

华宝宝利纯债 86 个月定期开放债券型证券 投资基金 2021 年中期报告

2021 年 6 月 30 日

基金管理人：华宝基金管理有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

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。

基金托管人兴业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。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

| | |
|---|-----------|
| § 1 重要提示及目录 | 2 |
| 1.1 重要提示 | 2 |
| 1.2 目录 | 3 |
| § 2 基金简介 | 5 |
| 2.1 基金基本情况 | 5 |
| 2.2 基金产品说明 | 5 |
| 2.3 基金管理人和基金托管人 | 5 |
| 2.4 信息披露方式 | 6 |
| 2.5 其他相关资料 | 6 |
| § 3 主要财务指标和基金净值表现 | 6 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标 | 6 |
| 3.2 基金净值表现 | 7 |
| 3.3 其他指标 | 8 |
| § 4 管理人报告 | 8 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况 | 8 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 | 10 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 | 10 |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 | 10 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 | 11 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 | 12 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 | 12 |
| 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 | 12 |
| § 5 托管人报告 | 13 |
| 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 | 13 |
| § 6 半年度财务会计报告（未经审计） | 13 |
| 6.1 资产负债表 | 13 |
| 6.2 利润表 | 14 |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表 | 15 |
| 6.4 报表附注 | 16 |
| § 7 投资组合报告 | 34 |
| 7.1 期末基金资产组合情况 | 34 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 | 35 |
| 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 | 35 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 | 35 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 | 35 |

| | |
|---|-----------|
| 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 | 36 |
| 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 | 36 |
| 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 | 36 |
| 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 | 36 |
| 7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 | 36 |
| 7.11 投资组合报告附注 | 36 |
| § 8 基金份额持有人信息 | 37 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 | 37 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 | 37 |
| 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 | 37 |
| § 9 开放式基金份额变动 | 38 |
| § 10 重大事件揭示 | 38 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 | 38 |
| 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 | 38 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 | 38 |
| 10.4 基金投资策略的改变 | 38 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 | 38 |
| 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 | 38 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 | 39 |
| 10.8 其他重大事件 | 40 |
| § 11 影响投资者决策的其他重要信息 | 40 |
| 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 | 40 |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 | 41 |
| § 12 备查文件目录 | 41 |
| 12.1 备查文件目录 | 41 |
| 12.2 存放地点 | 41 |
| 12.3 查阅方式 | 41 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|------------|---------------------------|
| 基金名称 | 华宝宝利纯债 86 个月定期开放债券型证券投资基金 |
| 基金简称 | 华宝宝利债券 |
| 基金主代码 | 009756 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2020 年 7 月 9 日 |
| 基金管理人 | 华宝基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 兴业银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 7,999,012,617.53 份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|---|
| 投资目标 | 本基金采取严格的买入持有到期投资策略，投资于剩余期限（或回售期限）不超过基金剩余封闭期的固定收益类工具，力求为投资者获取稳健的收益。 |
| 投资策略 | 本基金以封闭期为周期进行投资运作。本基金在封闭期与开放期采取不同的投资策略。在封闭期内，本基金采用买入并持有策略构建投资组合，对所投资固定收益品种的剩余期限与基金的剩余封闭期进行期限匹配，投资于剩余期限（或回售期限）不超过基金剩余封闭期的固定收益类工具。开放期内，本基金为保持较高的组合流动性，方便投资人安排投资，在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下，将主要投资于高流动性的投资品种，防范流动性风险，满足开放期流动性的需求。 |
| 业绩比较基准 | 中债综合全价指数收益率 |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金，但低于混合型基金、股票型基金。 |

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 | 兴业银行股份有限公司 |
| 信息披露 负责人 | 姓名 | 周雷 | 龚小武 |
| | 联系电话 | 021-38505888 | 021-52629999-212056 |
| | 电子邮箱 | xxpl@fsfund.com | gongxiaowu@cib.com.cn |
| 客户服务电话 | | 400-700-5588、400-820-5050、 021-38924558 | 95561 |
| 传真 | | 021-38505777 | 021-62159217 |
| 注册地址 | | 中国（上海）自由贸易试验区世 纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼 | 福州市湖东路 154 号 |
| 办公地址 | | 中国（上海）自由贸易试验区世 纪大道 100 号上海环球金融中心 | 上海市银城路 167 号兴业大厦 4 楼 |

| | | |
|-------|--------------------|--------|
| | 58 楼 | |
| 邮政编码 | 200120 | 200120 |
| 法定代表人 | XIAOYI HELEN HUANG | 吕家进 |

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

| 项目 | 名称 | 办公地址 |
|--------|-------|--------------------------------------|
| 注册登记机构 | 基金管理人 | 中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼 |

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2021 年 1 月 1 日-2021 年 6 月 30 日) |
|---------------|-------------------------------------|
| 本期已实现收益 | 156,140,301.80 |
| 本期利润 | 156,140,301.80 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0195 |
| 本期加权平均净值利润率 | 1.94% |
| 本期基金份额净值增长率 | 1.95% |
| 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 | 108,945,524.13 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0136 |
| 期末基金资产净值 | 8,107,958,141.66 |
| 期末基金份额净值 | 1.0136 |
| 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 | 3.70% |

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

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。由于本基金采用摊余成本法核算，所以，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3、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。

4、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）。

5、本基金本报告期内未计提减值准备。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

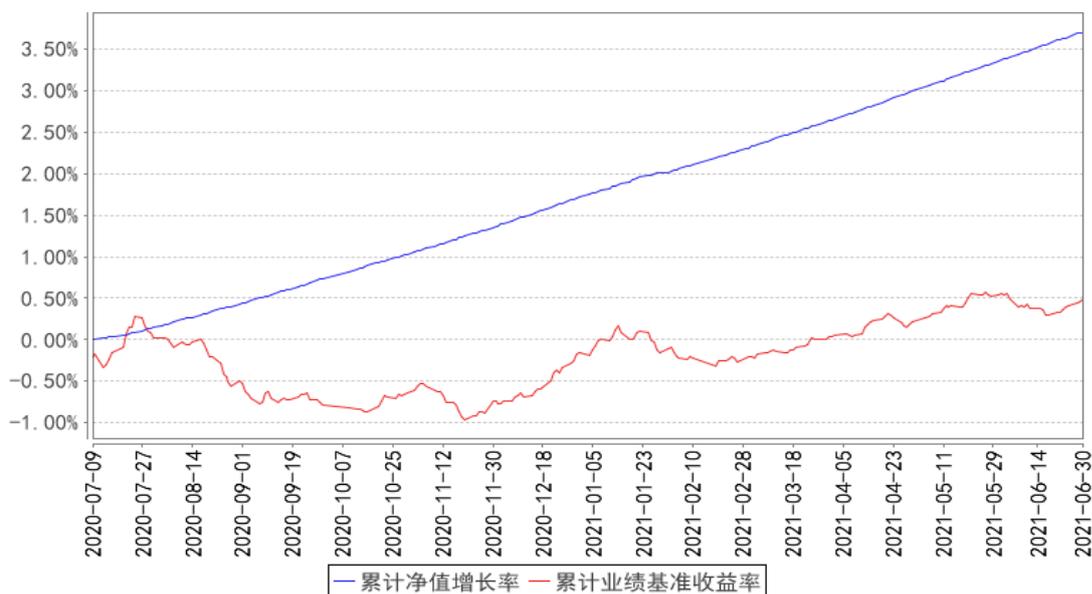
| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|-------|--------|
| 过去一个月 | 0.33% | 0.01% | -0.04% | 0.03% | 0.37% | -0.02% |
| 过去三个月 | 1.04% | 0.01% | 0.45% | 0.03% | 0.59% | -0.02% |
| 过去六个月 | 1.95% | 0.01% | 0.65% | 0.04% | 1.30% | -0.03% |
| 过去一年 | -% | -% | -% | -% | -% | -% |
| 过去三年 | -% | -% | -% | -% | -% | -% |
| 自基金合同生效起至今 | 3.70% | 0.01% | 0.49% | 0.05% | 3.21% | -0.04% |

注：1、本基金业绩比较基准为：中债综合全价值数收益率。

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

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

华宝宝利债券累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同生效于 2020 年 7 月 9 日，截止报告日本基金基金合同生效未满一年。

2、按照基金合同的约定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定，截至 2021 年 1 月 9 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 | | |
| 林昊 | 本基金基金经理 | 2020 年 7 月 9 日 | - | 14 年 | 学士。2006 年 5 月加入华宝基金管理有限公司，先后担任渠道经理、交易员、高级交易员、基金经理助理等职务。2017 年 3 月起任华宝新价值灵活配置混合型证券投资基金、华宝新机遇灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)、华宝新活力灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2017 年 12 月至 2018 年 6 月任华宝新动力一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2017 年 12 月至 2018 年 7 月任华宝新回报一年定期开放混合型证券投资基金基金经理。2017 年 12 月至 2018 年 12 月任华宝新优选一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2018 年 8 月至 2021 年 3 月任华宝宝丰高等级债券型发起式证券投资基金基金经理。2019 年 11 月起任华宝宝惠纯债 39 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理。2020 年 7 月起 |

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|---|
| | | | | | 任华宝宝利纯债 86 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理。2020 年 9 月起任华宝中债 1-3 年国开行债券指数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。 |
|--|--|--|--|--|---|

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、《华宝宝利纯债 86 个月定期开放债券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，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、《华宝宝利纯债 86 个月定期开放债券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。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

