	1797 HK		香港 联合 交易 所	中国 香港	84,500	684123.7	0.0 7
14 0	CHINA HUIZHAN DAIRY H OLDINGS	辉山乳业	6863 HK		香港 联合 交易 所	中国 香港	4,338, 000	0	-

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

本基金本报告期末未持有积极投资。

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	Nongfu Spring Co Ltd	9633 HK	20,481,349.90	1.66
2	GCL-POLY ENERGY HOLD	3800 HK	12,541,685.37	1.02
3	ESR Cayman Ltd	1821 HK	7,524,061.47	0.61
4	Country Garden Services Holdin	6098 HK	7,054,439.90	0.57
5	ZHONGDA INTERNATIONAL HOLDINGS LIMITED	909 HK	6,764,491.78	0.55
6	Geely Automobile Holdings Limited	175 HK	6,309,668.38	0.51
7	CHINA YONGDA AUTOMOBILES SER	3669 HK	5,904,756.98	0.48
8	China Meidong Auto Holdings Limited	1268 HK	5,822,701.43	0.47
9	Yadea Group Holdings Ltd	1585 HK	5,678,307.40	0.46
10	SUNNY OPTICAL TECH	2382 HK	5,675,276.52	0.46
11	SUNAC SERVICES HOLDINGS LTD	1516 HK	5,647,728.02	0.46
12	Hangzhou Tigermed Consulting C	3347 HK	5,279,844.07	0.43
13	Pop Mart International Group L	9992 HK	5,148,109.21	0.42
14	CHINA MENGNIU DAIRY	2319 HK	4,840,936.69	0.39
15	SHENZHOU INTERNATION	2313 HK	4,683,895.24	0.38
16	CHINA GAS HOLDINGS L	384 HK	4,504,139.07	0.36
17	YEAHKA LTD	9923 HK	4,206,716.53	0.34
18	LI NING CO	2331 HK	3,947,459.25	0.32
19	Hygeia Healthcare Holdings Co	6078 HK	3,325,210.01	0.27
20	ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	6060 HK	3,307,815.08	0.27

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 TECH	2382 HK	20,965,538.27	1.7
2	海尔智家	06690 HG	20,249,425.74	1.64
3	Geely Automobile Holdings Limited	175 HK	19,976,457.86	1.62
4	SHENZHOU INTERNATIONAL	2313 HK	19,894,245.42	1.61
5	LI NING CO	2331 HK	19,144,117.61	1.55
6	CHINA MENGNIU DAIRY	2319 HK	18,390,043.54	1.49
7	Country Garden Services Holding	6098 HK	15,217,400.57	1.23
8	CHINA PHARMACEUTICAL	1093 HK	13,777,495.98	1.12
9	SUNAC ORD	1918 HK	11,463,087.25	0.93
10	GREAT WALL AUTOMOBIL	2333 HK	10,774,875.83	0.87
11	INNOVENT BIOLOGICS INC	1801 HK	10,385,269.10	0.84
12	KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	268 HK	10,285,583.94	0.83
13	XINYI GLASS HOLDINGS	868 HK	10,071,610.15	0.82
14	ZIJIN MINING GROUP	2899 HK	9,702,436.27	0.79
15	WH GROUP LTD	288 HK	9,681,055.09	0.78
16	Goodbaby China Holdings Limited	6186 HK	9,010,182.34	0.73
17	CHINA GAS HOLDINGS L	384 HK	8,984,847.02	0.73
18	LENOVO GROUP LTD	992 HK	8,898,137.49	0.72
19	China Conch Venture Holdings Limited	586 HK	8,839,131.11	0.72
20	信义光能	968 HK	8,760,517.49	0.71

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	264,738,006.87
卖出收入（成交）总额	661,191,174.68

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投资。

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投资。

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	26,375.81
2	应收证券清算款	9,552,876.31
3	应收股利	8,550,381.38
4	应收利息	3,898.49
5	应收申购款	498,557.44
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	18,632,089.43

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

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

本基金本报告期末未持有积极投资部分的股票投资。

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	96,413	4,935.51	186,046,496.15	39.10	289,801,044.20	60.90

小 华 宝 香 港 中 小 C	6,274	1,187.50	0.00	0.00	7,450,386.86	100.00
合 计	102,687	4,706.52	186,046,496.15	38.50	297,251,431.06	61.50

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	姜常华	2,464,990.00	5.03
2	张巍	2,061,668.00	4.21
3	陈庆林	1,792,146.00	3.66
4	邓荣	1,217,312.00	2.48
5	任士强	1,164,200.00	2.37
6	郭昕	1,157,800.00	2.36
7	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	1,057,417.00	2.16
8	史文婕	1,020,000.00	2.08
9	邓荣	805,465.00	1.64
10	朱庆华	757,887.00	1.55

