

# 华宝第三产业灵活配置混合型证券投资基金

## 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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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 01 月 01 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                         | 6         |
| 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>7</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                         | 7         |
| 3.2 基金净值表现                              | 7         |
| 3.3 其他指标                                | 8         |
| <b>§ 4 管理人报告</b>                        | <b>9</b>  |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况                        | 9         |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明              | 11        |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 11        |
| 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             | 11        |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望             | 12        |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 12        |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 13        |
| 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       | 13        |
| <b>§ 5 托管人报告</b>                        | <b>13</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                  | 13        |
| 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 | 13        |
| 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见       | 14        |
| <b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>              | <b>14</b> |
| 6.1 资产负债表                               | 14        |
| 6.2 利润表                                 | 15        |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表                      | 16        |
| 6.4 报表附注                                | 18        |
| <b>§ 7 投资组合报告</b>                       | <b>43</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况                          | 43        |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合                    | 44        |
| 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       | 45        |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动                     | 50        |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合                    | 51        |

|   |           |
|---|-----------|
| 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 .....    | 51        |
| 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 ..... | 52        |
| 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 ..... | 52        |
| 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....    | 52        |
| 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....             | 52        |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....             | 52        |
| 7.12 投资组合报告附注 .....                         | 52        |
| <b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>                  | <b>54</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....                 | 54        |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....              | 54        |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....      | 54        |
| <b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>                  | <b>54</b> |
| <b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>                    | <b>55</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 .....                      | 55        |
| 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....      | 55        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....           | 55        |
| 10.4 基金投资策略的改变 .....                        | 55        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....                 | 55        |
| 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....         | 56        |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....                | 56        |
| 10.8 其他重大事件 .....                           | 57        |
| <b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>            | <b>59</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 .....    | 59        |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....                   | 59        |
| <b>§ 12 备查文件目录 .....</b>                    | <b>60</b> |
| 12.1 备查文件目录 .....                           | 60        |
| 12.2 存放地点 .....                             | 60        |
| 12.3 查阅方式 .....                             | 60        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                     |
|------------|---------------------|
| 基金名称       | 华宝第三产业灵活配置混合型证券投资基金 |
| 基金简称       | 华宝第三产业混合            |
| 基金主代码      | 004481              |
| 基金运作方式     | 契约型开放式              |
| 基金合同生效日    | 2017 年 5 月 25 日     |
| 基金管理人      | 华宝基金管理有限公司          |
| 基金托管人      | 中国工商银行股份有限公司        |
| 报告期末基金份额总额 | 164,131,032.19 份    |
| 基金合同存续期    | 不定期                 |

### 2.2 基金产品说明

|      |  |
|------|--|
| 投资目标 | 在严格控制风险的前提下,通过挖掘第三产业上市公司的投资机会,力争实现基金资产的长期稳健增值。   |
| 投资策略 | <p>1、大类资产配置策略</p> <p>本基金采取积极的大类资产配置策略,通过宏观策略研究,综合考虑宏观经济、国家财政政策、货币政策、产业政策以及市场流动性等方面的因素,对相关资产类别的预期收益进行动态跟踪,决定大类资产配置比例。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>本基金采取积极的股票选择策略,将“自上而下”的行业配置策略和“自下而上”的股票精选策略相结合,根据对宏观经济、中观行业和市场风险特征变化的判断,进行投资组合的动态优化,实现基金资产长期稳定增值。</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>本基金将投资于债券、货币市场工具和资产支持证券等,以有效利用基金资产,提高基金资产的投资收益。</p> <p>4、权证投资策略</p> <p>本基金将在严格控制风险的前提下,主动进行权证投资。基金权证投资将以价值分析为基础,在采用数量化模型分析其合理定价的基础上,把握市场的短期波动,进行积极操作,在风险可控的前提下力争实现稳健的超额收益。</p> <p>5、股指期货投资策略</p> <p>本基金将依据法律法规并根据风险管理的原则参与股指期货投资。本基金将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究,采用流动性好、交易活跃的期货合约,并充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征。</p> <p>6、资产支持证券投资策略</p> <p>基金将通过宏观经济、提前偿还率、资产池结构及资产池资产所在行业景气变化等因素的研究,预测资产池未来现金流变化;研究标的的证券发行条款,预测提前偿还率变化对标的的证券的久期与收益率</p> |

|        |  |
|--------|--|
|        | <p>的影响，同时密切关注流动性对标的证券收益率的影响。综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择和把握市场交易机会等积极策略，在严格控制风险的情况下，通过信用研究和流动性管理，选择风险调整后的收益高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。</p> <p>7、其他金融工具投资策略</p> <p>如法律法规或监管机构以后允许基金投资于其他金融产品，基金管理人将根据监管机构的规定及本基金的投资目标，制定与本基金相适应的投资策略、比例限制、信息披露方式等。</p> |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数收益率×55%+上证国债指数收益率×45%。  |
| 风险收益特征 | 本基金是一只主动投资的混合型基金，其长期平均预期风险和预期收益率低于股票型基金，高于债券型基金、货币市场基金。  |

### 2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目          |      | 基金管理人  | 基金托管人                |
|-------------|------|--|----------------------|
| 名称          |      | 华宝基金管理有限公司                                   | 中国工商银行股份有限公司         |
| 信息披露<br>负责人 | 姓名   | 周雷   | 郭明                   |
|             | 联系电话 | 021-38505888                                 | 010-66105799         |
|             | 电子邮箱 | xxpl@fsfund.com                              | custody@icbc.com.cn  |
| 客户服务电话      |      | 400-700-5588、400-820-5050、<br>021-38924558   | 95588                |
| 传真          |      | 021-38505777                                 | 010-66105798         |
| 注册地址        |      | 中国（上海）自由贸易试验区世<br>纪大道 100 号上海环球金融中<br>心 58 楼 | 北京市西城区复兴门内大街 55<br>号 |
| 办公地址        |      | 中国（上海）自由贸易试验区世<br>纪大道 100 号上海环球金融中<br>心 58 楼 | 北京市西城区复兴门内大街 55<br>号 |
| 邮政编码        |      | 200120                                       | 100140               |
| 法定代表人       |      | XIAOYI HELEN HUANG                           | 陈四清                  |

### 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<br>址 | www.fsfund.com       |
| 基金中期报告备置地点              | 基金管理人办公场所和基金托管人办公场所。 |

### 2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称    | 办公地址   |
|--------|-------|--|
| 注册登记机构 | 基金管理人 | 中国（上海）自由贸易试验区世<br>纪大道 100 号上海环球金融中<br>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) |
|---------------|---------------------------|
| 本期已实现收益       | 57,109,119.71             |
| 本期利润          | 22,134,948.54             |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.1217                    |
| 本期加权平均净值利润率   | 8.85%                     |
| 本期基金份额净值增长率   | 5.96%                     |
| 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      | 69,724,299.76             |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.4248                    |
| 期末基金资产净值      | 233,855,331.95            |
| 期末基金份额净值      | 1.4248                    |
| 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   | 42.48%                    |

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、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）

3、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。

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

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段    | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③   | ②—④   |
|-------|----------|-------------|------------|---------------|-------|-------|
| 过去一个月 | 2.53%    | 0.96%       | -1.04%     | 0.45%         | 3.57% | 0.51% |
| 过去三个月 | 9.41%    | 0.94%       | 2.37%      | 0.54%         | 7.04% | 0.40% |
| 过去六个月 | 5.96%    | 1.37%       | 1.14%      | 0.72%         | 4.82% | 0.65% |

|            |        |       |        |       |        |       |
|------------|--------|-------|--------|-------|--------|-------|
| 过去一年       | 46.60% | 1.33% | 15.13% | 0.73% | 31.47% | 0.60% |
| 过去三年       | 47.54% | 1.05% | 33.71% | 0.75% | 13.83% | 0.30% |
| 自基金合同生效起至今 | 42.48% | 0.99% | 37.99% | 0.69% | 4.49%  | 0.30% |

注：1、本基金业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×55% + 上证国债指数收益率×45%

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



注：按照基金合同的约定，自基金成立日期的 6 个月内达到规定的资产组合，截至 2017 年 11 月 25 日，本基金已达到合同规定的资产配置比例。

### 3.3 其他指标

无

## § 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           |      |   |
|-----|---------|-----------------|----------------|------|---|
| 王正  | 本基金基金经理 | 2021 年 1 月 4 日  | -              | 8 年  | 硕士。2012 年 7 月加入华宝基金管理有限公司，先后担任助理量化分析师、分析师、基金经理助理等职务。2020 年 1 月起任华宝量化对冲策略混合型发起式证券投资基金、华宝沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金基金经理。2021 年 1 月起任华宝智慧产业灵活配置混合型证券投资基金、华宝第三产业灵活配置混合型证券投资基金、华宝中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金经理。2021 年 6 月起任华宝安盈混合型证券投资基金基金经理。   |
| 庄皓亮 | 本基金基金经理 | 2021 年 3 月 16 日 | -              | 8 年  | 硕士。曾在长江证券、华夏基金从事证券研究、投资管理工作，2021 年 1 月加入华宝基金管理有限公司，2021 年 3 月 16 日起任华宝智慧产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理、华宝中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金经理、华宝第三产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理。  |
| 陈建华 | 本基金基金经理 | 2017 年 5 月 27 日 | 2021 年 1 月 4 日 | 20 年 | 硕士。曾在南方证券上海分公司工作。2007 年 8 月加入华宝基金管理有限公司，先后在研究部、量化投资部任助理分析师、数量分析师、基金经理助理等职务，现任指数研发投资部基金经理。2012 年 12 月起任华宝中证 100 指数型证券投资基金基金经理。2015 年 4 月至 2020 年 2 月任华宝事件驱动混合型证券投资基金基金经理。2017 年 5 月至 2021 年 1 月任华宝智慧产业灵活配置混合型证券投资基金、华宝第三产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2017 年 7 月至 2019 年 3 月任华宝新优享灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2021 年 2 月起任华宝中证细分化工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 月起任华宝中证金融科技主题交易型开放式指数证券投资基金、华宝中证金融科技主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2021 年 4 月起任华宝中证新材料主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2021 年 6 月起任华宝中证智能电动汽车交易型开放式指数证券投资基金、华宝中证细分化工产业主题交易型开放式指数证券投资基金发起 |

|  |  |  |  |  |            |
|--|--|--|--|--|------------|
|  |  |  |  |  | 式联接基金基金经理。 |
|--|--|--|--|--|------------|

注：1、任职日期以及离任日期均以基金公告为准。

2、证券从业含义遵从行业协会《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》及其各项实施细则、《华宝第三产业灵活配置混合型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

