

华宝新兴产业混合型证券投资基金 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：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2021 年 8 月 27 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 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

§ 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	6
§ 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	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
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	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
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	11
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
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	40
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	41
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	45
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	47
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	47
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	47
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	47

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	47
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	47
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	48
7.12 投资组合报告附注	48
§ 8 基金份额持有人信息	49
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	49
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	49
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	49
§ 9 开放式基金份额变动	49
§ 10 重大事件揭示	50
10.1 基金份额持有人大会决议	50
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	50
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	50
10.4 基金投资策略的改变	50
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	50
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	50
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	50
10.8 其他重大事件	55
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	56
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	56
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	56
§ 12 备查文件目录	56
12.1 备查文件目录	56
12.2 存放地点	56
12.3 查阅方式	56

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华宝新兴产业混合型证券投资基金
基金简称	华宝新兴产业混合
基金主代码	240017
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年12月7日
基金管理人	华宝基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	141,792,773.45 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	分享新兴产业所带来的投资机会，力争在长期内为基金份额持有人获取超额回报。
投资策略	本基金采取积极的大类资产配置策略，通过宏观策略研究，对相关资产类别的预期收益进行动态跟踪，通过对新兴产业相关行业的辨识、精选以及对新兴产业相关股票的深入分析，挖掘该类型企业的投资价值，分享新兴产业发展所带来的较高回报。本基金通过采取自上而下的方法确定投资组合久期，结合自下而上的个券选择方法构建债券投资组合。
业绩比较基准	75%中证新兴产业指数+25%上证国债指数。
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	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	周雷	李申
	联系电话	021-38505888	021-60637102
	电子邮箱	xxpl@fsfund.com	lishen.zh@ccb.com
客户服务电话		400-700-5588、400-820-5050、 021-38924558	021-60637111
传真		021-38505777	021-60635778
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区世纪大道100号上海环球金融中心58楼	北京市西城区金融大街25号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区世纪大道100号上海环球金融中心58楼	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码		200120	100033
法定代表人		XIAOYI HELEN HUANG	田国立

2.4 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	77,711,430.96
本期利润	29,036,765.25
加权平均基金份额本期利润	0.1995
本期加权平均净值利润率	6.32%
本期基金份额净值增长率	5.97%
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	339,061,354.73
期末可供分配基金份额利润	2.3912
期末基金资产净值	480,854,128.18
期末基金份额净值	3.3912
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	324.74%

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	份额净值	业绩比较	业绩比较基准	①—③	②—④
----	-----	------	------	--------	-----	-----

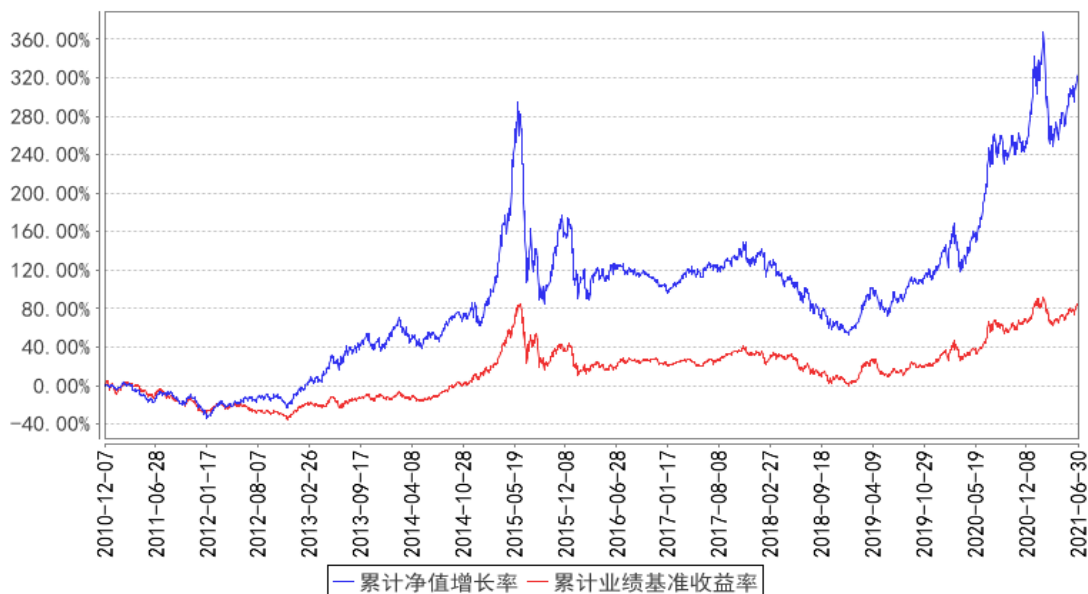
	值增长率①	增长率标准差②	基准收益率③	收益率标准差④		
过去一个月	4.11%	1.28%	3.08%	0.94%	1.03%	0.34%
过去三个月	17.48%	1.22%	11.40%	0.92%	6.08%	0.30%
过去六个月	5.97%	1.92%	6.31%	1.20%	-0.34%	0.72%
过去一年	37.42%	1.73%	26.69%	1.20%	10.73%	0.53%
过去三年	117.16%	1.57%	55.03%	1.20%	62.13%	0.37%
自基金合同生效起至今	324.74%	1.62%	85.38%	1.25%	239.36%	0.37%

注：1、净值以及比较基准相关数据计算中涉及天数的，包括所有交易日以及季末最后一自然日（如非交易日）。

2、本基金业绩比较基准为：75%中证新兴产业指数+25%上证国债指数。

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

华宝新兴产业混合累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：按照基金合同的约定，自基金成立日期的 6 个月内达到规定的资产组合，截至 2011 年 6 月 6 日，本基金已达到合同规定的资产配置比例。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