本报告期内，本基金未发现异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2021 年上半年债券市场收益率总体呈现先上行后下行的震荡格局。一季度，国内宏观经济持续修复、大宗商品价格维持在高位，以及海外通胀预期抬升等因素促使长端利率小幅上行，但二季度起，随着经济复苏动能边际减弱，债券各期限收益率出现不同程度的下行。具体来看，二季度制造业 PMI 小幅回落至 51.0%，较一季度下降 0.3 个百分点；受环保限产供给约束和外需走弱影响，国内工业生产进一步放缓，6 月工业增加值同比增长 8.3%，两年复合增长 6.5%；1-6 月固

定资产投资累计同比 12.6%，两年复合增长上升 0.5 个百分点至 4.4%，其中：地产投资同比 15.0%，仍显现出较强的韧性，但在政策调控趋严、销售放缓的背景下，后续将难以维持高增速，基建投资同比 7.8%，两年平均增长 2.4%，后续地方债发行提速有望给予基建一定支撑，制造业投资同比 19.2%，在上游成本抬升，下游需求不足的挤压下，制造业改善空间有限。消费端逐步改善，上半年社会消费品零售总额 21.2 万亿元，同比增长 23%，两年平均增长 4.4%，必选消费和地产后周期消费增速上行，但汽车、通讯等消费降幅较大，后续随着疫苗接种率的提高，消费将逐步复苏。外贸方面，受全球经济修复带来需求增长，以及境外疫情反复产生的订单转移效应影响，上半年出口实现了 38.6% 的较大增长，进口同比增长 36.0%，贸易顺差累计 2515.2 亿美元。通胀数据方面，6 月 CPI 同比 1.1%，主要受食品分项猪价的负向拉动，食品价格由 5 月上涨 0.3% 转为下降 1.7%，影响 CPI 下降约 0.31 个百分点；6 月 PPI 环比和同比涨幅均有回落，同比增速下降至 8.8%，主要受原材料保供稳价政策影响，钢材、有色金属等行业价格过快上涨势头得到初步遏制，价格由涨转降。金融数据方面，6 月 M2 同比 8.6%，社会融资规模存量同比持平于上月的 11.0%，已回到疫情前 2019 年的水平。债券收益率曲线先走平后走陡，但整体变动幅度不大，1 年期国债和国开债收益率分别下行 4.4BP 和 4.3BP，10 年期国债和国开债收益率分别下行 6.5BP 和 4.6BP。

华宝宝利基金在上半年维持了较高的债券投资比例，仍然以开放期内到期的政策性金融债作为配置方向，总体净值增长稳定。本基金将继续保持较高的债券投资比例，并且密切关注未来市场利率走势的变化。

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 1.95%，业绩比较基准收益率为 0.65%。

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，海外疫情的持续变化仍是压制全球总需求回升的主要掣肘，而美国宽松政策的边际效用亦在衰退，因此外需对我国出口的拉动将持续减弱。内需恢复的力度存在较大不确定性：消费的恢复进度仍然较慢，主要是居民可支配收入的增速放缓，消费意愿不强烈；投资端，地产投资继续受严监管而边际回落，基建投资整体增速较慢、后续地方债发行加快对基建拉动有限，制造业投资温和修复、但依然受到原材料价格偏高的成本端压力。通胀水平总体缓和，国内控价与海外需求下降将进一步缓和大宗商品价格的涨价压力，从而引导国内 PPI 下行，而 CPI 在猪价的负向拉动下亦相对温和。货币政策大概率继续维持稳健中性，但 MLF 的大量到期可能对短期资金面造成扰动，下半年资金利率中枢料将有所回升。债市在经济边际回落与通胀预期压力缓解的背景下，收益率将进一步震荡下行，10 年期国债收益率将围绕 3.0% 小幅波动。信用紧缩背景下，仍需关注信用债违约的尾部风险。

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

根据法律法规及基金合同的规定，本基金于2021年3月11日发布了分红公告，本次分红为2021年度的第1次分红。本基金向2021年03月15日在本基金注册登记机构登记在册的基金份额持有人按每10份基金份额派发红利0.11元，利润分配合计为人民币87,989,138.23元，其中现金形式发放总额为人民币87,989,099.00元，再投资形式发放总额为人民币39.23元。

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

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

该基金本报告期内进行了一次利润分配，分配金额为 87,989,138.23 元。

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

本托管人认真复核了本中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华宝宝利纯债 86 个月定期开放债券型证券投资基金