宏观环境角度，2021 年上半年中国经济整体复苏态势向好。新冠疫情控制良好使得中国得以持续推进复工复产，消费市场亦稳步回暖。中国经济的各项指标均在持续上升。海外疫情随着疫苗接种而逐步好转，经济持续复苏。

市场方面，上半年 A 股波动较大，市场结构性分化较为明显。与大宗商品关联较大的周期板

块如钢铁、有色、化工，以及高景气度的成长板块如电气设备、电子等涨幅居前，而景气度不佳的板块如传媒、家电等表现一般。因子方面，综合上半年来看，成长类的因子表现较好，而价值因子总体低迷。第三产业基金运用行业配置和因子选股模型进行股票筛选和组合构建，在符合第三产业投资方向的各行业内精选业绩和估值相匹配、基本面优质的股票。本报告期内成长、盈利等因子均有不错的表现。另外，基金通过积极参与新股申购等低风险机会来增厚业绩。

#### 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 5.96%，业绩比较基准收益率为 1.14%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，世界经济增长速度有可能一定程度放缓，各大经济体疫情情况不同会影响整体复苏节奏。通胀的预期高企和总需求增速回落可能会削弱复苏动能。国内方面整体经济预期稳定，央行保持了稳健灵活的货币政策，护航经济平稳运行。

市场方面，判断下半年 A 股市场整体仍然是震荡市。市场会容忍一些高景气板块的高估值，但不会有大规模的估值扩张。在全球经济减速、流动性宽松的背景下，中国经济仍蕴含着巨大的动能。放眼全球，A 股估值横向比较仍有吸引力，我们对市场的长期前景保持乐观态度。

行业层面，估值约束下，市场前期的极致分化将有望缓和，市场风格将进行再平衡。一方面，基本面预期好转的传统价值板块可能有阶段性修复；另一方面，高景气成长板块轮动加速，短线波动加大并存在一定的不确定性，但一些长期赛道的中长期前景依然看好。新能源汽车、半导体等高景气板块仍然有望保持较高增速。在下半年市场中，需要密切关注低估值板块的修复机会。

本基金将继续关注符合投资逻辑的基本面指标，在投资过程中注重对个股基本面质地的考察，利用模型甄选出具备良好经营能力、估值与成长匹配的优质公司，争取稳健回报。

#### 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

本基金本报告期未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对华宝第三产业灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，华宝第三产业灵活配置混合型证券投资基金的管理人——华宝基金管理有限公司在华宝第三产业灵活配置混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购

赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人依法对华宝基金管理有限公司编制和披露的华宝第三产业灵活配置混合型证券投资基金 2021 年半年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：华宝第三产业灵活配置混合型证券投资基金

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<br>2021 年 6 月 30 日         | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日         |
|-----------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| <b>资产：</b>      |            |                                |                                  |
| 银行存款            | 6.4.7.1    | 29,137,066.78                  | 32,353,999.97                    |
| 结算备付金           |            | 180,503.14                     | 810,231.01                       |
| 存出保证金           |            | 53,159.89                      | 63,726.50                        |
| 交易性金融资产         | 6.4.7.2    | 206,831,492.14                 | 298,452,447.06                   |
| 其中：股票投资         |            | 206,756,492.14                 | 298,452,447.06                   |
| 基金投资            |            | -                              | -                                |
| 债券投资            |            | 75,000.00                      | -                                |
| 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         |            | 1,392,344.81                   | 1,025,735.82                     |
| 应收利息            | 6.4.7.5    | 2,197.99                       | 3,792.95                         |
| 应收股利            |            | -                              | -                                |
| 应收申购款           |            | 798.80                         | 476.30                           |
| 递延所得税资产         |            | -                              | -                                |
| 其他资产            | 6.4.7.6    | -                              | -                                |
| 资产总计            |            | 237,597,563.55                 | 332,710,409.61                   |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2021 年 6 月 30 日</b> | <b>上年度末<br/>2020 年 12 月 31 日</b> |
| <b>负债：</b>      |            |                                |                                  |

|               |          |                |                |
|---------------|----------|----------------|----------------|
| 短期借款          |          | -              | -              |
| 交易性金融负债       |          | -              | -              |
| 衍生金融负债        | 6.4.7.3  | -              | -              |
| 卖出回购金融资产款     |          | -              | -              |
| 应付证券清算款       |          | 2,731,664.37   | -              |
| 应付赎回款         |          | 4,487.71       | 5,716.63       |
| 应付管理人报酬       |          | 271,716.31     | 393,065.26     |
| 应付托管费         |          | 45,286.04      | 65,510.86      |
| 应付销售服务费       |          | -              | -              |
| 应付交易费用        | 6.4.7.7  | 599,803.83     | 470,995.87     |
| 应交税费          |          | 0.23           | 0.02           |
| 应付利息          |          | -              | -              |
| 应付利润          |          | -              | -              |
| 递延所得税负债       |          | -              | -              |
| 其他负债          | 6.4.7.8  | 89,273.11      | 170,012.55     |
| 负债合计          |          | 3,742,231.60   | 1,105,301.19   |
| <b>所有者权益：</b> |          |                |                |
| 实收基金          | 6.4.7.9  | 164,131,032.19 | 246,592,425.32 |
| 未分配利润         | 6.4.7.10 | 69,724,299.76  | 85,012,683.10  |
| 所有者权益合计       |          | 233,855,331.95 | 331,605,108.42 |
| 负债和所有者权益总计    |          | 237,597,563.55 | 332,710,409.61 |

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.4248 元，基金份额总额 164,131,032.19 份。

## 6.2 利润表

会计主体：华宝第三产业灵活配置混合型证券投资基金

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       |          | 25,712,795.76                   | 6,339,330.06                    |
| 1. 利息收入    |          | 55,643.80                       | 124,388.59                      |
| 其中：存款利息收入  | 6.4.7.11 | 54,435.16                       | 90,444.08                       |
| 债券利息收入     |          | 5.90                            | -                               |
| 资产支持证券利息收入 |          | -                               | -                               |
| 买入返售金融资产收入 |          | 1,202.74                        | 33,944.51                       |
| 证券出借利息收入   |          | -                               | -                               |
| 其他利息收入     |          | -                               | -                               |

|                        |            |                |               |
|------------------------|------------|----------------|---------------|
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）      |            | 60,335,444.49  | 13,108,556.33 |
| 其中：股票投资收益              | 6.4.7.12   | 59,124,256.16  | 12,033,883.16 |
| 基金投资收益                 | -          | -              | -             |
| 债券投资收益                 | 6.4.7.13   | -              | -             |
| 资产支持证券投资               | 6.4.7.13.5 | -              | -             |
| 收益                     |            |                |               |
| 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   | 1,211,188.33   | 1,074,673.17  |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.17   | -34,974,171.17 | -6,942,956.56 |
| 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   | 295,878.64     | 49,341.70     |
| 减：二、费用                 |            | 3,577,847.22   | 1,555,502.68  |
| 1. 管理人报酬               | 6.4.10.2.1 | 1,884,751.00   | 1,166,522.20  |
| 2. 托管费                 | 6.4.10.2.2 | 314,125.15     | 194,420.37    |
| 3. 销售服务费               | 6.4.10.2.3 | -              | -             |
| 4. 交易费用                | 6.4.7.19   | 1,287,242.10   | 123,995.83    |
| 5. 利息支出                |            | -              | -             |
| 其中：卖出回购金融资产支出          |            | -              | -             |
| 6. 税金及附加               |            | 0.02           | -             |
| 7. 其他费用                | 6.4.7.20   | 91,728.95      | 70,564.28     |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）    |            | 22,134,948.54  | 4,783,827.38  |
| 减：所得税费用                |            | -              | -             |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列）      |            | 22,134,948.54  | 4,783,827.38  |

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华宝第三产业灵活配置混合型证券投资基金

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<br>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、期初所有者权益（基金净值） | 246,592,425.32                        | 85,012,683.10 | 331,605,108.42 |
| 二、本期经营活动产生的基金净  | -                                     | 22,134,948.54 | 22,134,948.54  |

|  |  |                |                 |
|--|--|----------------|-----------------|
| 值变动数（本期利润）                             |  |                |                 |
| 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）      | -82,461,393.13                             | -37,423,331.88 | -119,884,725.01 |
| 其中：1. 基金申购款                            | 75,149,466.03                              | 28,464,579.00  | 103,614,045.03  |
| 2. 基金赎回款                               | -157,610,859.16                            | -65,887,910.88 | -223,498,770.04 |
| 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）                        | 164,131,032.19                             | 69,724,299.76  | 233,855,331.95  |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>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）                        | 183,954,113.22                             | -12,158,032.80 | 171,796,080.42  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -  | 4,783,827.38   | 4,783,827.38    |
| 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）      | -40,800,969.25                             | 3,348,702.92   | -37,452,266.33  |
| 其中：1. 基金申购款                            | 651,271.19                                 | -55,172.33     | 596,098.86      |
| 2. 基金赎回款                               | -41,452,240.44                             | 3,403,875.25   | -38,048,365.19  |
| 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                                | 143,153,143.97                             | -4,025,502.50  | 139,127,641.47  |

|          |  |  |  |
|----------|--|--|--|
| 权益(基金净值) |  |  |  |
|----------|--|--|--|

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>黄小蕙</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

华宝第三产业灵活配置混合型证券投资基金(原名华宝兴业第三产业灵活配置混合型证券投资基金,以下简称“本基金”)系由基金管理人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》、《华宝兴业第三产业灵活配置混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)及其他有关法律法规的规定,经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)以证监许可[2016]2276 号文批准公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限为不定期,首次设立募集基金份额为 200,089,305.26 份,经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)验证,并出具了编号为德师报(验)字(17)第 00105 号的验资报告。基金合同于 2017 年 5 月 25 日正式生效。本基金的基金管理人为华宝基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《华宝基金管理有限公司关于旗下基金更名事宜的公告》,华宝兴业第三产业灵活配置混合型证券投资基金于 2017 年 12 月 30 日起更名为华宝第三产业灵活配置混合型证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《华宝第三产业灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《华宝第三产业灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、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)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、权证、股指期货以及经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的相关规定。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为:本基金将基金资产的 0%-95%投资于股票资产,其中,投资于第三产业主题相关股票的比例不低于非现金基金资产的 80%;每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%;股指期货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：沪深 300 指数收益率×55%+上证国债指数收益率×45%。