华宝基金管理有限公司（公司原名“华宝兴业基金管理有限公司”）于 2003 年 2 月 12 日经中国证监会批准设立，2003 年 3 月 7 日在国家工商总局注册登记并正式开业，是国内首批中外合资基金管理公司。成立之初，公司注册资本为人民币 1 亿元人民币，2007 年经中国证监会批准，公司注册资本增加至 1.5 亿元人民币。2017 年公司名称变更为“华宝基金管理有限公司”。目前公司股东为华宝信托有限责任公司与美国华平资产管理有限合伙（Warburg Pincus Asset Management, L.P.），持有股权占比分别为 51%和 49%。公司在北京、深圳等地设有分公司，在香港设有子公司——华宝资产管理(香港)有限公司。

截至本报告期末（2021 年 6 月 30 日），本公司正在管理运作的证券投资基金包括：华宝宝康债券投资基金、华宝宝康消费品证券投资基金、华宝宝康灵活配置证券投资基金、华宝现金货币市场基金、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		
易 镜 明	本基金基金经理	2015 年 4 月 9 日	-	14 年	博士。曾在国泰君安证券、中海基金从事行业研究工作。2012 年 11 月加入华宝基金管理有限公司，先后任高级分析师、基金经理助理等职务。2015 年 4 月起任华宝新兴产业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、《华宝新兴产业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

回顾 2021 年上半年，A 股表现较好，科创板涨幅领先，创业板也涨幅可观，深成指、上证指数涨幅比较落后。板块和热点表现方面，基础化工、钢铁、电力设备及新能源、煤炭、石油化工、医药等较强，其次是有色、电子、汽车、纺织服装等行业表现不错，非银、农林牧渔、家电、军工、地产等行业表现较弱。行业景气度较高的新能源车及相关化工、CXO、半导体等表现强，但当前也要注意性价比。

我们适当配置了新能源车、CXO、电子、白酒等，主要是基于产业逻辑。新能源汽车行业步入全面加速发展的阶段，主要有以下三方面：1. 欧美政策的超预期，欧洲新的碳排放要求趋严，同时，美国新能源政策逐渐落地，储能业务放量，新能源加速前进。2、供给改善的超预期，特斯拉国产后随着国产化率的提升成本不断下降，多次下调售价，高性价比推动国内其他车企推出高性价比车型；3. 国内电动车销量的超预期，目前国内电动车渗透率 10%左右，达到新技术渗透曲线 10-50%的快速增长区间，销量有望超预期。

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 5.97%，业绩比较基准收益率为 6.31%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

7 月 7 日，国务院常务会议提出“针对大宗商品价格上涨对企业生产经营的影响，要在坚持不搞大水漫灌的基础上，保持货币政策稳定性、增强有效性，适时运用降准等货币政策工具，进一步加强金融对实体经济特别是中小微企业的支持，促进综合融资成本稳中有降”。我们更倾向于把此次降准表述理解为稳定企业利润空间的“结构性政策”储备。下半年碳减排举措升温，则企业端成本压力可能会持续偏大，在这一背景下，降低融资端成本可以作为“针对大宗商品价格上涨对企业生产经营的影响”的解决方案之一。

我们还是坚持按照行业景气度，先选行业再选公司的原则。我们配置较为均衡，未来我们将采取自下而上为主，自上而下为辅的选股策略，寻找新兴产业中的较好公司，以及从技术创新、商业模式创新和制度创新中受益的成长股，买入并长期持有，以分享这些公司在未来的业绩快速增长过程中带来的丰厚回报。同时，我们将以勤勉尽责的态度，不断优化我们的投资组合，努力给持有人带来较好的中长期投资回报。

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及适用性的情况后及时修订估值方法。基金在投资新品种时，由估值委员会评价现有估值政策和程序的适用性。

(1) 日常估值流程

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

(2) 特殊业务估值流程

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

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

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

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华宝新兴产业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 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	57,917,528.97	61,552,269.48
结算备付金		958,470.85	650,638.57
存出保证金		148,659.48	168,997.91
交易性金融资产	6.4.7.2	427,907,777.90	436,618,601.84
其中：股票投资		427,907,777.90	436,618,601.84

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		4,266,830.44	1,589,430.83
应收利息	6.4.7.5	6,519.68	6,268.36
应收股利		-	-
应收申购款		196,000.38	164,338.85
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		491,401,787.70	500,750,545.84
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		6,501,837.00	-
应付赎回款		1,742,344.44	3,089,092.54
应付管理人报酬		574,038.20	584,228.15
应付托管费		95,673.05	97,371.36
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	1,547,468.70	1,147,233.39
应交税费		-	0.49
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	86,298.13	178,637.22
负债合计		10,547,659.52	5,096,563.15
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	141,792,773.45	154,888,649.97
未分配利润	6.4.7.10	339,061,354.73	340,765,332.72
所有者权益合计		480,854,128.18	495,653,982.69
负债和所有者权益总计		491,401,787.70	500,750,545.84

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额净值 3.3912 元，基金份额总额 141792773.45 份。