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	163,711.21	0.0344
	华宝香港中小 C	8,273.70	0.1111
	合计	171,984.91	0.0356

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	香港中小	0
	华宝香港中小 C	0

负责人持有本开放式基金		
	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	700,196,646.68	8,516,275.41
本报告期基金总申购份额	145,659,873.43	65,754,792.70
减：本报告期基金总赎回份额	370,008,979.76	66,820,681.25
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期末基金份额总额	475,847,540.35	7,450,386.86

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、基金管理人的重大人事变动

本报告期内，基金管理人无重大人事变动。

2、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，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	769,721,707.54	83.13%	615,779.92	90.79%	-
J.P.Morgan Securities (Asia Pacific) Limited	1	81,677,554.37	8.82%	32,671.03	4.82%	-

Daiwa Securities SMBC Singapore Ltd	1	74,529,919.60	8.05%	29,812.04	4.40%	-
BOCI Securities Ltd	1	-	-	-	-	-
China International Capital corporation HK Securities Ltd	1	-	-	-	-	-
Nomura International (HK) Ltd	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
广州证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
华信证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
中金国际	1	-	-	-	-	-

注：1、基金管理人选择交易单元的标准和程序如下：

（1）选择标准： 资力雄厚，信誉良好；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	-	-	-	-	-	-	-	-
J. P. Morgan Securities (Asia Pacific) Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
Daiwa Securities SMBC Singapore Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-
BOCI Securities Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-
China International Capital corporation HK Securities Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-
Nomura International (HK) Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-	-	-

光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金国际	-	-	-	-	-	-	-	-

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	华宝标普香港上市中国中小盘指数证券投资基金(LOF)2021年第1季度报告	2021-4-22	基金管理人网站
2	华宝标普香港上市中国中小盘指数证券投资基金(LOF)(A类份额)基金产品资料概要(更新)	2021-3-31	基金管理人网站
3	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4季度报告	2021-1-22	基金管理人网站
4	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(更新)	2021-3-31	基金管理人网站
5	华宝标普香港上市中国中小盘指数证券投资基金(LOF)(A类份额)基金产品资料概要(更新)	2021-5-13	基金管理人网站
6	华宝标普香港上市中国中小盘指数证券投资基金(LOF)2020年年度报告	2021-3-31	基金管理人网站
7	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(更新)	2021-5-13	基金管理人网站
8	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	2021-3-31	基金管理人网站
9	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	2021-6-29	基金管理人网站, 上海证券报
10	华宝基金管理有限公司华宝标普香港上市中国中小盘指数证券投资基金(LOF)基金经理变更公告	2021-5-11	基金管理人网站, 上海证券报
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	2021-5-17	基金管理人网站, 上海证券报

	的公告		
12	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	2021-3-30	基金管理人网站, 上海证券报
13	关于华宝标普香港上市中国中小盘指数证券投资基金（LOF）2021 年开放日的提示性公告	2021-1-4	基金管理人网站, 上海证券报
14	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	2021-3-31	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
15	关于华宝现金宝货币基金 E 类份额转换、赎回转申购、定期转换、定期赎回转申购业务费率优惠公告	2021-4-15	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
16	华宝基金关于旗下部分开放式基金新增阳光人寿为代销机构的公告	2021-5-14	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
17	华宝基金关于旗下部分开放式基金新增华鑫证券为代销机构的公告	2021-5-28	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
18	华宝基金管理有限公司关于提示投资者完善身份信息公告	2021-3-9	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
19	华宝基金关于旗下部分开放式基金参加交通银行申购及定投手续费率优惠活动的公告	2021-6-30	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
20	关于警惕冒用华宝基金管理有限公司名义进行诈骗活动的特别提示公告	2021-2-19	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
21	华宝基金管理有限公司关于深圳分公司负责人变更的公告	2021-6-22	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

§ 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	20210118~20210119, 20210421~20210630	134,395,425.54	0.00	0.00	134,395,425.54	27.81
产品特有风险							
<p>报告期内本基金出现单一投资者持有基金份额比例超过 20%的情况。在单一投资者持有基金份额比例较高的情况下，如该投资者集中赎回，可能会增加基金的流动性风险。此外，由于基金在遇到大额赎回的时候可能需要变现部分资产，可能对持有资产的价格形成冲击，增加基金的市场风险。基金管理人将专业审慎、勤勉尽责地运作基金资产，加强防范流动性风险、市场风险，保护持有人利益。</p>							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

基金管理人于 2021 年 3 月 31 日发布《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》，具体内容详见公司公告，请投资者予以关注。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

中国证监会批准基金设立的文件；

华宝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

2021 年 8 月 27 日