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

无

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

无

##### 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<br>2021 年 6 月 30 日 |
|----|------------------------|
|----|------------------------|

|                |               |
|----------------|---------------|
| 活期存款           | 29,137,066.78 |
| 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             | 29,137,066.78 |

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日 |                |               |
|---------------|------------------------|----------------|---------------|
|               | 成本                     | 公允价值           | 公允价值变动        |
| 股票            | 188,797,510.11         | 206,756,492.14 | 17,958,982.03 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | -                      | -              | -             |
| 债券            | 交易所市场                  | 75,000.00      | 75,000.00     |
|               | 银行间市场                  | -              | -             |
|               | 合计                     | 75,000.00      | 75,000.00     |
| 资产支持证券        | -                      | -              | -             |
| 基金            | -                      | -              | -             |
| 其他            | -                      | -              | -             |
| 合计            | 188,872,510.11         | 206,831,492.14 | 17,958,982.03 |

#### 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<br>2021 年 6 月 30 日 |
|----------|------------------------|
| 应收活期存款利息 | 2,089.01               |
| 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  | 78.97    |
| 应收债券利息     | 6.11     |
| 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         | 23.90    |
| 合计         | 2,197.99 |

#### 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<br>2021年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 599,803.83        |
| 银行间市场应付交易费用 | -                 |
| 合计          | 599,803.83        |

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2021年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                 |
| 应付赎回费       | 12.96             |
| 应付证券出借违约金   | -                 |
| 预提费用        | 89,260.15         |
| 合计          | 89,273.11         |

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>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          | 246,592,425.32             | 246,592,425.32  |
| 本期申购          | 75,149,466.03              | 75,149,466.03   |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -157,610,859.16            | -157,610,859.16 |
| - 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           | 164,131,032.19             | 164,131,032.19  |

注：申购含红利再投以及转换入份(金)额，赎回含转换出份(金)额。

#### 6.4.7.10 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        |
|----------------|----------------|----------------|----------------|
| 上年度末           | 34,212,317.88  | 50,800,365.22  | 85,012,683.10  |
| 本期利润           | 57,109,119.71  | -34,974,171.17 | 22,134,948.54  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -19,512,772.20 | -17,910,559.68 | -37,423,331.88 |
| 其中：基金申购款       | 26,685,316.56  | 1,779,262.44   | 28,464,579.00  |
| 基金赎回款          | -46,198,088.76 | -19,689,822.12 | -65,887,910.88 |
| 本期已分配利润        | -              | -              | -              |
| 本期末            | 71,808,665.39  | -2,084,365.63  | 69,724,299.76  |

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 活期存款利息收入  | 50,108.81                  |
| 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 | 3,644.03                   |
| 其他        | 682.32                     |
| 合计        | 54,435.16                  |

#### 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<br>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 | 59,124,256.16              |
| 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               | 59,124,256.16              |

##### 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<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 460,715,198.79             |
| 减：卖出股票成本总额 | 401,590,942.63             |
| 买卖股票差价收入   | 59,124,256.16              |

6.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无

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

无

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

无

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

无

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

无

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无

## 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

无

## 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |
|---------------|----------------------------|
| 股票投资产生的股利收益   | 1,211,188.33               |
| 其中：证券出借权益补偿收入 | -                          |
| 基金投资产生的股利收益   | -                          |
| 合计            | 1,211,188.33               |

## 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称                   | 本期<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |
|------------------------|----------------------------|
| 1. 交易性金融资产             | -34,974,171.17             |
| 股票投资                   | -34,974,171.17             |
| 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                     | -34,974,171.17             |

## 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |
|---------|----------------------------|
| 基金赎回费收入 | 195,101.38                 |
| 基金转换费收入 | 100,777.26                 |
| 合计      | 295,878.64                 |

注：（1）本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

(2) 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成, 其中不低于转出基金的赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产。

#### 6.4.7.19 交易费用

单位: 人民币元

| 项目        | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 1,287,242.10                          |
| 银行间市场交易费用 | -                                     |
| 合计        | 1,287,242.10                          |

#### 6.4.7.20 其他费用

单位: 人民币元

| 项目      | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
|---------|---------------------------------------|
| 审计费用    | 29,752.78                             |
| 信息披露费   | 59,507.37                             |
| 证券出借违约金 | -                                     |
| 银行费用    | 2,468.80                              |
| 合计      | 91,728.95                             |

#### 6.4.7.21 分部报告

无

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日, 本基金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、注册登记机构、基金销售机构 |
| 中国工商银行股份有限公司 (“中国工商银行”) | 基金托管人               |
| 华宝信托有限责任公司 (“华宝信托”)     | 基金管理人的股东            |

|   |                   |
|---|-------------------|
| 华平资产管理有限合伙<br>（“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

###### 6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行交易。

###### 6.4.10.1.2 债券交易

无

###### 6.4.10.1.3 债券回购交易

无

###### 6.4.10.1.4 权证交易

无

###### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无

##### 6.4.10.2 关联方报酬

###### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2021年1月1日至2021年6<br>月30日 | 上年度可比期间<br>2020年1月1日至2020年<br>6月30日 |
|-----------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 1,884,751.00                   | 1,166,522.20                        |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 150,422.21                     | 5,383.50                            |

注：支付基金管理人华宝基金的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50%的年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×1.50%÷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 | 314,125.15                      | 194,420.37                      |

注：支付基金托管人中国工商银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.25%÷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

无

#### 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

本基金本报告期内及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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

份额单位：份

| 关联方名称        | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日 |                              | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日 |                              |
|--------------|------------------------|------------------------------|--------------------------|------------------------------|
|              | 持有的<br>基金份额            | 持有的基金份额<br>占基金总份额的比<br>例 (%) | 持有的<br>基金份额              | 持有的基金份额<br>占基金总份额的比<br>例 (%) |
| 华宝投资有限<br>公司 | 50,008,000.00          | 30.47                        | 50,008,000.00            | 20.28                        |

#### 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<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |           | 上年度可比期间<br>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    |
| 中国工商银行股份有限公司 | 29,137,066.78              | 50,108.81 | 10,345,655.68                   | 88,935.06 |

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期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

金额单位：人民币元

| 6.4.12.1.1 受限证券类别：股票 |      |             |             |        |       |        |          |          |           |    |
|----------------------|------|-------------|-------------|--------|-------|--------|----------|----------|-----------|----|
| 证券代码                 | 证券名称 | 成功认购日       | 可流通日        | 流通受限类型 | 认购价格  | 期末估值单价 | 数量(单位：股) | 期末成本总额   | 期末估值总额    | 备注 |
| 300614               | 百川畅银 | 2021年5月18日  | 2021年11月25日 | 新股锁定   | 9.19  | 40.38  | 329      | 3,023.51 | 13,285.02 | -  |
| 300919               | 中伟股份 | 2020年12月15日 | 2021年7月2日   | 新股锁定   | 24.6  | 163    | 357      | 8,782.20 | 58,191.00 | -  |
| 300926               | 博俊科技 | 2020年12月29日 | 2021年7月12日  | 新股锁定   | 10.76 | 22.2   | 359      | 3,862.84 | 7,969.80  | -  |
| 300927               | 江天化学 | 2020年12月29日 | 2021年7月7日   | 新股锁定   | 13.39 | 30.1   | 217      | 2,905.63 | 6,531.70  | -  |
| 300929               | 华骐环保 | 2021年1月12日  | 2021年7月21日  | 新股锁定   | 13.87 | 29.55  | 183      | 2,538.21 | 5,407.65  | -  |

|        |      |                    |                    |          |       |        |       |          |           |   |
|--------|------|--------------------|--------------------|----------|-------|--------|-------|----------|-----------|---|
| 300930 | 屹通新材 | 2021年<br>1月13<br>日 | 2021年<br>7月21<br>日 | 新股锁<br>定 | 13.11 | 24.48  | 322   | 4,221.42 | 7,882.56  | - |
| 300931 | 通用电梯 | 2021年<br>1月13<br>日 | 2021年<br>7月21<br>日 | 新股锁<br>定 | 4.31  | 13.11  | 672   | 2,896.32 | 8,809.92  | - |
| 300933 | 中辰股份 | 2021年<br>1月15<br>日 | 2021年<br>7月22<br>日 | 新股锁<br>定 | 3.37  | 10.44  | 1,112 | 3,747.44 | 11,609.28 | - |
| 300937 | 药易购  | 2021年<br>1月20<br>日 | 2021年<br>7月27<br>日 | 新股锁<br>定 | 12.25 | 53.71  | 244   | 2,989.00 | 13,105.24 | - |
| 300940 | 南极光  | 2021年<br>1月27<br>日 | 2021年<br>8月3<br>日  | 新股锁<br>定 | 12.76 | 43.38  | 307   | 3,917.32 | 13,317.66 | - |
| 300942 | 易瑞生物 | 2021年<br>2月2<br>日  | 2021年<br>8月9<br>日  | 新股锁<br>定 | 5.31  | 28.52  | 443   | 2,352.33 | 12,634.36 | - |
| 300943 | 春晖智控 | 2021年<br>2月3<br>日  | 2021年<br>8月10<br>日 | 新股锁<br>定 | 9.79  | 23.01  | 255   | 2,496.45 | 5,867.55  | - |
| 300945 | 曼卡龙  | 2021年<br>2月3<br>日  | 2021年<br>8月10<br>日 | 新股锁<br>定 | 4.56  | 18.88  | 474   | 2,161.44 | 8,949.12  | - |
| 300948 | 冠中生态 | 2021年<br>2月18<br>日 | 2021年<br>8月25<br>日 | 新股锁<br>定 | 13    | 27.42  | 324   | 2,808.00 | 8,884.08  | - |
| 300950 | 德固特  | 2021年<br>2月24<br>日 | 2021年<br>9月3<br>日  | 新股锁<br>定 | 8.41  | 39.13  | 219   | 1,841.79 | 8,569.47  | - |
| 300952 | 恒辉安防 | 2021年<br>3月3<br>日  | 2021年<br>9月13<br>日 | 新股锁<br>定 | 11.72 | 27.08  | 340   | 3,984.80 | 9,207.20  | - |
| 300953 | 震裕科技 | 2021年<br>3月11<br>日 | 2021年<br>9月22<br>日 | 新股锁<br>定 | 28.77 | 99.85  | 240   | 6,904.80 | 23,964.00 | - |
| 300955 | 嘉亨家化 | 2021年<br>3月16<br>日 | 2021年<br>9月24<br>日 | 新股锁<br>定 | 16.53 | 46.07  | 232   | 3,834.96 | 10,688.24 | - |
| 300956 | 英力股份 | 2021年<br>3月16<br>日 | 2021年<br>9月27<br>日 | 新股锁<br>定 | 12.85 | 25.8   | 371   | 4,767.35 | 9,571.80  | - |
| 300957 | 贝泰妮  | 2021年<br>3月18<br>日 | 2021年<br>9月27<br>日 | 新股锁<br>定 | 47.33 | 251.96 | 179   | 8,472.07 | 45,100.84 | - |