6.2 利润表

会计主体：华宝新兴产业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		34,977,557.91	128,481,044.45
1. 利息收入		166,952.09	235,130.33
其中：存款利息收入	6.4.7.11	166,952.09	235,130.33
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		83,428,234.94	54,598,778.01
其中：股票投资收益	6.4.7.12	82,249,009.21	53,187,499.50
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	1,179,225.73	1,411,278.51
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-48,674,665.71	73,598,229.71
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	57,036.59	48,906.40
减：二、费用		5,940,792.66	5,241,452.46
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	3,441,544.00	2,949,789.45
2. 托管费	6.4.10.2.2	573,590.73	491,631.58
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	1,818,487.43	1,692,655.17
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.20	107,170.50	107,376.26
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		29,036,765.25	123,239,591.99
减：所得税费用		-	-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		29,036,765.25	123,239,591.99
-------------------	--	---------------	----------------

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华宝新兴产业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 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）	154,888,649.97	340,765,332.72	495,653,982.69
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	29,036,765.25	29,036,765.25
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）	-13,095,876.52	-30,740,743.24	-43,836,619.76
其中：1. 基金申购款	12,548,238.33	27,751,905.05	40,300,143.38
2. 基金赎回款	-25,644,114.85	-58,492,648.29	-84,136,763.14
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）	141,792,773.45	339,061,354.73	480,854,128.18
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	226,918,217.65	187,221,707.70	414,139,925.35

二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	123,239,591.99	123,239,591.99
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）	-44,700,016.92	-42,998,615.37	-87,698,632.29
其中：1. 基金申购款	14,859,304.17	14,918,092.51	29,777,396.68
2. 基金赎回款	-59,559,321.09	-57,916,707.88	-117,476,028.97
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）	182,218,200.73	267,462,684.32	449,680,885.05

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：

黄小慧

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

华宝新兴产业混合型证券投资基金(原名为华宝兴业新兴产业股票型证券投资基金、华宝兴业新兴产业混合型证券投资基金，以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2010]第 1241 号《关于核准华宝兴业新兴产业股票型证券投资基金募集的批复》核准，由华宝基金管理有限公司(原华宝兴业基金管理有限公司，已于 2017 年 10 月 17 日办理完成工商变更登记)依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华宝兴业新兴产业股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 3,632,254,340.43 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2010)第 381 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华宝兴业新兴产业股

票型证券投资基金基金合同》于 2010 年 12 月 7 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 3,632,789,229.65 份基金份额，其中认购资金利息折合 534,889.22 份基金份额。本基金的基金管理人为华宝基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据 2014 年中国证监会令第 104 号《公开募集证券投资基金运作管理办法》，华宝兴业新兴产业股票型证券投资基金于 2015 年 7 月 22 日公告后更名为华宝兴业新兴产业混合型证券投资基金。

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》，华宝兴业新兴产业混合型证券投资基金于 2017 年 12 月 30 日起更名为华宝新兴产业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》和《华宝新兴产业混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行、上市的股票、债券、货币市场工具以及经中国证监会批准的允许基金投资的其它金融工具。本基金的股票投资比例为基金资产的 60%-95%，其中投资于新兴产业相关股票的比例不低于股票资产的 80%；权证的投资比例占基金资产的 0%-3%；现金、债券资产及中国证监会允许基金投资的其他证券品种的比例占基金资产的 5%-40%，其中现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为：中证新兴产业指数×75%+上证国债指数×25%。

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

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华宝新兴产业混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《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》、财税[2015]101号《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》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对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，股票的股息、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。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴

20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，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，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%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。

(4) 基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
活期存款	57,917,528.97
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	57,917,528.97

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	342,973,407.08	427,907,777.90	84,934,370.82
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	342,973,407.08	427,907,777.90	84,934,370.82

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

本基金本期末及上年度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	6,021.38
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	431.40
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	66.90
合计	6,519.68

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
交易所市场应付交易费用	1,547,468.70
银行间市场应付交易费用	-
合计	1,547,468.70

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	1,995.57
应付证券出借违约金	-
预提费用	84,302.56
合计	86,298.13

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	154,888,649.97	154,888,649.97
本期申购	12,548,238.33	12,548,238.33
本期赎回（以“-”号填列）	-25,644,114.85	-25,644,114.85
- 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	141,792,773.45	141,792,773.45

注：申购含红利再投以及转换入份额；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	379,731,678.11	-38,966,345.39	340,765,332.72
本期利润	77,711,430.96	-48,674,665.71	29,036,765.25
本期基金份额交易产生的变动数	-34,777,627.06	4,036,883.82	-30,740,743.24
其中：基金申购款	33,973,553.39	-6,221,648.34	27,751,905.05
基金赎回款	-68,751,180.45	10,258,532.16	-58,492,648.29
本期已分配利润	-	-	-
本期末	422,665,482.01	-83,604,127.28	339,061,354.73

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	159,661.32
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	6,005.07
其他	1,285.70
合计	166,952.09

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	82,249,009.21
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	82,249,009.21

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出股票成交总额	614,127,588.69
减：卖出股票成本总额	531,878,579.48
买卖股票差价收入	82,249,009.21

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

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益**6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,179,225.73
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	1,179,225.73

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
1. 交易性金融资产	-48,674,665.71
股票投资	-48,674,665.71
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	-48,674,665.71

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
基金赎回费收入	51,223.22
基金转换费收入	5,813.37
合计	57,036.59

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
	2021年1月1日至2021年6月30日
交易所市场交易费用	1,818,487.43
银行间市场交易费用	-
合计	1,818,487.43

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	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	4,267.94
账户维护费	18,000.00
上清所 CFCA 证书服务费	600.00
合计	107,170.50

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
中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	基金托管人、基金销售机构
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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)
华宝证券	-	-	67,534,470.25	6.22

注：本基金本期及无通过关联方交易单元进行的交易。

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
-	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
华宝证券	62,895.18	6.40	61,039.26	8.69