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 2021 年 6 月 30 日 | 上年度末 2020 年 12 月 31 日 |
|------------|---------|------------------------|--------------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 61,205.02 | 614,071.16 |
| 结算备付金 | | 67,095,563.60 | 42,215,253.18 |
| 存出保证金 | | 153,874.15 | 167,883.55 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | - | - |
| 其中：股票投资 | | - | - |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | - | - |
| 资产支持证券投资 | | - | - |

| | | | |
|-----------------|------------|---------------------------|-----------------------------|
| 贵金属投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | 6.4.7.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 6.4.7.4 | - | - |
| 应收证券清算款 | | 125,048.54 | - |
| 应收利息 | 6.4.7.5 | 361,807,597.49 | 196,062,852.45 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | - | - |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.6 | 13,841,975,626.38 | 12,111,949,553.63 |
| 资产总计 | | 14,271,218,915.18 | 12,351,009,613.97 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2021年6月30日 | 上年度末 2020年12月31日 |
| 负债: | | | |
| 短期借款 | | - | - |
| 交易性金融负债 | | - | - |
| 衍生金融负债 | 6.4.7.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | 6,160,721,110.11 | 4,308,624,136.20 |
| 应付证券清算款 | | - | 78,098.74 |
| 应付赎回款 | | - | - |
| 应付管理人报酬 | | 997,928.59 | 1,022,733.48 |
| 应付托管费 | | 332,642.87 | 340,911.17 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付交易费用 | 6.4.7.7 | 124,907.40 | 121,364.67 |
| 应交税费 | | - | - |
| 应付利息 | | 970,129.21 | 855,430.85 |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.8 | 114,055.34 | 160,000.00 |
| 负债合计 | | 6,163,260,773.52 | 4,311,202,675.11 |
| 所有者权益: | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.9 | 7,999,012,617.53 | 7,999,012,580.32 |
| 未分配利润 | 6.4.7.10 | 108,945,524.13 | 40,794,358.54 |
| 所有者权益合计 | | 8,107,958,141.66 | 8,039,806,938.86 |
| 负债和所有者权益总计 | | 14,271,218,915.18 | 12,351,009,613.97 |

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.0136 元，基金份额总额 7,999,012,617.53 份。

6.2 利润表

会计主体：华宝宝利纯债 86 个月定期开放债券型证券投资基金

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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
|------------------------|------------|---------------------------------------|
| 一、收入 | | 225,198,332.80 |
| 1. 利息收入 | | 225,198,332.80 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.11 | 361,419.28 |
| 债券利息收入 | | 224,805,388.25 |
| 资产支持证券利息收入 | | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 31,525.27 |
| 证券出借利息收入 | | - |
| 其他利息收入 | | - |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） | | - |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.12 | - |
| 基金投资收益 | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.13 | - |
| 资产支持证券投资收益 | 6.4.7.13.5 | - |
| 贵金属投资收益 | 6.4.7.14 | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.15 | - |
| 股利收益 | 6.4.7.16 | - |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.17 | - |
| 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 | - |
| 减：二、费用 | | 69,058,031.00 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 5,997,435.29 |
| 2. 托管费 | 6.4.10.2.2 | 1,999,145.08 |
| 3. 销售服务费 | 6.4.10.2.3 | - |
| 4. 交易费用 | 6.4.7.19 | 64.95 |
| 5. 利息支出 | | 60,904,700.34 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 60,904,700.34 |
| 6. 税金及附加 | | - |
| 7. 其他费用 | 6.4.7.20 | 156,685.34 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 156,140,301.80 |
| 减：所得税费用 | | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 156,140,301.80 |

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华宝宝利纯债 86 个月定期开放债券型证券投资基金

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 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) | 7,999,012,580.32 | 40,794,358.54 | 8,039,806,938.86 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 156,140,301.80 | 156,140,301.80 |
| 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) | 37.21 | 2.02 | 39.23 |
| 其中：1. 基金申购款 | 37.21 | 2.02 | 39.23 |
| 2. 基金赎回款 | - | - | - |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列) | - | -87,989,138.23 | -87,989,138.23 |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 7,999,012,617.53 | 108,945,524.13 | 8,107,958,141.66 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

黄小薏

向辉

张幸骏

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华宝宝利纯债 86 个月定期开放债券型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2020]1099 号文《关于准予华宝宝利纯债 86 个月定期开放债券型证券投资基金注册的批复》准予注册，由华宝基金管理有限公司于 2020 年 7 月 2 日至 2020 年 7 月 7 日止期间向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具安永华明（2020）验字第 61471289_B06 号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2020 年 7 月 9 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 7,999,012,539.01 元；在募集期间产生利息为

人民币 1.16 元。以上实收基金合计为人民币 7,999,012,540.17 元，折合 7,999,012,540.17 份基金份额。本基金的基金管理人为华宝基金管理有限公司，基金托管人为兴业银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括债券（国债、金融债、央行票据、公司债、企业债、地方政府债、次级债、可分离交易可转债的纯债部分、短期融资券、超短期融资券、中期票据）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款等）以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金不投资股票，也不投资可转换债券（可分离交易可转债的纯债部分除外）和可交换债券。本基金投资的信用债券其发行人委托的国内评级机构出具的主体信用评级为 AA+ 以上（含 AA+）。本基金采取严格的买入持有到期投资策略，投资于剩余期限（或回售期限）不超过基金剩余封闭期的固定收益类工具。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。