|        |      |                    |                     |          |       |        |     |          |           |  |   |
|--------|------|--------------------|---------------------|----------|-------|--------|-----|----------|-----------|--|---|
|        |      | 日                  | 日                   |          |       |        |     |          |           |  |   |
| 300958 | 建工修复 | 2021年<br>3月18<br>日 | 2021年<br>9月29<br>日  | 新股锁<br>定 | 8.53  | 27.22  | 300 | 2,559.00 | 8,166.00  |  | - |
| 300960 | 通业科技 | 2021年<br>3月22<br>日 | 2021年<br>9月29<br>日  | 新股锁<br>定 | 12.08 | 23.06  | 234 | 2,826.72 | 5,396.04  |  | - |
| 300961 | 深水海纳 | 2021年<br>3月23<br>日 | 2021年<br>9月30<br>日  | 新股锁<br>定 | 8.48  | 22.07  | 394 | 3,341.12 | 8,695.58  |  | - |
| 300962 | 中金辐照 | 2021年<br>3月29<br>日 | 2021年<br>10月<br>11日 | 新股锁<br>定 | 3.4   | 16.37  | 576 | 1,958.40 | 9,429.12  |  | - |
| 300963 | 中洲特材 | 2021年<br>3月30<br>日 | 2021年<br>10月<br>11日 | 新股锁<br>定 | 12.13 | 22.49  | 283 | 3,432.79 | 6,364.67  |  | - |
| 300966 | 共同药业 | 2021年<br>3月31<br>日 | 2021年<br>10月<br>11日 | 新股锁<br>定 | 8.24  | 31.54  | 286 | 2,356.64 | 9,020.44  |  | - |
| 300967 | 晓鸣股份 | 2021年<br>4月2<br>日  | 2021年<br>10月<br>13日 | 新股锁<br>定 | 4.54  | 11.54  | 507 | 2,301.78 | 5,850.78  |  | - |
| 300968 | 格林精密 | 2021年<br>4月6<br>日  | 2021年<br>10月<br>15日 | 新股锁<br>定 | 6.87  | 12.07  | 980 | 6,732.60 | 11,828.60 |  | - |
| 300971 | 博亚精工 | 2021年<br>4月7<br>日  | 2021年<br>10月<br>15日 | 新股锁<br>定 | 18.24 | 28.29  | 245 | 4,468.80 | 6,931.05  |  | - |
| 300972 | 万辰生物 | 2021年<br>4月8<br>日  | 2021年<br>10月<br>19日 | 新股锁<br>定 | 7.19  | 12.65  | 430 | 3,091.70 | 5,439.50  |  | - |
| 300973 | 立高食品 | 2021年<br>4月8<br>日  | 2021年<br>10月<br>15日 | 新股锁<br>定 | 28.28 | 115.71 | 201 | 5,684.28 | 23,257.71 |  | - |
| 300975 | 商络电子 | 2021年<br>4月14<br>日 | 2021年<br>10月<br>21日 | 新股锁<br>定 | 5.48  | 13.03  | 492 | 2,696.16 | 6,410.76  |  | - |
| 300978 | 东箭科技 | 2021年<br>4月15<br>日 | 2021年<br>10月<br>26日 | 新股锁<br>定 | 8.42  | 13.6   | 593 | 4,993.06 | 8,064.80  |  | - |
| 300979 | 华利集团 | 2021年<br>4月15<br>日 | 2021年<br>10月<br>26日 | 新股锁<br>定 | 33.22 | 87.5   | 273 | 9,069.06 | 23,887.50 |  | - |
| 300981 | 中红   | 2021年              | 2021年               | 新股锁      | 48.59 | 90.39  | 168 | 8,163.12 | 15,185.52 |  | - |

|        |      |            |             |      |       |       |     |          |           |   |
|--------|------|------------|-------------|------|-------|-------|-----|----------|-----------|---|
|        | 医疗   | 4月19日      | 10月27日      | 定    |       |       |     |          |           |   |
| 300982 | 苏文电能 | 2021年4月19日 | 2021年10月27日 | 新股锁定 | 15.83 | 45.29 | 317 | 5,018.11 | 14,356.93 | - |
| 300985 | 致远新能 | 2021年4月21日 | 2021年10月29日 | 新股锁定 | 24.9  | 24.81 | 227 | 5,652.30 | 5,631.87  | - |
| 300986 | 志特新材 | 2021年4月21日 | 2021年11月1日  | 新股锁定 | 14.79 | 30.57 | 264 | 3,904.56 | 8,070.48  | - |
| 300987 | 川网传媒 | 2021年4月28日 | 2021年11月11日 | 新股锁定 | 6.79  | 26.81 | 301 | 2,043.79 | 8,069.81  | - |
| 300991 | 创益通  | 2021年5月12日 | 2021年11月22日 | 新股锁定 | 13.06 | 26.51 | 254 | 3,317.24 | 6,733.54  | - |
| 300992 | 泰福泵业 | 2021年5月17日 | 2021年11月25日 | 新股锁定 | 9.36  | 20.32 | 200 | 1,872.00 | 4,064.00  | - |
| 300993 | 玉马遮阳 | 2021年5月17日 | 2021年11月24日 | 新股锁定 | 12.1  | 19.29 | 410 | 4,961.00 | 7,908.90  | - |
| 300995 | 奇德新材 | 2021年5月17日 | 2021年11月26日 | 新股锁定 | 14.72 | 23.32 | 191 | 2,811.52 | 4,454.12  | - |
| 300996 | 普联软件 | 2021年5月26日 | 2021年12月3日  | 新股锁定 | 20.81 | 42.23 | 241 | 5,015.21 | 10,177.43 | - |
| 300997 | 欢乐家  | 2021年5月26日 | 2021年12月2日  | 新股锁定 | 4.94  | 13.05 | 928 | 4,584.32 | 12,110.40 | - |
| 300998 | 宁波方正 | 2021年5月25日 | 2021年12月2日  | 新股锁定 | 6.02  | 21.32 | 201 | 1,210.02 | 4,285.32  | - |
| 301002 | 崧盛股份 | 2021年5月27日 | 2021年12月7日  | 新股锁定 | 18.71 | 57.62 | 201 | 3,760.71 | 11,581.62 | - |
| 301004 | 嘉益股份 | 2021年6月18日 | 2021年12月27日 | 新股锁定 | 7.81  | 21.94 | 312 | 2,436.72 | 6,845.28  | - |
| 301007 | 德迈仕  | 2021年6月4日  | 2021年12月16日 | 新股锁定 | 5.29  | 14.44 | 303 | 1,602.87 | 4,375.32  | - |

|        |      |                |                     |            |       |       |       |           |           |   |
|--------|------|----------------|---------------------|------------|-------|-------|-------|-----------|-----------|---|
| 301010 | 晶雪节能 | 2021年<br>6月9日  | 2021年<br>12月<br>20日 | 新股锁<br>定   | 7.83  | 17.61 | 218   | 1,706.94  | 3,838.98  | - |
| 301011 | 华立科技 | 2021年<br>6月9日  | 2021年<br>12月<br>17日 | 新股锁<br>定   | 14.2  | 33.84 | 175   | 2,485.00  | 5,922.00  | - |
| 301012 | 扬电科技 | 2021年<br>6月15日 | 2021年<br>12月<br>22日 | 新股锁<br>定   | 8.05  | 24.26 | 170   | 1,368.50  | 4,124.20  | - |
| 301015 | 百洋医药 | 2021年<br>6月22日 | 2021年<br>12月<br>30日 | 新股锁<br>定   | 7.64  | 38.83 | 462   | 3,529.68  | 17,939.46 | - |
| 301016 | 雷尔伟  | 2021年<br>6月23日 | 2021年<br>12月<br>30日 | 新股锁<br>定   | 13.75 | 32.98 | 275   | 3,781.25  | 9,069.50  | - |
| 301017 | 漱玉平民 | 2021年<br>6月23日 | 2021年<br>7月5日       | 新股流<br>通受限 | 8.86  | 8.86  | 4,995 | 44,255.70 | 44,255.70 | - |
| 301017 | 漱玉平民 | 2021年<br>6月23日 | 2022年<br>1月5日       | 新股锁<br>定   | 8.86  | 8.86  | 555   | 4,917.30  | 4,917.30  | - |
| 301018 | 申菱环境 | 2021年<br>6月28日 | 2021年<br>7月7日       | 新股流<br>通受限 | 8.29  | 8.29  | 7,029 | 58,270.41 | 58,270.41 | - |
| 301018 | 申菱环境 | 2021年<br>6月28日 | 2022年<br>1月7日       | 新股锁<br>定   | 8.29  | 8.29  | 782   | 6,482.78  | 6,482.78  | - |
| 301021 | 英诺激光 | 2021年<br>6月28日 | 2021年<br>7月6日       | 新股流<br>通受限 | 9.46  | 9.46  | 2,609 | 24,681.14 | 24,681.14 | - |
| 301021 | 英诺激光 | 2021年<br>6月28日 | 2022年<br>1月6日       | 新股锁<br>定   | 9.46  | 9.46  | 290   | 2,743.40  | 2,743.40  | - |
| 605162 | 新中港  | 2021年<br>6月29日 | 2021年<br>7月7日       | 新股流<br>通受限 | 6.07  | 6.07  | 1,377 | 8,358.39  | 8,358.39  | - |
| 605287 | 德才股份 | 2021年<br>6月28日 | 2021年<br>7月6日       | 新股流<br>通受限 | 31.56 | 31.56 | 349   | 11,014.44 | 11,014.44 | - |
| 688087 | 英科再生 | 2021年<br>6月30日 | 2021年<br>7月9日       | 新股流<br>通受限 | 21.96 | 21.96 | 2,246 | 49,322.16 | 49,322.16 | - |
| 688226 | 威腾电气 | 2021年<br>6月28日 | 2021年<br>7月7日       | 新股流<br>通受限 | 6.42  | 6.42  | 2,693 | 17,289.06 | 17,289.06 | - |

|        |      |                     |                     |            |       |        |       |            |            |   |
|--------|------|---------------------|---------------------|------------|-------|--------|-------|------------|------------|---|
|        |      | 日                   | 日                   |            |       |        |       |            |            |   |
| 688239 | 航宇科技 | 2021年<br>6月25<br>日  | 2021年<br>7月5<br>日   | 新股流<br>通受限 | 11.48 | 11.48  | 4,926 | 56,550.48  | 56,550.48  | - |
| 688367 | 工大高科 | 2021年<br>6月21<br>日  | 2021年<br>12月<br>28日 | 新股锁<br>定   | 11.53 | 17.94  | 1,717 | 19,797.01  | 30,802.98  | - |
| 688617 | 惠泰医疗 | 2020年<br>12月30<br>日 | 2021年<br>7月7<br>日   | 新股锁<br>定   | 74.46 | 373.24 | 1,305 | 97,170.30  | 487,078.20 | - |
| 688619 | 罗普特  | 2021年<br>2月8<br>日   | 2021年<br>8月23<br>日  | 新股锁<br>定   | 19.31 | 26.74  | 5,856 | 113,079.36 | 156,589.44 | - |
| 688633 | 星球石墨 | 2021年<br>3月17<br>日  | 2021年<br>9月24<br>日  | 新股锁<br>定   | 33.62 | 53.14  | 1,558 | 52,379.96  | 82,792.12  | - |