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

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	上年度可比期间 2020年1月1日至2020 年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	3,441,544.00	2,949,789.45
其中：支付销售机构的客户维护 费	1,397,273.12	1,257,956.71

注：支付基金管理人华宝兴业的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 1.5% / 当年天数。

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	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	573,590.73	491,631.58

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

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
基金合同生效日（2010 年 12 月 7 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	258,887.79	258,887.79
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	258,887.79	258,887.79
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.18%	0.14%

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

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末及上年度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		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	57,917,528.97	159,661.32	51,854,954.35	227,110.55

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，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23日	2021年07月02日	新股锁定	24.60	163.00	515	12669.00	83945.00	-
300926	博俊科技	2020年12月29日	2021年7月12日	新股锁定	10.76	22.20	359	3862.84	7969.80	-
300927	江天化学	2020年12月29日	2021年7月7日	新股锁定	13.39	30.10	217	2905.63	6531.70	-

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	2538.21	5407.65	-
300930	屹通新 材	2021年 1月13 日	2021年 7月21 日	新股锁定	13.11	24.48	322	4221.42	7882.56	-
300931	通用电 梯	2021年 1月13 日	2021年 7月21 日	新股锁定	4.31	13.11	672	2896.32	8809.92	-
300933	中辰股 份	2021年 1月15 日	2021年 7月22 日	新股锁定	3.37	10.44	1,112	3747.44	11609.28	-
300937	药易购	2021年 1月20 日	2021年 7月27 日	新股锁定	12.25	53.71	244	2989.00	13105.24	-
300940	南极光	2021年 1月27 日	2021年 8月3 日	新股锁定	12.76	43.38	307	3917.32	13317.66	-
300942	易瑞生 物	2021年 2月2 日	2021年 8月9 日	新股锁定	5.31	28.52	443	2352.33	12634.36	-
300943	春晖智 控	2021年 2月3 日	2021年 8月10 日	新股锁定	9.79	23.01	255	2496.45	5867.55	-
300945	曼卡龙	2021年 2月3 日	2021年 8月10 日	新股锁定	4.56	18.88	474	2161.44	8949.12	-
300948	冠中生 态	2021年 2月18 日	2021年 8月25 日	新股锁定	13.00	27.42	324	2808.00	8884.08	-
300950	德固特	2021年 2月24 日	2021年 9月3 日	新股锁定	8.41	39.13	219	1841.79	8569.47	-
300952	恒辉安 防	2021年 3月3 日	2021年 9月13 日	新股锁定	11.72	27.08	340	3984.80	9207.20	-
300953	震裕科 技	2021年 3月11 日	2021年 9月22 日	新股锁定	28.77	99.85	240	6904.80	23964.00	-
300955	嘉亨家 化	2021年 3月16 日	2021年 9月24 日	新股锁定	16.53	46.07	232	3834.96	10688.24	-
300956	英力股 份	2021年 3月16 日	2021年 9月27 日	新股锁定	12.85	25.80	371	4767.35	9571.80	-

		日	日								
300957	贝泰妮	2021年 3月18 日	2021年 9月27 日	新股锁定	47.33	251.96	318	15050.94	80123.28		-
300958	建工修 复	2021年 3月18 日	2021年 9月29 日	新股锁定	8.53	27.22	300	2559.00	8166.00		-
300960	通业科 技	2021年 3月22 日	2021年 9月29 日	新股锁定	12.08	23.06	234	2826.72	5396.04		-
300961	深水海 纳	2021年 3月23 日	2021年 9月30 日	新股锁定	8.48	22.07	394	3341.12	8695.58		-
300962	中金辐 照	2021年 3月29 日	2021年 10月 11日	新股锁定	3.40	16.37	576	1958.40	9429.12		-
300963	中洲特 材	2021年 3月30 日	2021年 10月 11日	新股锁定	12.13	22.49	283	3432.79	6364.67		-
300966	共同药 业	2021年 3月31 日	2021年 10月 11日	新股锁定	8.24	31.54	286	2356.64	9020.44		-
300967	晓鸣股 份	2021年 4月2 日	2021年 10月 13日	新股锁定	4.54	11.54	507	2301.78	5850.78		-
300968	格林精 密	2021年 4月6 日	2021年 10月 15日	新股锁定	6.87	12.07	1,162	7982.94	14025.34		-
300971	博亚精 工	2021年 4月7 日	2021年 10月 15日	新股锁定	18.24	28.29	245	4468.80	6931.05		-
300972	万辰生 物	2021年 4月8 日	2021年 10月 19日	新股锁定	7.19	12.65	430	3091.70	5439.50		-
300973	立高食 品	2021年 4月8 日	2021年 10月 15日	新股锁定	28.28	115.71	360	10180.80	41655.60		-
300975	商络电 子	2021年 4月14 日	2021年 10月 21日	新股锁定	5.48	13.03	492	2696.16	6410.76		-
300978	东箭科 技	2021年 4月15 日	2021年 10月 26日	新股锁定	8.42	13.60	593	4993.06	8064.80		-
300979	华利集	2021年	2021年	新股锁定	33.22	87.50	546	18138.12	47775.00		-

	团	4月15日	10月26日							
300981	中红医疗	2021年4月19日	2021年10月27日	新股锁定	48.59	90.39	335	16277.65	30280.65	-
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	5018.11	14356.93	-
300985	致远新能	2021年4月21日	2021年10月29日	新股锁定	24.90	24.81	295	7345.50	7318.95	-
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	3904.56	8070.48	-
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	2043.79	8069.81	-
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	3317.24	6733.54	-
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	1872.00	4064.00	-
300993	玉马遮阳	2021年5月17日	2021年11月24日	新股锁定	12.10	19.29	410	4961.00	7908.90	-
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	2811.52	4454.12	-
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	5015.21	10177.43	-
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	4584.32	12110.40	-
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	1210.02	4285.32	-
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	3760.71	11581.62	-
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	2436.72	6845.28	-