本基金的投资组合比例为：本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%，每个开放期开始前三个月至开放期结束后三个月内不受前述投资组合比例的限制。本基金在开放期内持有现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，在封闭期内，本基金不受前述 5% 的限制。

本基金的业绩比较基准为：中债综合全价指数收益率。

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

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）和在财务报表附注所列示依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》、其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2021 年 6 月 30 日的财

务状况以及 2021 年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

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

(1) 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，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。

(2) 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。

(3) 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[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。

(4) 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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2021 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款 | 61,205.02 |
| 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 | 61,205.02 |

6.4.7.2 交易性金融资产

本基金本报告期末未持有交易性金融资产。

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

本基金本期末未持买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2021年6月30日 |
|------------|-------------------|
| 应收活期存款利息 | 37.90 |
| 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 | 30,193.00 |
| 应收债券利息 | 361,777,297.39 |
| 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 | 69.20 |
| 合计 | 361,807,597.49 |

6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2021年6月30日 |
|---------|-------------------|
| 其他应收款 | - |
| 待摊费用 | - |
| 持有至到期投资 | 13,841,975,626.38 |
| 合计 | 13,841,975,626.38 |

注：于 2021 年 06 月 30 日，本基金持有的持有至到期投资均为债券投资，其中交易所市场债券 3,953,501,066.23 元，银行间市场债券 9,888,474,560.15 元。上述持有至到期投资均无需计提减值准备。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2021 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | - |
| 银行间市场应付交易费用 | 124,907.40 |
| 合计 | 124,907.40 |

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2021 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | - |
| 应付证券出借违约金 | - |
| 预提费用 | 114,055.34 |
| 合计 | 114,055.34 |

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 | |
|---------------|---------------------------------------|------------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 7,999,012,580.32 | 7,999,012,580.32 |
| 本期申购 | 37.21 | 37.21 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | - | - |
| - 基金拆分/份额折算前 | - | - |
| 基金拆分/份额折算调整 | - | - |
| 本期申购 | - | - |
| 本期赎回（以“-”号填列） | - | - |
| 本期末 | 7,999,012,617.53 | 7,999,012,617.53 |

注：申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

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 | 40,794,358.54 | - | 40,794,358.54 |
| 本期利润 | 156,140,301.80 | - | 156,140,301.80 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 2.02 | - | 2.02 |
| 其中：基金申购款 | 2.02 | - | 2.02 |
| 基金赎回款 | - | - | - |
| 本期已分配利润 | -87,989,138.23 | - | -87,989,138.23 |
| 本期末 | 108,945,524.13 | - | 108,945,524.13 |

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|----|----|
|----|----|

| | 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------|
| 活期存款利息收入 | 15,661.39 |
| 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 | 345,040.42 |
| 其他 | 717.47 |
| 合计 | 361,419.28 |

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

无

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

本基金本报告期无股票投资收益。

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

本基金本报告期无股利收益。

6.4.7.17 公允价值变动收益

本基金本报告期无公允价值变动损益。

6.4.7.18 其他收入

本基金本报告期无其它收入。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2021年1月1日至2021年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 交易所市场交易费用 | - |
| 银行间市场交易费用 | 64.95 |
| 合计 | 64.95 |

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
|----------------|---------------------------------------|
| 审计费用 | 54,547.97 |
| 信息披露费 | 59,507.37 |
| 证券出借违约金 | - |
| 银行费用 | 24,030.00 |
| 账户维护费 | 18,000.00 |
| 上清所 CFCA 证书服务费 | 600.00 |
| 合计 | 156,685.34 |

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 |
| 兴业银行股份有限公司（“兴业银行”） | 基金托管人、基金销售机构 |
| 华宝信托有限责任公司（“华宝信托”） | 基金管理人的股东 |
| 华平资产管理有限合伙 (Warburg Pincus Asset Management, L.P.) | 基金管理人的股东 |
| 中国宝武钢铁集团有限公司（“宝武集团”） | 华宝信托的最终控制人 |
| 华宝证券股份有限公司（“华宝证券”） | 受宝武集团控制的公司、基金销售机构 |
| 华宝投资有限公司（“华宝投资”） | 受宝武集团控制的公司 |
| 宝武集团财务有限责任公司（“宝武财务”） | 受宝武集团控制的公司 |

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行交易。

6.4.10.1.2 债券交易

无

6.4.10.1.3 债券回购交易

无

6.4.10.1.4 权证交易

无

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无

6.4.10.2 关联方报酬**6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|-----------------|---------------------------------|
| | 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 5,997,435.29 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | - |

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.15% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|----------------|---------------------------------|
| | 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 1,999,145.08 |