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

| 证券代码   | 证券名称 | 成功<br>认购日          | 可流通<br>日           | 流通受<br>限类型 | 认购<br>价格 | 期末估<br>值单价 | 数量<br>(单<br>位：张) | 期末<br>成本总额 | 期末估值总<br>额 | 备注 |
|--------|------|--------------------|--------------------|------------|----------|------------|------------------|------------|------------|----|
| 123117 | 健帆转债 | 2021年<br>6月23<br>日 | 2021年<br>7月12<br>日 | 新债未<br>上市  | 100.00   | 100.00     | 202              | 20,200.00  | 20,200.00  | -  |
| 127038 | 国微转债 | 2021年<br>6月10<br>日 | 2021年<br>7月14<br>日 | 新债未<br>上市  | 100.00   | 100.00     | 408              | 40,800.00  | 40,800.00  | -  |
| 113049 | 长汽转债 | 2021年<br>6月10<br>日 | 2021年<br>7月8<br>日  | 新债未<br>上市  | 100.00   | 100.00     | 140              | 14,000.00  | 14,000.00  | -  |

注：1. 基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

2. 根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起6个月。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无

##### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有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

本基金本报告期末及上年度末未持有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

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末<br>2021年6月30日 | 上年度末<br>2020年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
|        |                   |                     |

|        |           |   |
|--------|-----------|---|
| AAA    | 14,000.00 | - |
| AAA 以下 | 61,000.00 | - |
| 未评级    | -         | - |
| 合计     | 75,000.00 | - |

注：债券信用评级取自第三方评级机构的评级。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有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

本基金本报告期末及上年度末未持有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，本基金所承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（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，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 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。

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、结算备付金及存出保证金等。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>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                | 29,137,066.78 | -    | -    | -               | 29,137,066.78  |
| 结算备付金               | 180,503.14    | -    | -    | -               | 180,503.14     |
| 存出保证金               | 53,159.89     | -    | -    | -               | 53,159.89      |
| 交易性金融资产             | 75,000.00     | -    | -    | -206,756,492.14 | 206,831,492.14 |
| 应收利息                | -             | -    | -    | 2,197.99        | 2,197.99       |
| 应收申购款               | -             | -    | -    | 798.80          | 798.80         |
| 应收证券清算款             | -             | -    | -    | 1,392,344.81    | 1,392,344.81   |
| 资产总计                | 29,445,729.81 | -    | -    | -208,151,833.74 | 237,597,563.55 |
| 负债                  |               |      |      |                 |                |
| 应付赎回款               | -             | -    | -    | 4,487.71        | 4,487.71       |
| 应付管理人报酬             | -             | -    | -    | 271,716.31      | 271,716.31     |
| 应付托管费               | -             | -    | -    | 45,286.04       | 45,286.04      |
| 应付证券清算款             | -             | -    | -    | 2,731,664.37    | 2,731,664.37   |
| 应付交易费用              | -             | -    | -    | 599,803.83      | 599,803.83     |
| 应交税费                | -             | -    | -    | 0.23            | 0.23           |
| 其他负债                | -             | -    | -    | 89,273.11       | 89,273.11      |
| 负债总计                | -             | -    | -    | 3,742,231.60    | 3,742,231.60   |
| 利率敏感度缺口             | 29,445,729.81 | -    | -    | -204,409,602.14 | 233,855,331.95 |
| 上年度末<br>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                | 32,353,999.97 | -    | -    | -               | 32,353,999.97  |
| 结算备付金               | 810,231.01    | -    | -    | -               | 810,231.01     |
| 存出保证金               | 63,726.50     | -    | -    | -               | 63,726.50      |
| 交易性金融资产             | -             | -    | -    | -298,452,447.06 | 298,452,447.06 |
| 应收利息                | -             | -    | -    | 3,792.95        | 3,792.95       |

|         |               |   |   |                 |                |
|---------|---------------|---|---|-----------------|----------------|
| 应收申购款   | -             | - | - | 476.30          | 476.30         |
| 应收证券清算款 | -             | - | - | 1,025,735.82    | 1,025,735.82   |
| 资产总计    | 33,227,957.48 | - | - | -299,482,452.13 | 332,710,409.61 |
| 负债      |               |   |   |                 |                |
| 应付赎回款   | -             | - | - | 5,716.63        | 5,716.63       |
| 应付管理人报酬 | -             | - | - | 393,065.26      | 393,065.26     |
| 应付托管费   | -             | - | - | 65,510.86       | 65,510.86      |
| 应付交易费用  | -             | - | - | 470,995.87      | 470,995.87     |
| 应交税费    | -             | - | - | 0.02            | 0.02           |
| 其他负债    | -             | - | - | 170,012.55      | 170,012.55     |
| 负债总计    | -             | - | - | 1,105,301.19    | 1,105,301.19   |
| 利率敏感度缺口 | 33,227,957.48 | - | - | -298,377,150.94 | 331,605,108.42 |

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，本基金持有交易性债券投资比例较低(上年度末：同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(上年度末：同)。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的证券，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，也可能来源于其他证券市场整体波动的影响。

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

本基金投资于股票的比例为基金资产的 0-95%，其中，投资于第三产业主题相关股票的比例不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；股指期货的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。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<br>2021年6月30日 |               | 上年度末<br>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  | 206,756,492.14    | 88.41         | 298,452,447.06      | 90.00         |
| 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            | 206,756,492.14    | 88.41         | 298,452,447.06      | 90.00         |

#### 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%              | 20,529,417.32     | 24,992,724.15  |
|           | 2. 业绩比较基准下降 5%              | -20,529,417.32    | -24,992,724.15 |

#### 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、应收申购款以及其他金融负债，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 205,122,310.42 元，第二层次的余额为人民币 1,709,181.72 元，无划分为第三层次的余额（于上年度末，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 296,249,977.00 元，属于第二层次的余额为人民币 2,202,470.06 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，本基金本报告期及上年度可比期间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              | 206,756,492.14 | 87.02  |
|   | 其中：股票             | 206,756,492.14 | 87.02  |
| 2 | 基金投资              | -              | -      |
| 3 | 固定收益投资            | 75,000.00      | 0.03   |
|   | 其中：债券             | 75,000.00      | 0.03   |
|   | 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      | 29,317,569.92  | 12.34  |
| 8 | 其他各项资产            | 1,448,501.49   | 0.61   |
| 9 | 合计                | 237,597,563.55 | 100.00 |

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

| 代码 | 行业类别             | 公允价值（元）        | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|----------------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | 648,683.88     | 0.28         |
| B  | 采矿业              | 3,798,881.00   | 1.62         |
| C  | 制造业              | 130,467,821.79 | 55.79        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 2,091,468.39   | 0.89         |
| E  | 建筑业              | 1,451,991.37   | 0.62         |
| F  | 批发和零售业           | 1,735,786.18   | 0.74         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 4,966,676.40   | 2.12         |
| H  | 住宿和餐饮业           | 535,330.00     | 0.23         |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 3,444,831.08   | 1.47         |
| J  | 金融业              | 40,685,983.56  | 17.40        |
| K  | 房地产业             | 3,445,041.00   | 1.47         |
| L  | 租赁和商务服务业         | 4,333,479.00   | 1.85         |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 3,688,007.68   | 1.58         |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 382,578.33     | 0.16         |
| O  | 居民服务、修理和其他服务业    | -              | -            |
| P  | 教育               | -              | -            |
| Q  | 卫生和社会工作          | 4,448,812.48   | 1.90         |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | 631,120.00     | 0.27         |
| S  | 综合               | -              | -            |
|    | 合计               | 206,756,492.14 | 88.41        |

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称  | 数量（股）   | 公允价值（元）      | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|-------|---------|--------------|--------------|
| 1  | 600519 | 贵州茅台  | 4,486   | 9,226,356.20 | 3.95         |
| 2  | 600036 | 招商银行  | 135,100 | 7,321,069.00 | 3.13         |
| 3  | 000739 | 普洛药业  | 211,308 | 6,212,455.20 | 2.66         |
| 4  | 000858 | 五粮液   | 20,400  | 6,076,956.00 | 2.60         |
| 5  | 688016 | 心脉医疗  | 10,900  | 4,955,249.00 | 2.12         |
| 6  | 603738 | 泰晶科技  | 140,000 | 4,832,800.00 | 2.07         |
| 7  | 601318 | 中国平安  | 69,500  | 4,467,460.00 | 1.91         |
| 8  | 600030 | 中信证券  | 155,200 | 3,870,688.00 | 1.66         |
| 9  | 601012 | 隆基股份  | 41,580  | 3,693,967.20 | 1.58         |
| 10 | 603259 | 药明康德  | 23,552  | 3,688,007.68 | 1.58         |
| 11 | 000333 | 美的集团  | 49,300  | 3,518,541.00 | 1.50         |
| 12 | 300059 | 东方财富  | 107,160 | 3,513,776.40 | 1.50         |
| 13 | 601888 | 中国中免  | 10,900  | 3,271,090.00 | 1.40         |
| 14 | 600809 | 山西汾酒  | 7,000   | 3,136,000.00 | 1.34         |
| 15 | 002648 | 卫星石化  | 80,000  | 3,135,200.00 | 1.34         |
| 16 | 601166 | 兴业银行  | 151,700 | 3,117,435.00 | 1.33         |
| 17 | 605300 | 佳禾食品  | 109,936 | 3,056,220.80 | 1.31         |
| 18 | 002415 | 海康威视  | 45,000  | 2,902,500.00 | 1.24         |
| 19 | 000001 | 平安银行  | 124,043 | 2,805,852.66 | 1.20         |
| 20 | 603986 | 兆易创新  | 14,420  | 2,709,518.00 | 1.16         |
| 21 | 002049 | 紫光国微  | 16,500  | 2,544,135.00 | 1.09         |
| 22 | 000725 | 京东方 A | 356,400 | 2,223,936.00 | 0.95         |
| 23 | 601211 | 国泰君安  | 126,900 | 2,175,066.00 | 0.93         |
| 24 | 600309 | 万华化学  | 19,300  | 2,100,226.00 | 0.90         |
| 25 | 600900 | 长江电力  | 100,700 | 2,078,448.00 | 0.89         |
| 26 | 000568 | 泸州老窖  | 8,700   | 2,052,678.00 | 0.88         |
| 27 | 002594 | 比亚迪   | 8,100   | 2,033,100.00 | 0.87         |
| 28 | 603501 | 韦尔股份  | 6,300   | 2,028,600.00 | 0.87         |
| 29 | 300015 | 爱尔眼科  | 27,876  | 1,978,638.48 | 0.85         |
| 30 | 600276 | 恒瑞医药  | 29,071  | 1,975,955.87 | 0.84         |
| 31 | 600031 | 三一重工  | 64,800  | 1,883,736.00 | 0.81         |
| 32 | 002142 | 宁波银行  | 48,300  | 1,882,251.00 | 0.80         |
| 33 | 000776 | 广发证券  | 121,900 | 1,845,566.00 | 0.79         |