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	1602.87	4375.32	-
301010	晶雪节能	2021年 6月9 日	2021年 12月 20日	新股锁定	7.83	17.61	218	1706.94	3838.98	-
301011	华立科技	2021年 6月9 日	2021年 12月 17日	新股锁定	14.20	33.84	175	2485.00	5922.00	-
301012	扬电科技	2021年 6月15 日	2021年 12月 22日	新股锁定	8.05	24.26	170	1368.50	4124.20	-
301015	百洋医药	2021年 6月22 日	2021年 12月 30日	新股锁定	7.64	38.83	462	3529.68	17939.46	-
301016	雷尔伟	2021年 6月23 日	2021年 12月 30日	新股锁定	13.75	32.98	275	3781.25	9069.50	-
301017	漱玉平民	2021年 6月23 日	2021年 7月5 日	新股流通 受限	8.86	8.86	4,995	44255.70	44255.70	-
301017	漱玉平民	2021年 6月23 日	2022年 1月5 日	新股锁定	8.86	8.86	555	4917.30	4917.30	-
301018	申菱环境	2021年 6月28 日	2021年 7月7 日	新股流通 受限	8.29	8.29	7,030	58277.87	58277.87	-
301018	申菱环境	2021年 6月28 日	2022年 1月7 日	新股锁定	8.29	8.29	781	6475.32	6475.32	-
301021	英诺激光	2021年 6月28 日	2021年 7月6 日	新股流通 受限	9.46	9.46	2,609	24682.09	24682.09	-
301021	英诺激光	2021年 6月28 日	2022年 1月6 日	新股锁定	9.46	9.46	290	2742.45	2742.45	-
605162	新中港	2021年 6月29 日	2021年 7月7 日	新股流通 受限	6.07	6.07	1,377	8358.39	8358.39	-
605287	德才股份	2021年 6月28 日	2021年 7月6 日	新股流通 受限	31.56	31.56	349	11014.44	11014.44	-
688067	爱威科技	2021年 6月7	2021年 12月	新股锁定	14.71	24.83	1,259	18519.89	31260.97	-

		日	16日								
688087	英科再生	2021年 6月30 日	2021年 7月9 日	新股流通 受限	21.96	21.96	2,469	54219.24	54219.24		-
688109	品茗股份	2021年 3月22 日	2021年 9月30 日	新股锁定	50.05	72.10	1,301	65115.05	93802.10		-
688195	腾景科技	2021年 3月18 日	2021年 9月27 日	新股锁定	13.60	19.87	2,693	36624.80	53509.91		-
688201	信安世纪	2021年 4月13 日	2021年 10月 21日	新股锁定	26.78	45.41	2,129	57014.62	96677.89		-
688226	威腾电气	2021年 6月28 日	2021年 7月7 日	新股流通 受限	6.42	6.42	2,693	17289.06	17289.06		-
688239	航宇科技	2021年 6月25 日	2021年 7月5 日	新股流通 受限	11.48	11.48	4,926	56550.48	56550.48		-
688329	艾隆科技	2021年 3月16 日	2021年 9月29 日	新股锁定	16.81	50.04	1,846	31031.26	92373.84		-
688565	力源科技	2021年 5月6 日	2021年 11月 15日	新股锁定	9.39	14.00	2,464	23136.96	34496.00		-
688575	亚辉龙	2021年 5月10 日	2021年 11月 17日	新股锁定	14.80	32.09	3,435	50838.00	110229.15		-
688613	奥精医疗	2021年 5月13 日	2021年 11月 22日	新股锁定	16.43	63.50	2,617	42997.31	166179.50		-
688621	阳光诺和	2021年 6月11 日	2021年 12月 21日	新股锁定	26.89	63.99	1,485	39931.65	95025.15		-
688630	芯碁微装	2021年 3月25 日	2021年 10月8 日	新股锁定	15.23	58.42	3,397	51736.31	198452.74		-
688683	莱尔科技	2021年 4月1 日	2021年 10月 12日	新股锁定	9.51	14.73	3,296	31344.96	48550.08		-
688700	东威科技	2021年 6月7 日	2021年 12月 15日	新股锁定	9.41	38.46	3,049	28691.09	117264.54		-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本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

本基金是一只混合型的证券投资基金，其长期平均预期风险和预期收益率低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。本基金投资的金融工具主要包括股票、债券及权证等。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，将风险控制可在承受的范围之内。

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。（上年度末：同）。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

于本报告期末，除附注中列示的卖出回购金融资产款将在一个月以内到期且计息（该利息金额

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理,通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限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发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%,本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票,不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