注：基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.05% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

| 本期 2021年1月1日至2021年6月30日 | | | | | | |
|----------------------------|--------|------|-------|------|------------------|--------------|
| 银行间市场交易的 各关联方名称 | 债券交易金额 | | 基金逆回购 | | 基金正回购 | |
| | 基金买入 | 基金卖出 | 交易金额 | 利息收入 | 交易金额 | 利息支出 |
| 兴业银行 | - | - | - | - | 7,353,784,000.00 | 1,393,894.05 |

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期内未发生转融通证券出借业务。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

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

本基金本报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末除基金管理人以外的其他关联方未投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2021年1月1日至2021年6月30日 | |
|------------|----------------------------|-----------|
| | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 兴业银行股份有限公司 | 61,205.02 | 15,661.39 |

注：本基金的银行存款由基金托管人兴业银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

| 序号 | 权益登记日 | 除息日 | | 每 10 份基金份额分红数 | 现金形式发放总额 | 再投资形式发放总额 | 本期利润分配合计 | 备注 |
|----|------------|-----|------------|---------------|---------------|-----------|---------------|----|
| | | 场内 | 场外 | | | | | |
| 1 | 2021年3月15日 | - | 2021年3月15日 | 0.1100 | 87,989,099.00 | 39.23 | 87,989,138.23 | - |
| 合计 | - | - | - | 0.1100 | 87,989,099.00 | 39.23 | 87,989,138.23 | - |

6.4.12 期末(2021年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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

截至本报告期末 2021 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 3,096,721,110.11 元，是以如下债券作为抵押：

金额单位：人民币元

| 债券代码 | 债券名称 | 回购到期日 | 期末估值单价 | 数量（张） | 期末估值总额 |
|-----------|------------|----------------|--------|------------|------------------|
| 092018002 | 20 农发清发 02 | 2021 年 7 月 1 日 | 96.63 | 6,315,000 | 610,224,396.85 |
| 170215 | 17 国开 15 | 2021 年 7 月 1 日 | 104.20 | 3,062,000 | 319,069,513.69 |
| 170415 | 17 农发 15 | 2021 年 7 月 1 日 | 104.51 | 6,206,000 | 648,574,033.91 |
| 200209 | 20 国开 09 | 2021 年 7 月 2 日 | 99.04 | 8,000,000 | 792,298,366.68 |
| 170415 | 17 农发 15 | 2021 年 7 月 5 日 | 104.51 | 8,132,000 | 849,855,630.64 |
| 合计 | | | | 31,715,000 | 3,220,021,941.77 |

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 06 月 30 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 3,064,000,000.00 元，于 2021 年 07 月 01 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为债券型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金，但低于混合型基金、股票型基金。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括债券（国债、金融债、央行票据、公司债、企业债、地方政府债、次级债、可分离交易可转债的纯债部分、短期融资券、超短期融资券、中期票据）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款等）以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金不投资股票，也不投资可转换债券（可分离交易可转债的纯债部分除外）和可交换债券。本基金采取严格的买入持有到期投资策略，投资于剩余期限（或回售期限）不超过基金剩余封闭期的固定收益类工具。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在控制风险的前提下，追求稳定的当期收益和总回报，争取实现基金资产的长期稳健增值。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，公司内部监督和反馈系统包括内部控制委员会、督察长、合规审计部、风险管理部、各部门负责人和风险控制联络人、各业务岗位。内部控制委员会负责对公司经营管理及基金运作中的风险进行评估并研究制订相应的控制制度。督察长向董事会负责，总管公司的内控事务并独立地就内控制度的执行情况履行检查、评价、报告和建议职能。风险管理部在督察长指导下对公司内部控制运行情况进行监控，主要针对公司内部控制制度的总体构架和内部控制的目标进行评估并提出改进意见；合规审计部在督察长的领导下对各部门和岗位的内部控制执行情况进行监督和核查，同时对内控的失控点进行查漏并责令改正。

本基金的基金管理人根据自身经营特点设立顺序递进、权责统一、严密有效的四层监控防线。第一层监控防线为一线岗位自控与互控；第二层防线为大业务板块内部各部门和部门之间的自控和互控；第三层监控防线为风险管理部和合规审计部对各岗位、各部门、各项业务全面实施的监

督反馈；最后是以内部控制委员会为主体的第四层防线，实施对公司各类业务和风险的总体监督、控制，并对风险管理部和合规审计部的工作予以直接指导。

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

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。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。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末均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均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 2021 年 6 月 30 日 | 上年度末 2020 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| AAA | - | - |
| AAA 以下 | - | - |
| 未评级 | 13,841,975,626.38 | 12,111,949,553.63 |
| 合计 | 13,841,975,626.38 | 12,111,949,553.63 |

注：未评级债券为政策性金融债。上述评级均由经中国证监会核准从事证券市场资信评级业务的评级机构做出。

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均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均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。本基金的债券投资采用买入持有至到期策略，流动性风险主要来自于基金份额持有人于约定开放日要求赎回其持有的基金份额。针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人于开放期内每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于本报告期末，除附注中列示的卖出回购金融资产款将在一个月以内到期且计息（该利息金额不重大）外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（自 2017 年 10 月 1 日起施行）等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行