|    |        |      |         |              |      |
|----|--------|------|---------|--------------|------|
| 34 | 300274 | 阳光电源 | 15,500  | 1,783,430.00 | 0.76 |
| 35 | 600048 | 保利地产 | 141,400 | 1,702,456.00 | 0.73 |
| 36 | 002241 | 歌尔股份 | 39,700  | 1,696,778.00 | 0.73 |
| 37 | 300124 | 汇川技术 | 22,700  | 1,685,702.00 | 0.72 |
| 38 | 601155 | 新城控股 | 39,900  | 1,659,840.00 | 0.71 |
| 39 | 002139 | 拓邦股份 | 91,600  | 1,647,884.00 | 0.70 |
| 40 | 300122 | 智飞生物 | 8,800   | 1,643,224.00 | 0.70 |
| 41 | 000063 | 中兴通讯 | 49,100  | 1,631,593.00 | 0.70 |
| 42 | 601899 | 紫金矿业 | 167,200 | 1,620,168.00 | 0.69 |
| 43 | 300014 | 亿纬锂能 | 15,490  | 1,609,875.70 | 0.69 |
| 44 | 002821 | 凯莱英  | 4,200   | 1,564,920.00 | 0.67 |
| 45 | 600660 | 福耀玻璃 | 27,100  | 1,513,535.00 | 0.65 |
| 46 | 600690 | 海尔智家 | 58,100  | 1,505,371.00 | 0.64 |
| 47 | 600887 | 伊利股份 | 40,400  | 1,487,932.00 | 0.64 |
| 48 | 600763 | 通策医疗 | 3,600   | 1,479,600.00 | 0.63 |
| 49 | 000661 | 长春高新 | 3,800   | 1,470,600.00 | 0.63 |
| 50 | 601009 | 南京银行 | 138,100 | 1,452,812.00 | 0.62 |
| 51 | 601668 | 中国建筑 | 306,800 | 1,426,620.00 | 0.61 |
| 52 | 300529 | 健帆生物 | 16,300  | 1,407,668.00 | 0.60 |
| 53 | 002129 | 中环股份 | 36,100  | 1,393,460.00 | 0.60 |
| 54 | 002179 | 中航光电 | 17,600  | 1,390,752.00 | 0.59 |
| 55 | 601658 | 邮储银行 | 269,600 | 1,353,392.00 | 0.58 |
| 56 | 002460 | 赣锋锂业 | 11,100  | 1,344,099.00 | 0.57 |
| 57 | 601006 | 大秦铁路 | 203,000 | 1,335,740.00 | 0.57 |
| 58 | 601919 | 中远海控 | 43,600  | 1,331,544.00 | 0.57 |
| 59 | 600436 | 片仔癀  | 2,900   | 1,300,070.00 | 0.56 |
| 60 | 603799 | 华友钴业 | 11,200  | 1,279,040.00 | 0.55 |
| 61 | 603605 | 珀莱雅  | 6,400   | 1,258,944.00 | 0.54 |
| 62 | 002080 | 中材科技 | 47,700  | 1,248,309.00 | 0.53 |
| 63 | 688396 | 华润微  | 13,600  | 1,237,872.00 | 0.53 |
| 64 | 600919 | 江苏银行 | 166,500 | 1,182,150.00 | 0.51 |
| 65 | 601628 | 中国人寿 | 34,800  | 1,179,372.00 | 0.50 |
| 66 | 600779 | 水井坊  | 9,200   | 1,162,420.00 | 0.50 |
| 67 | 000932 | 华菱钢铁 | 174,100 | 1,149,060.00 | 0.49 |
| 68 | 600132 | 重庆啤酒 | 5,700   | 1,128,315.00 | 0.48 |
| 69 | 600999 | 招商证券 | 58,820  | 1,118,756.40 | 0.48 |
| 70 | 300033 | 同花顺  | 9,700   | 1,093,966.00 | 0.47 |
| 71 | 601838 | 成都银行 | 84,800  | 1,071,872.00 | 0.46 |
| 72 | 002230 | 科大讯飞 | 15,800  | 1,067,764.00 | 0.46 |
| 73 | 601633 | 长城汽车 | 24,400  | 1,063,596.00 | 0.45 |
| 74 | 002027 | 分众传媒 | 112,900 | 1,062,389.00 | 0.45 |
| 75 | 002311 | 海大集团 | 12,600  | 1,028,160.00 | 0.44 |

|     |        |        |         |              |      |
|-----|--------|--------|---------|--------------|------|
| 76  | 300724 | 捷佳伟创   | 8,800   | 1,020,888.00 | 0.44 |
| 77  | 603678 | 火炬电子   | 15,100  | 1,019,250.00 | 0.44 |
| 78  | 002410 | 广联达    | 14,900  | 1,016,180.00 | 0.43 |
| 79  | 002677 | 浙江美大   | 55,000  | 1,005,400.00 | 0.43 |
| 80  | 601865 | 福莱特    | 25,200  | 996,156.00   | 0.43 |
| 81  | 603882 | 金域医学   | 6,200   | 990,574.00   | 0.42 |
| 82  | 603659 | 璞泰来    | 7,200   | 983,520.00   | 0.42 |
| 83  | 300595 | 欧普康视   | 9,400   | 973,370.00   | 0.42 |
| 84  | 600104 | 上汽集团   | 43,900  | 964,483.00   | 0.41 |
| 85  | 300782 | 卓胜微    | 1,724   | 926,650.00   | 0.40 |
| 86  | 002563 | 森马服饰   | 77,500  | 926,125.00   | 0.40 |
| 87  | 601377 | 兴业证券   | 95,300  | 920,598.00   | 0.39 |
| 88  | 600884 | 杉杉股份   | 39,400  | 918,808.00   | 0.39 |
| 89  | 002475 | 立讯精密   | 19,900  | 915,400.00   | 0.39 |
| 90  | 002271 | 东方雨虹   | 16,450  | 910,014.00   | 0.39 |
| 91  | 603195 | 公牛集团   | 4,400   | 888,800.00   | 0.38 |
| 92  | 601857 | 中国石油   | 159,500 | 843,755.00   | 0.36 |
| 93  | 601636 | 旗滨集团   | 44,900  | 833,344.00   | 0.36 |
| 94  | 002245 | 蔚蓝锂芯   | 41,600  | 819,520.00   | 0.35 |
| 95  | 300896 | 爱美客    | 987     | 778,624.56   | 0.33 |
| 96  | 001965 | 招商公路   | 104,900 | 757,378.00   | 0.32 |
| 97  | 688169 | 石头科技   | 600     | 756,600.00   | 0.32 |
| 98  | 601225 | 陕西煤业   | 63,700  | 754,845.00   | 0.32 |
| 99  | 601607 | 上海医药   | 34,600  | 731,098.00   | 0.31 |
| 100 | 002833 | 弘亚数控   | 18,660  | 723,075.00   | 0.31 |
| 101 | 002352 | 顺丰控股   | 10,672  | 722,494.40   | 0.31 |
| 102 | 300316 | 晶盛机电   | 13,400  | 676,700.00   | 0.29 |
| 103 | 688111 | 金山办公   | 1,700   | 671,160.00   | 0.29 |
| 104 | 000799 | 酒鬼酒    | 2,600   | 664,560.00   | 0.28 |
| 105 | 000100 | TCL 科技 | 85,400  | 653,310.00   | 0.28 |
| 106 | 002714 | 牧原股份   | 10,480  | 637,393.60   | 0.27 |
| 107 | 300413 | 芒果超媒   | 9,200   | 631,120.00   | 0.27 |
| 108 | 600111 | 北方稀土   | 30,200  | 625,140.00   | 0.27 |
| 109 | 300750 | 宁德时代   | 1,100   | 588,280.00   | 0.25 |
| 110 | 600988 | 赤峰黄金   | 38,700  | 580,113.00   | 0.25 |
| 111 | 603369 | 今世缘    | 10,600  | 574,096.00   | 0.25 |
| 112 | 603233 | 大参林    | 11,160  | 570,387.60   | 0.24 |
| 113 | 600298 | 安琪酵母   | 10,000  | 543,800.00   | 0.23 |
| 114 | 600754 | 锦江酒店   | 9,400   | 535,330.00   | 0.23 |
| 115 | 000338 | 潍柴动力   | 29,100  | 520,017.00   | 0.22 |
| 116 | 000012 | 南玻 A   | 50,600  | 518,144.00   | 0.22 |
| 117 | 688617 | 惠泰医疗   | 1,305   | 487,078.20   | 0.21 |