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

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

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

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	57,917,528.97	-	-	-	57,917,528.97
结算备付金	958,470.85	-	-	-	958,470.85
存出保证金	148,659.48	-	-	-	148,659.48
交易性金融资产	-	-	-	-427,907,777.90	427,907,777.90
应收利息	-	-	-	6,519.68	6,519.68
应收申购款	-	-	-	196,000.38	196,000.38
应收证券清算款	-	-	-	4,266,830.44	4,266,830.44
资产总计	59,024,659.30	-	-	-432,377,128.40	491,401,787.70
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,742,344.44	1,742,344.44
应付管理人报酬	-	-	-	574,038.20	574,038.20
应付托管费	-	-	-	95,673.05	95,673.05
应付证券清算款	-	-	-	6,501,837.00	6,501,837.00
应付交易费用	-	-	-	1,547,468.70	1,547,468.70
其他负债	-	-	-	86,298.13	86,298.13
负债总计	-	-	-	10,547,659.52	10,547,659.52
利率敏感度缺口	59,024,659.30	-	-	-421,829,468.88	480,854,128.18
上年度末 2020年12月31日					
资产					
银行存款	61,552,269.48	-	-	-	61,552,269.48
结算备付金	650,638.57	-	-	-	650,638.57
存出保证金	168,997.91	-	-	-	168,997.91
交易性金融资产	-	-	-	-436,618,601.84	436,618,601.84
应收利息	-	-	-	6,268.36	6,268.36
应收申购款	1,532.70	-	-	162,806.15	164,338.85

应收证券清算款	-	-	-	1,589,430.83	1,589,430.83
资产总计	62,373,438.66	-	-	-438,377,107.18	500,750,545.84
负债					
应付赎回款	-	-	-	3,089,092.54	3,089,092.54
应付管理人报酬	-	-	-	584,228.15	584,228.15
应付托管费	-	-	-	97,371.36	97,371.36
应付交易费用	-	-	-	1,147,233.39	1,147,233.39
应交税费	-	-	-	0.49	0.49
其他负债	-	-	-	178,637.22	178,637.22
负债总计	-	-	-	5,096,563.15	5,096,563.15
利率敏感度缺口	62,373,438.66	-	-	-433,280,544.03	495,653,982.69

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金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股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，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，做出资产配置及组合构建的决定；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。本基金的股票投资比例为基金资产的 60%-

95%，其中投资于新兴产业相关股票的比例不低于股票资产的 80%；权证的投资比例占基金资产的 0%-3%；现金、债券资产及中国证监会允许基金投资的其他证券品种的比例占基金资产的 5%-40%，其中现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	427,907,777.90	88.99	436,618,601.84	88.09
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	427,907,777.90	88.99	436,618,601.84	88.09

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%	29,815,235.18	27,620,456.97
	2. 业绩比较基准下降 5%	-29,815,235.18	-27,620,456.97

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于本报告期末，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 425,766,099.19 元，属于第二层次的余额为 2,141,678.71 元，无属于第三层次的余额(上年末：第一层次 431,025,885.31 元，第二层次 5,592,716.53 元，无第三层次)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会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将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于本报告期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(上年末：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例
----	----	----	-----------

			(%)
1	权益投资	427,907,777.90	87.08
	其中：股票	427,907,777.90	87.08
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	58,875,999.82	11.98
8	其他各项资产	4,618,009.98	0.94
9	合计	491,401,787.70	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	11,290.28	0.00
B	采矿业	6,780,121.00	1.41
C	制造业	351,175,672.62	73.03
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,358.39	0.00
E	建筑业	25,371.37	0.01
F	批发和零售业	95,577.58	0.02
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,587,364.13	0.75
J	金融业	8,045,973.90	1.67
K	房地产业	773,012.50	0.16
L	租赁和商务服务业	17,512,805.00	3.64
M	科学研究和技术服务业	38,251,496.80	7.95
N	水利、环境和公共设施管理业	78,934.33	0.02
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,561,800.00	0.32
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	427,907,777.90	88.99

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	300750	宁德时代	74,600	39,896,080.00	8.30
2	600519	贵州茅台	12,920	26,572,564.00	5.53
3	688202	美迪西	39,714	20,647,308.60	4.29
4	000858	五粮液	69,200	20,613,988.00	4.29
5	601012	隆基股份	229,453	20,384,604.52	4.24
6	300014	亿纬锂能	155,606	16,172,131.58	3.36
7	000568	泸州老窖	61,236	14,448,021.84	3.00
8	300705	九典制药	374,200	14,238,310.00	2.96
9	300035	中科电气	506,800	12,391,260.00	2.58
10	300759	康龙化成	55,100	11,956,149.00	2.49
11	002241	歌尔股份	261,100	11,159,414.00	2.32
12	601888	中国中免	36,300	10,893,630.00	2.27
13	300363	博腾股份	118,844	9,997,157.28	2.08
14	002812	恩捷股份	42,400	9,925,840.00	2.06
15	603486	科沃斯	38,500	8,781,080.00	1.83
16	000012	南玻 A	843,400	8,636,416.00	1.80
17	300059	东方财富	244,320	8,011,252.80	1.67
18	600438	通威股份	178,700	7,732,349.00	1.61
19	603456	九洲药业	157,788	7,665,341.04	1.59
20	002709	天赐材料	64,300	6,853,094.00	1.43
21	601699	潞安环能	574,100	6,780,121.00	1.41
22	600809	山西汾酒	15,100	6,764,800.00	1.41
23	002127	南极电商	677,500	6,619,175.00	1.38
24	603876	鼎胜新材	202,481	6,287,035.05	1.31
25	002271	东方雨虹	111,500	6,168,180.00	1.28
26	603738	泰晶科技	172,600	5,958,152.00	1.24
27	000596	古井贡酒	22,117	5,297,021.50	1.10
28	603259	药明康德	31,140	4,876,212.60	1.01
29	601633	长城汽车	108,300	4,720,797.00	0.98
30	688389	普门科技	151,790	4,653,881.40	0.97
31	002139	拓邦股份	229,400	4,126,906.00	0.86
32	002180	纳思达	127,400	4,102,280.00	0.85
33	300171	东富龙	99,900	4,060,935.00	0.84