持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%，本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制）。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易。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。开放期内，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

于开放期内，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。

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；开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风

险进行管理。

本基金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。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 2021年6月30日 | 1年以内 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计 |
|---------------------|--------------------------|----------|---------------------------|-----------------------|--------------------------|
| 资产 | | | | | |
| 银行存款 | 61,205.02 | - | - | - | 61,205.02 |
| 结算备付金 | 67,095,563.60 | - | - | - | 67,095,563.60 |
| 存出保证金 | 153,874.15 | - | - | - | 153,874.15 |
| 应收利息 | - | - | - | 361,807,597.49 | 361,807,597.49 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | 125,048.54 | 125,048.54 |
| 其他资产 | - | - | 13,841,975,626.38 | - | 13,841,975,626.38 |
| 资产总计 | 67,310,642.77 | - | 13,841,975,626.38 | 361,932,646.03 | 14,271,218,915.18 |
| 负债 | | | | | |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 997,928.59 | 997,928.59 |
| 应付托管费 | - | - | - | 332,642.87 | 332,642.87 |
| 卖出回购金融资产款 | 6,160,721,110.11 | - | - | - | 6,160,721,110.11 |
| 应付交易费用 | - | - | - | 124,907.40 | 124,907.40 |
| 应付利息 | - | - | - | 970,129.21 | 970,129.21 |
| 其他负债 | - | - | - | 114,055.34 | 114,055.34 |
| 负债总计 | 6,160,721,110.11 | - | - | 2,539,663.41 | 6,163,260,773.52 |
| 利率敏感度缺口 | -6,093,410,467.34 | - | -13,841,975,626.38 | 359,392,982.62 | 8,107,958,141.66 |
| 上年度末 2020年12月31日 | 1年以内 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计 |
| 资产 | | | | | |
| 银行存款 | 614,071.16 | - | - | - | 614,071.16 |
| 结算备付金 | 42,215,253.18 | - | - | - | 42,215,253.18 |
| 存出保证金 | 167,883.55 | - | - | - | 167,883.55 |
| 应收利息 | - | - | - | 196,062,852.45 | 196,062,852.45 |
| 其他资产 | - | - | 12,111,949,553.63 | - | 12,111,949,553.63 |
| 资产总计 | 42,997,207.89 | - | 12,111,949,553.63 | 196,062,852.45 | 12,351,009,613.97 |
| 负债 | | | | | |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 1,022,733.48 | 1,022,733.48 |
| 应付托管费 | - | - | - | 340,911.17 | 340,911.17 |
| 应付证券清算款 | - | - | - | 78,098.74 | 78,098.74 |
| 卖出回购金融资产款 | 4,308,624,136.20 | - | - | - | 4,308,624,136.20 |

| | | | | | |
|---------|-------------------|--------------------|----------------|--------------|------------------|
| 应付交易费用 | - | - | - | 121,364.67 | 121,364.67 |
| 应付利息 | - | - | - | 855,430.85 | 855,430.85 |
| 其他负债 | - | - | - | 160,000.00 | 160,000.00 |
| 负债总计 | 4,308,624,136.20 | - | - | 2,578,538.91 | 4,311,202,675.11 |
| 利率敏感度缺口 | -4,265,626,928.31 | -12,111,949,553.63 | 193,484,313.54 | | 8,039,806,938.86 |

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

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

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”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。本基金的投资范围为固定收益类金融工具。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR (Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

无

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

本报告期末，本基金未持有交易性权益类投资（上年度末：同）。因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响（上年度末：同）。

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、应收利息以及其他金融负债，除持有至到期金融资产外的其他金融资产因其剩余期限不长，因此公允价值与账面价值相若。

以下是本基金除账面价值与公允价值差异很小的金融工具之外的各类别金融工具的账面价值与公允价值的比较：

分类为持有至到期投资的债权摊余成本为 13,841,975,626.38，公允价值为 13,951,252,954.40，公允价值变动为 109,277,328.02。

其中银行间市场债权摊余成本为，公允价值为 9,888,474,560.15，公允价值为 9,954,136,500.00，公允价值变动为 65,661,939.85；交易所市场债权摊余成本为 3,953,501,066.23，公允价值为 3,997,116,454.40，公允价值变动为 43,615,388.17。

(b) 以公允价值计量的金融工具

于本报告期末，本基金未持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产（于上年度末：同）。

(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 | - | - |
| | 其中：股票 | - | - |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 13,841,975,626.38 | 96.99 |
| | 其中：债券 | 13,841,975,626.38 | 96.99 |

| | | | |
|---|-------------------|-------------------|--------|
| | 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 | 67,156,768.62 | 0.47 |
| 8 | 其他各项资产 | 362,086,520.18 | 2.54 |
| 9 | 合计 | 14,271,218,915.18 | 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