|     |        |      |        |            |      |
|-----|--------|------|--------|------------|------|
| 118 | 300496 | 中科创达 | 3,100  | 486,886.00 | 0.21 |
| 119 | 002920 | 德赛西威 | 4,100  | 451,328.00 | 0.19 |
| 120 | 300755 | 华致酒行 | 8,300  | 338,723.00 | 0.14 |
| 121 | 002034 | 旺能环境 | 21,200 | 338,140.00 | 0.14 |
| 122 | 002493 | 荣盛石化 | 18,350 | 316,904.50 | 0.14 |
| 123 | 600109 | 国金证券 | 22,000 | 279,180.00 | 0.12 |
| 124 | 600737 | 中粮糖业 | 20,700 | 207,207.00 | 0.09 |
| 125 | 688619 | 罗普特  | 5,856  | 156,589.44 | 0.07 |
| 126 | 600426 | 华鲁恒升 | 5,000  | 154,750.00 | 0.07 |
| 127 | 688698 | 伟创电气 | 4,751  | 94,972.49  | 0.04 |
| 128 | 688633 | 星球石墨 | 1,558  | 82,792.12  | 0.04 |
| 129 | 002968 | 新大正  | 1,900  | 82,745.00  | 0.04 |
| 130 | 301018 | 申菱环境 | 7,811  | 64,753.19  | 0.03 |
| 131 | 300919 | 中伟股份 | 357    | 58,191.00  | 0.02 |
| 132 | 688239 | 航宇科技 | 4,926  | 56,550.48  | 0.02 |
| 133 | 688087 | 英科再生 | 2,246  | 49,322.16  | 0.02 |
| 134 | 301017 | 漱玉平民 | 5,550  | 49,173.00  | 0.02 |
| 135 | 688618 | 三旺通信 | 1,117  | 47,718.24  | 0.02 |
| 136 | 300957 | 贝泰妮  | 179    | 45,100.84  | 0.02 |
| 137 | 300894 | 火星人  | 628    | 42,704.00  | 0.02 |
| 138 | 601528 | 瑞丰银行 | 2,230  | 34,721.10  | 0.01 |
| 139 | 688367 | 工大高科 | 1,717  | 30,802.98  | 0.01 |
| 140 | 301021 | 英诺激光 | 2,899  | 27,424.54  | 0.01 |
| 141 | 300953 | 震裕科技 | 240    | 23,964.00  | 0.01 |
| 142 | 300979 | 华利集团 | 273    | 23,887.50  | 0.01 |
| 143 | 300973 | 立高食品 | 201    | 23,257.71  | 0.01 |
| 144 | 001207 | 联科科技 | 682    | 22,581.02  | 0.01 |
| 145 | 301015 | 百洋医药 | 462    | 17,939.46  | 0.01 |
| 146 | 688226 | 威腾电气 | 2,693  | 17,289.06  | 0.01 |
| 147 | 300925 | 法本信息 | 600    | 15,774.00  | 0.01 |
| 148 | 300981 | 中红医疗 | 168    | 15,185.52  | 0.01 |
| 149 | 300982 | 苏文电能 | 317    | 14,356.93  | 0.01 |
| 150 | 001208 | 华菱线缆 | 1,754  | 13,558.42  | 0.01 |
| 151 | 300940 | 南极光  | 307    | 13,317.66  | 0.01 |
| 152 | 300614 | 百川畅银 | 329    | 13,285.02  | 0.01 |
| 153 | 300937 | 药易购  | 244    | 13,105.24  | 0.01 |
| 154 | 300942 | 易瑞生物 | 443    | 12,634.36  | 0.01 |
| 155 | 603171 | 税友股份 | 637    | 12,230.40  | 0.01 |
| 156 | 300997 | 欢乐家  | 928    | 12,110.40  | 0.01 |
| 157 | 300968 | 格林精密 | 980    | 11,828.60  | 0.01 |
| 158 | 300933 | 中辰股份 | 1,112  | 11,609.28  | 0.00 |
| 159 | 301002 | 崧盛股份 | 201    | 11,581.62  | 0.00 |

|     |        |      |       |           |      |
|-----|--------|------|-------|-----------|------|
| 160 | 605287 | 德才股份 | 349   | 11,014.44 | 0.00 |
| 161 | 300955 | 嘉亨家化 | 232   | 10,688.24 | 0.00 |
| 162 | 300996 | 普联软件 | 241   | 10,177.43 | 0.00 |
| 163 | 300956 | 英力股份 | 371   | 9,571.80  | 0.00 |
| 164 | 300962 | 中金辐照 | 576   | 9,429.12  | 0.00 |
| 165 | 300952 | 恒辉安防 | 340   | 9,207.20  | 0.00 |
| 166 | 301016 | 雷尔伟  | 275   | 9,069.50  | 0.00 |
| 167 | 300966 | 共同药业 | 286   | 9,020.44  | 0.00 |
| 168 | 300945 | 曼卡龙  | 474   | 8,949.12  | 0.00 |
| 169 | 300948 | 冠中生态 | 324   | 8,884.08  | 0.00 |
| 170 | 300931 | 通用电梯 | 672   | 8,809.92  | 0.00 |
| 171 | 300961 | 深水海纳 | 394   | 8,695.58  | 0.00 |
| 172 | 300950 | 德固特  | 219   | 8,569.47  | 0.00 |
| 173 | 605162 | 新中港  | 1,377 | 8,358.39  | 0.00 |
| 174 | 300958 | 建工修复 | 300   | 8,166.00  | 0.00 |
| 175 | 300986 | 志特新材 | 264   | 8,070.48  | 0.00 |
| 176 | 300987 | 川网传媒 | 301   | 8,069.81  | 0.00 |
| 177 | 300978 | 东箭科技 | 593   | 8,064.80  | 0.00 |
| 178 | 300926 | 博俊科技 | 359   | 7,969.80  | 0.00 |
| 179 | 300993 | 玉马遮阳 | 410   | 7,908.90  | 0.00 |
| 180 | 300930 | 屹通新材 | 322   | 7,882.56  | 0.00 |
| 181 | 300971 | 博亚精工 | 245   | 6,931.05  | 0.00 |
| 182 | 301004 | 嘉益股份 | 312   | 6,845.28  | 0.00 |
| 183 | 300991 | 创益通  | 254   | 6,733.54  | 0.00 |
| 184 | 300927 | 江天化学 | 217   | 6,531.70  | 0.00 |
| 185 | 688036 | 传音控股 | 31    | 6,494.50  | 0.00 |
| 186 | 300975 | 商络电子 | 492   | 6,410.76  | 0.00 |
| 187 | 300963 | 中洲特材 | 283   | 6,364.67  | 0.00 |
| 188 | 301011 | 华立科技 | 175   | 5,922.00  | 0.00 |
| 189 | 300943 | 春晖智控 | 255   | 5,867.55  | 0.00 |
| 190 | 300967 | 晓鸣股份 | 507   | 5,850.78  | 0.00 |
| 191 | 300985 | 致远新能 | 227   | 5,631.87  | 0.00 |
| 192 | 300972 | 万辰生物 | 430   | 5,439.50  | 0.00 |
| 193 | 300929 | 华骐环保 | 183   | 5,407.65  | 0.00 |
| 194 | 300960 | 通业科技 | 234   | 5,396.04  | 0.00 |
| 195 | 605011 | 杭州热电 | 525   | 4,662.00  | 0.00 |
| 196 | 300995 | 奇德新材 | 191   | 4,454.12  | 0.00 |
| 197 | 301007 | 德迈仕  | 303   | 4,375.32  | 0.00 |
| 198 | 300998 | 宁波方正 | 201   | 4,285.32  | 0.00 |
| 199 | 301012 | 扬电科技 | 170   | 4,124.20  | 0.00 |
| 200 | 300992 | 泰福泵业 | 200   | 4,064.00  | 0.00 |
| 201 | 301010 | 晶雪节能 | 218   | 3,838.98  | 0.00 |

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称  | 本期累计买入金额      | 占期初基金资产净值比例(%) |
|----|--------|-------|---------------|----------------|
| 1  | 601318 | 中国平安  | 12,207,680.00 | 3.68           |
| 2  | 300685 | 艾德生物  | 6,839,873.50  | 2.06           |
| 3  | 000002 | 万科 A  | 6,209,322.00  | 1.87           |
| 4  | 600048 | 保利地产  | 5,715,732.00  | 1.72           |
| 5  | 300015 | 爱尔眼科  | 5,681,185.00  | 1.71           |
| 6  | 000725 | 京东方 A | 5,592,196.00  | 1.69           |
| 7  | 000739 | 普洛药业  | 5,431,421.03  | 1.64           |
| 8  | 300003 | 乐普医疗  | 4,879,142.00  | 1.47           |
| 9  | 600000 | 浦发银行  | 4,823,674.00  | 1.45           |
| 10 | 601211 | 国泰君安  | 4,598,185.00  | 1.39           |
| 11 | 601328 | 交通银行  | 4,524,341.00  | 1.36           |
| 12 | 688016 | 心脉医疗  | 4,453,757.66  | 1.34           |
| 13 | 601633 | 长城汽车  | 4,156,123.00  | 1.25           |
| 14 | 600436 | 片仔癀   | 4,080,232.00  | 1.23           |
| 15 | 300088 | 长信科技  | 4,070,008.00  | 1.23           |
| 16 | 603738 | 泰晶科技  | 4,017,816.15  | 1.21           |
| 17 | 600276 | 恒瑞医药  | 3,981,799.00  | 1.20           |
| 18 | 600536 | 中国软件  | 3,755,675.41  | 1.13           |
| 19 | 300274 | 阳光电源  | 3,748,430.00  | 1.13           |
| 20 | 600988 | 赤峰黄金  | 3,706,876.00  | 1.12           |

注：买入金额不包括相关交易费用。

### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 本期累计卖出金额      | 占期初基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|---------------|----------------|
| 1  | 601318 | 中国平安 | 16,771,261.20 | 5.06           |
| 2  | 300014 | 亿纬锂能 | 14,281,736.61 | 4.31           |
| 3  | 600519 | 贵州茅台 | 13,617,494.00 | 4.11           |
| 4  | 000858 | 五粮液  | 10,956,076.24 | 3.30           |
| 5  | 600036 | 招商银行 | 9,775,826.00  | 2.95           |
| 6  | 601166 | 兴业银行 | 9,511,931.00  | 2.87           |
| 7  | 000002 | 万科 A | 8,497,958.39  | 2.56           |
| 8  | 300685 | 艾德生物 | 7,788,194.00  | 2.35           |
| 9  | 601012 | 隆基股份 | 7,287,711.00  | 2.20           |
| 10 | 000333 | 美的集团 | 7,240,959.00  | 2.18           |
| 11 | 002352 | 顺丰控股 | 7,004,639.25  | 2.11           |

|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 12 | 300059 | 东方财富 | 6,543,288.80 | 1.97 |
| 13 | 000001 | 平安银行 | 6,385,292.00 | 1.93 |
| 14 | 600276 | 恒瑞医药 | 6,144,836.06 | 1.85 |
| 15 | 002475 | 立讯精密 | 6,089,109.83 | 1.84 |
| 16 | 600030 | 中信证券 | 5,911,372.00 | 1.78 |
| 17 | 603259 | 药明康德 | 5,891,597.60 | 1.78 |
| 18 | 000661 | 长春高新 | 5,874,357.00 | 1.77 |
| 19 | 000651 | 格力电器 | 5,602,862.00 | 1.69 |
| 20 | 600048 | 保利地产 | 5,571,293.50 | 1.68 |