34	002821	凯莱英	10,800	4,024,080.00	0.84
35	000739	普洛药业	132,200	3,886,680.00	0.81
36	300751	迈为股份	8,100	3,683,070.00	0.77
37	600600	青岛啤酒	31,100	3,596,715.00	0.75
38	688308	欧科亿	50,777	3,441,157.29	0.72
39	002460	赣锋锂业	27,700	3,354,193.00	0.70
40	600436	片仔癀	6,400	2,869,120.00	0.60
41	605268	王力安防	204,101	2,816,593.80	0.59
42	300073	当升科技	49,600	2,787,024.00	0.58
43	300653	正海生物	34,800	2,724,840.00	0.57
44	002624	完美世界	112,050	2,679,115.50	0.56
45	300763	锦浪科技	14,110	2,548,266.00	0.53
46	300274	阳光电源	21,100	2,427,766.00	0.50
47	600587	新华医疗	99,900	2,262,735.00	0.47
48	002414	高德红外	80,300	2,214,674.00	0.46
49	300910	瑞丰新材	19,400	2,028,270.00	0.42
50	600577	精达股份	300,000	1,914,000.00	0.40
51	300327	中颖电子	22,200	1,892,106.00	0.39
52	300604	长川科技	24,500	1,671,145.00	0.35
53	688626	翔宇医疗	13,564	1,639,073.76	0.34
54	688314	康拓医疗	15,470	1,634,250.80	0.34
55	300725	药石科技	10,140	1,611,347.40	0.34
56	600763	通策医疗	3,800	1,561,800.00	0.32
57	002156	通富微电	58,200	1,399,128.00	0.29
58	000799	酒鬼酒	5,200	1,329,120.00	0.28
59	600702	舍得酒业	5,700	1,218,546.00	0.25
60	601567	三星医疗	55,700	1,186,410.00	0.25
61	002968	新大正	17,750	773,012.50	0.16
62	688083	中望软件	1,238	683,747.40	0.14
63	688131	皓元医药	1,955	676,801.45	0.14
64	002407	多氟多	13,800	490,452.00	0.10
65	688329	艾隆科技	8,446	453,129.84	0.09
66	688690	纳微科技	3,477	408,547.50	0.08
67	300122	智飞生物	1,900	354,787.00	0.07
68	688630	芯碁微装	3,397	198,452.74	0.04
69	688613	奥精医疗	2,617	166,179.50	0.03
70	688700	东威科技	3,049	117,264.54	0.02
71	688575	亚辉龙	3,435	110,229.15	0.02
72	688201	信安世纪	2,129	96,677.89	0.02
73	688621	阳光诺和	1,485	95,025.15	0.02
74	688109	品茗股份	1,301	93,802.10	0.02
75	300919	中伟股份	515	83,945.00	0.02

76	300957	贝泰妮	318	80,123.28	0.02
77	688696	极米科技	90	74,880.00	0.02
78	301018	申菱环境	7,811	64,753.19	0.01
79	688239	航宇科技	4,926	56,550.48	0.01
80	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.01
81	688195	腾景科技	2,693	53,509.91	0.01
82	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.01
83	688683	莱尔科技	3,296	48,550.08	0.01
84	300979	华利集团	546	47,775.00	0.01
85	300894	火星人	628	42,704.00	0.01
86	300973	立高食品	360	41,655.60	0.01
87	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.01
88	688565	力源科技	2,464	34,496.00	0.01
89	688067	爱威科技	1,259	31,260.97	0.01
90	300981	中红医疗	335	30,280.65	0.01
91	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.01
92	300953	震裕科技	240	23,964.00	0.00
93	001207	联科科技	682	22,581.02	0.00
94	301015	百洋医药	462	17,939.46	0.00
95	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
96	300925	法本信息	600	15,774.00	0.00
97	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00
98	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.00
99	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
100	300940	南极光	307	13,317.66	0.00
101	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
102	300937	药易购	244	13,105.24	0.00
103	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00
104	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
105	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.00
106	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
107	300918	南山智尚	1,063	11,065.83	0.00
108	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
109	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
110	300996	普联软件	241	10,177.43	0.00
111	300922	天秦装备	287	9,996.21	0.00
112	300956	英力股份	371	9,571.80	0.00
113	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
114	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
115	301016	雷尔伟	275	9,069.50	0.00
116	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
117	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00

118	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
119	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
120	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
121	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
122	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
123	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
124	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
125	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
126	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
127	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
128	300993	玉马遮阳	410	7,908.90	0.00
129	300930	屹通新材	322	7,882.56	0.00
130	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00
131	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
132	301004	嘉益股份	312	6,845.28	0.00
133	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
134	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
135	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
136	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
137	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
138	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
139	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
140	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
141	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
142	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
143	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
144	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
145	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
146	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
147	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
148	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	000568	泸州老窖	20,820,246.00	4.20
2	000858	五粮液	20,275,712.00	4.09
3	600809	山西汾酒	19,652,461.00	3.96
4	688202	美迪西	18,542,299.19	3.74
5	601012	隆基股份	17,452,574.00	3.52
6	603456	九洲药业	15,373,804.46	3.10

7	300750	宁德时代	13,401,641.00	2.70
8	002709	天赐材料	12,989,573.80	2.62
9	300705	九典制药	12,915,703.00	2.61
10	002304	洋河股份	12,789,208.00	2.58
11	002821	凯莱英	12,600,670.00	2.54
12	300014	亿纬锂能	12,491,063.00	2.52
13	300122	智飞生物	12,275,488.21	2.48
14	601699	潞安环能	12,236,605.96	2.47
15	300035	中科电气	11,528,890.00	2.33
16	300171	东富龙	11,124,717.00	2.24
17	002241	歌尔股份	10,962,860.00	2.21
18	600036	招商银行	10,677,170.00	2.15
19	000596	古井贡酒	10,453,771.33	2.11
20	300363	博腾股份	9,868,292.22	1.99