本基金本报告期末未持有股票投资。

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

本基金本报告期末未持有股票投资。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期内无股票投资。

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

本基金本报告期内无股票投资。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期内无股票投资。

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 | 13,841,975,626.38 | 170.72 |
| | 其中：政策性金融债 | 13,841,975,626.38 | 170.72 |
| 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） | - | - |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |

| | | | |
|----|----|-------------------|--------|
| 10 | 合计 | 13,841,975,626.38 | 170.72 |
|----|----|-------------------|--------|

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 | 170415 | 17 农发 15 | 43,050,000 | 4,499,051,266.47 | 55.49 |
| 2 | 092018002 | 20 农发清发 02 | 29,700,000 | 2,869,938,968.57 | 35.40 |
| 3 | 018014 | 国开 2005 | 24,558,720 | 2,416,660,816.44 | 29.81 |
| 4 | 018084 | 农发 2002 | 15,340,000 | 1,536,840,249.79 | 18.95 |
| 5 | 200209 | 20 国开 09 | 10,700,000 | 1,059,699,065.44 | 13.07 |

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国债期货交易情况说明

7.10.1 本期国债期货投资政策

本基金未投资国债期货。

7.10.2 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。

7.10.3 本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1

基金管理人没有发现本基金投资的前十名证券的发行主体在报告期内被监管部门立案调查，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚，无证券投资决策程序需特别说明。

7.11.2

本基金不投资股票。

7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|----|----|----|
|----|----|----|

| | | |
|---|---------|----------------|
| 1 | 存出保证金 | 153,874.15 |
| 2 | 应收证券清算款 | 125,048.54 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 361,807,597.49 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 362,086,520.18 |

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票投资。

7.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

1、本基金估值采用摊余成本法，即估值对象以买入成本列示，按票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价和折价，在其剩余存续期内按照实际利率法进行摊销，确认利息收入并评估减值准备。本报告中投资组合报告公允价值部分均以摊余成本列示。

2、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 (户) | 户均持有的基 金份额 | 持有人结构 | | | |
|--------------|---------------|------------------|----------------|-----------|----------------|
| | | 机构投资者 | | 个人投资者 | |
| | | 持有份额 | 占总份额比 例 (%) | 持有份额 | 占总份额比 例 (%) |
| 216 | 37,032,465.82 | 7,998,993,000.00 | 100.00 | 19,617.53 | 0.00 |

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 | 8,851.52 | 0.0001 |

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（2020 年 7 月 9 日）基金份额总额 | 7,999,012,540.17 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 7,999,012,580.32 |
| 本报告期基金总申购份额 | 37.21 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | - |
| 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 | 7,999,012,617.53 |

§ 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

报告期内，基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金财产和基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金的投资策略未发生变更。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

- 1、本报告期内，本基金管理人及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。
- 2、本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|------|--------|------|--------------|-----------|------------|----|
| | | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 | |
| 安信证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 国盛证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 海通证券 | 2 | - | - | - | - | - |

注：1. 基金管理人选择交易单元的标准和程序如下：

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

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

2. 本报告期新增交易单元的券商为：安信证券和海通证券。

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 |
| 安信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国盛证券 | 1,772,743,383.28 | 100.00% | 63,186,500,000.00 | 100.00% | - | - |
| 海通证券 | - | - | - | - | - | - |

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 | 华宝宝利纯债 86 个月定期开放债券型证券投资基金 2020 年第 4 季度报告 | 基金管理人网站 | 2021-1-22 |
| 2 | 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 |
| 3 | 华宝基金管理有限公司关于提示投资者完善身份信息的通知 | 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 |
| 4 | 华宝宝利纯债 86 个月定期开放债券型证券投资基金第二次分红公告 | 基金管理人网站, 证券时报 | 2021-3-11 |
| 5 | 华宝宝利纯债 86 个月定期开放债券型证券投资基金 2020 年年度报告 | 基金管理人网站 | 2021-3-31 |
| 6 | 华宝宝利纯债 86 个月定期开放债券型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告 | 基金管理人网站 | 2021-4-22 |
| 7 | 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 |
| 8 | 华宝基金关于旗下部分开放式基金参加交通银行申购及定投手续费率优惠活动的公告 | 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 | 2021-6-30 |

§ 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 | 2,599,999.00 | 0.00 | 0.00 | 2,599,999.00 | 32.50 |
| | 2 | 20210101~20210630 | 1,999,999.00 | 0.00 | 0.00 | 1,999,999.00 | 25.00 |

产品特有风险

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

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

中国证监会批准基金设立的文件；

华宝宝利纯债 86 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同；

华宝宝利纯债 86 个月定期开放债券型证券投资基金招募说明书；

华宝宝利纯债 86 个月定期开放债券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