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 | 344,869,158.88 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 460,715,198.79 |

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种      | 公允价值      | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|-----------|--------------|
| 1  | 国家债券      | -         | -            |
| 2  | 央行票据      | -         | -            |
| 3  | 金融债券      | -         | -            |
|    | 其中：政策性金融债 | -         | -            |
| 4  | 企业债券      | -         | -            |
| 5  | 企业短期融资券   | -         | -            |
| 6  | 中期票据      | -         | -            |
| 7  | 可转债（可交换债） | 75,000.00 | 0.03         |
| 8  | 同业存单      | -         | -            |
| 9  | 其他        | -         | -            |
| 10 | 合计        | 75,000.00 | 0.03         |

### 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

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码   | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值      | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|-------|-----------|--------------|
| 1  | 127038 | 国微转债 | 408   | 40,800.00 | 0.02         |
| 2  | 123117 | 健帆转债 | 202   | 20,200.00 | 0.01         |
| 3  | 113049 | 长汽转债 | 140   | 14,000.00 | 0.01         |

## 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

第三产业基金截至 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、通过关联机构引入非合格投资者，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。

本基金管理人通过对上述上市公司进行进一步了解和析，认为上述处分不会对公司的投资价值构成实质性影响，因此本基金管理人对上述证券的投资判断未发生改变。报告期内，本基金投资的前十名证券的其余九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   | 53,159.89    |
| 2  | 应收证券清算款 | 1,392,344.81 |

|   |       |              |
|---|-------|--------------|
| 3 | 应收股利  | -            |
| 4 | 应收利息  | 2,197.99     |
| 5 | 应收申购款 | 798.80       |
| 6 | 其他应收款 | -            |
| 7 | 待摊费用  | -            |
| 8 | 其他    | -            |
| 9 | 合计    | 1,448,501.49 |

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

#### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，合计数可能不等于分项之和。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数<br>(户) | 户均持有的<br>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<br>(%) | 持有份额       | 占总份额比例<br>(%) |
| 636          | 258,067.66    | 163,622,743.14 | 99.69         | 508,289.05 | 0.31          |

### 8.2 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 | 61,196.75  | 0.0373       |

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

| 项目                             | 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 | 0~10               |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 0~10               |

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

|                                    |                |
|------------------------------------|----------------|
| 基金合同生效日（2017 年 5 月 25 日）<br>基金份额总额 | 200,089,305.26 |
| 本报告期期初基金份额总额                       | 246,592,425.32 |
| 本报告期基金总申购份额                        | 75,149,466.03  |
| 减：本报告期基金总赎回份额                      | 157,610,859.16 |
| 本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）           | -              |
| 本报告期期末基金份额总额                       | 164,131,032.19 |

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

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

中国工商银行股份有限公司根据工作需要，任命刘彤女士担任本公司资产托管部总经理，全面主持资产托管部相关工作。刘彤女士的托管人高级管理人员任职信息已经在中国证券投资基金业协会备案。李勇先生不再担任本公司资产托管部总经理职务。

### 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：2019 年 11 月 20 日起至本报告期末。

## 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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 |    |
| 中信证券     | 2      | 173,221,186.54 | 21.69%       | 157,856.20 | 21.43%     | -  |
| 东吴证券     | 2      | 165,786,756.61 | 20.76%       | 154,290.49 | 20.95%     | -  |
| 华创证券     | 1      | 158,071,051.59 | 19.79%       | 144,050.45 | 19.56%     | -  |
| 中泰证券     | 2      | 131,868,149.46 | 16.51%       | 122,730.54 | 16.66%     | -  |
| 东方财富     | 2      | 92,186,657.33  | 11.54%       | 85,852.92  | 11.65%     | -  |
| 华西证券     | 2      | 52,755,057.24  | 6.60%        | 48,929.20  | 6.64%      | -  |
| 广发证券     | 2      | 16,724,743.46  | 2.09%        | 15,349.08  | 2.08%      | -  |
| 申万宏源     | 1      | 6,962,934.50   | 0.87%        | 6,484.53   | 0.88%      | -  |
| 野村东方国际证券 | 2      | 1,156,447.39   | 0.14%        | 1,076.99   | 0.15%      | -  |
| 东方证券     | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 国金证券     | 2      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 国盛证券     | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 国泰君安     | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 海通证券     | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 天风证券     | 2      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 招商证券     | 2      | -              | -            | -          | -          | -  |

注：基金管理人选择交易单元的标准和程序如下：

(1) 选择标准： 资力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 5 亿元人民币；财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；经营行为规范，最近两年未因重大违规行为受到中国证监会和中

国人民银行处罚；内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；具备基金运作所需要的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需  
要，并能为本基金提供全面的信息服务；研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，  
能及时为本基金提供高质量的咨询服务，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告；适  
当地域分散化。

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

2. 本基金本报告期券商交易单元无新增。

### 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 |
| 中信证券     | -         | -            | -             | -              | -    | -            |
| 东吴证券     | -         | -            | -             | -              | -    | -            |
| 华创证券     | -         | -            | -             | -              | -    | -            |
| 中泰证券     | -         | -            | 20,000,000.00 | 100.00%        | -    | -            |
| 东方财富     | 14,000.00 | 18.67%       | -             | -              | -    | -            |
| 华西证券     | -         | -            | -             | -              | -    | -            |
| 申万宏源     | 61,000.00 | 81.33%       | -             | -              | -    | -            |
| 广发证券     | -         | -            | -             | -              | -    | -            |
| 野村东方国际证券 | -         | -            | -             | -              | -    | -            |
| 东方证券     | -         | -            | -             | -              | -    | -            |
| 国金证券     | -         | -            | -             | -              | -    | -            |
| 国盛证券     | -         | -            | -             | -              | -    | -            |
| 国泰君安     | -         | -            | -             | -              | -    | -            |
| 海通证券     | -         | -            | -             | -              | -    | -            |
| 天风证券     | -         | -            | -             | -              | -    | -            |
| 招商证券     | -         | -            | -             | -              | -    | -            |

### 10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项 | 法定披露方式 | 法定披露日期 |
|----|------|--------|--------|
|----|------|--------|--------|

|    |  |                                   |           |
|----|--|-----------------------------------|-----------|
| 1  | 华宝基金管理有限公司华宝第三产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告                | 基金管理人网站, 中国证券报                    | 2021-1-4  |
| 2  | 华宝第三产业灵活配置混合型证券投资基金招募说明书(更新)                         | 基金管理人网站                           | 2021-1-6  |
| 3  | 华宝第三产业灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要(更新)                      | 基金管理人网站                           | 2021-1-6  |
| 4  | 华宝第三产业灵活配置混合型证券投资基金 2020 年第 4 季度报告                   | 基金管理人网站                           | 2021-1-22 |
| 5  | 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                      | 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 | 2021-2-19 |
| 6  | 华宝现金添益交易型货币市场基金 B 类基金份额开放转换业务的公告                     | 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 | 2021-2-26 |
| 7  | 华宝基金管理有限公司关于提示投资者完善身份信息是的公告                          | 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 | 2021-3-9  |
| 8  | 华宝基金管理有限公司华宝第三产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告                | 基金管理人网站, 中国证券报                    | 2021-3-16 |
| 9  | 华宝第三产业灵活配置混合型证券投资基金招募说明书(更新)                         | 基金管理人网站                           | 2021-3-17 |
| 10 | 华宝第三产业灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要(更新)                      | 基金管理人网站                           | 2021-3-17 |
| 11 | 华宝第三产业灵活配置混合型证券投资基金 2020 年年度报告                       | 基金管理人网站                           | 2021-3-31 |
| 12 | 华宝第三产业灵活配置混合型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告                   | 基金管理人网站                           | 2021-4-22 |
| 13 | 华宝新优选一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金开放日常申购、赎回及转换业务的公告            | 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 | 2021-5-18 |
| 14 | 华宝资源优选混合型证券投资基金 C 类基金份额开放转换业务及开通定期定额投资业务的公告          | 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 | 2021-5-18 |
| 15 | 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                            | 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 | 2021-6-22 |
| 16 | 华宝基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加鼎信汇金(北京)投资管理有限公司为代销机构及费率优惠的公告 | 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 | 2021-6-23 |
| 17 | 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                     | 基金管理人网站, 上海证券报, 证券日报, 证券          | 2021-6-30 |

|    |   |                |           |
|----|---|----------------|-----------|
|    | 活动的公告   | 时报, 中国证券报      |           |
| 18 | 华宝第三产业灵活配置混合型证券投资基金招募说明书(更新)                      | 基金管理人网站        | 2021-6-30 |
| 19 | 华宝第三产业灵活配置混合型证券投资基金基金(A类份额)产品资料概要(更新)             | 基金管理人网站        | 2021-6-30 |
| 20 | 华宝第三产业灵活配置混合型证券投资基金托管协议(更新)                       | 基金管理人网站        | 2021-6-30 |
| 21 | 华宝第三产业灵活配置混合型证券投资基金基金合同(更新)                       | 基金管理人网站        | 2021-6-30 |
| 22 | 华宝基金管理有限公司关于华宝第三产业灵活配置混合型证券投资基金增加C类基金份额并修改基金合同的公告 | 基金管理人网站, 中国证券报 | 2021-6-30 |

## § 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              | 20210101~20210630       | 50,008,000.00 | 0.00 | 0.00          | 50,008,000.00 | 30.47    |
|        | 2              | 20210112~20210606       | 46,600,000.00 | 0.00 | 21,747,316.00 | 24,852,684.00 | 15.14    |
| 产品特有风险 |                |                         |               |      |               |               |          |

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

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

基金管理人于 2021 年 6 月 30 日发布《华宝基金管理有限公司关于华宝第三产业灵活配置混合型证券投资基金增加 C 类基金份额并修改基金合同的公告》,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；  
华宝第三产业灵活配置混合型证券投资基金基金合同；  
华宝第三产业灵活配置混合型证券投资基金招募说明书；  
华宝第三产业灵活配置混合型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