注：买入金额不包括相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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	000858	五粮液	43,299,582.57	8.74
2	000568	泸州老窖	39,110,594.89	7.89
3	300014	亿纬锂能	36,762,995.09	7.42
4	002304	洋河股份	30,014,854.44	6.06
5	601888	中国中免	28,201,724.70	5.69
6	600809	山西汾酒	26,471,573.26	5.34
7	002475	立讯精密	22,806,612.20	4.60
8	601100	恒立液压	21,030,303.17	4.24
9	000661	长春高新	15,402,283.96	3.11
10	002555	三七互娱	13,440,587.92	2.71
11	603678	火炬电子	13,422,447.45	2.71
12	300122	智飞生物	12,601,196.00	2.54
13	600519	贵州茅台	10,845,244.00	2.19
14	600036	招商银行	10,633,210.95	2.15
15	603198	迎驾贡酒	9,941,540.32	2.01
16	002821	凯莱英	9,930,816.00	2.00
17	300171	东富龙	9,525,591.00	1.92
18	002384	东山精密	8,781,758.10	1.77
19	002968	新大正	8,774,552.60	1.77
20	002709	天赐材料	8,638,555.30	1.74

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	571,842,421.25
卖出股票收入（成交）总额	614,127,588.69

注：买入股票成本、卖出股票收入均不包括相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金未投资股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金未投资国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金未投资国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

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。

7.12.2

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	148,659.48
2	应收证券清算款	4,266,830.44
3	应收股利	-
4	应收利息	6,519.68
5	应收申购款	196,000.38
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,618,009.98

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 (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 (%)
14,232	9,962.95	1,098,128.59	0.77	140,694,644.86	99.23

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	66,646.37	0.0470

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
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 (2010 年 12 月 7 日) 基金份额总额	3,632,789,229.65
本报告期期初基金份额总额	154,888,649.97
本报告期基金总申购份额	12,548,238.33
减：本报告期基金总赎回份额	25,644,114.85
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	141,792,773.45

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、基金管理人的重大人事变动

本报告期内，基金管理人无重大人事变动。

2、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金资产和基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未发生变更。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，管理人、托管人及其高级管理人员未有受到稽查或处罚的情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
招商证券	2	228,498,985.88	19.40%	208,230.90	19.35%	-

安信证券	1	220,912,390.93	18.76%	205,733.66	19.11%	-
国泰君安	2	203,978,832.34	17.32%	187,051.84	17.38%	-
天风证券	2	126,586,716.39	10.75%	116,533.64	10.83%	-
中金国际	1	51,418,820.29	4.37%	47,886.12	4.45%	-
西部证券	1	49,122,863.47	4.17%	34,941.30	3.25%	-
申万宏源	3	46,052,478.52	3.91%	42,889.15	3.98%	-
东方证券	2	41,105,208.08	3.49%	38,281.30	3.56%	-
信达证券	1	34,454,482.89	2.93%	32,087.30	2.98%	-
东吴证券	1	30,129,277.03	2.56%	28,059.50	2.61%	-
中信证券	2	28,020,130.20	2.38%	26,096.80	2.42%	-
国金证券	1	27,983,433.90	2.38%	26,061.29	2.42%	-
东莞证券	1	25,913,628.12	2.20%	23,615.38	2.19%	-
太平洋证 券	2	17,324,474.61	1.47%	15,868.63	1.47%	-
银河证券	1	15,598,221.23	1.32%	14,526.98	1.35%	-
国信证券	1	10,778,382.51	0.92%	10,037.96	0.93%	-
海通证券	1	10,499,078.00	0.89%	9,778.06	0.91%	-
开源证券	1	6,122,321.63	0.52%	5,579.35	0.52%	-
长江证券	1	3,355,085.49	0.28%	3,125.39	0.29%	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
广州证券	1	-	-	-	-	-

宏信证券	2	-	-	-	-	-
红塔证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华金证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	2	-	-	-	-	-
华信证券	1	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
金元证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
日信证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
申港证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源 西部	1	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
中航证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
中金财富	1	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-

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： 资质雄厚，信誉良好，注册资本不少于 5 亿元人民币；财务状况良好，各

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

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

2. 本基金本报告期券商交易单元新增：宏信证券、东莞证券、申港证券、湘财证券。

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
招商证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
中金国际	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-

东北证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
宏信证券	-	-	-	-	-	-
红塔证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
华信证券	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-
金元证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
日信证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
申港证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源 西部	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中金财富	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-

注：本基金本报告期内未租用证券公司交易单元进行其它证券投资。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华宝新兴产业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
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
4	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
5	华宝新兴产业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
6	华宝新兴产业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
7	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
8	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
9	华宝基金关于旗下部分开放式基金新增华鑫证券为代销机构的公告	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	2021-5-27
10	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
11	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
12	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

无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

基金管理人于 2019 年 6 月 22 日发布《华宝基金管理有限公司关于旗下部分基金可投资科创板股票的公告》，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；
华宝新兴产业混合型证券投资基金基金合同；
华宝新兴产业混合型证券投资基金招募说明书；
华宝新兴产业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办公场所备投资者查阅。

12.3 查阅方式

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

华宝基金管理有限公司

2021 年 8 月 27 日