华宝标普中国A股红利机会指数证券投资基金(LOF)
2021年中期报告

2021年6月30日

基金管理人：华宝基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

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。

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

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

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

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自2021年1月1日起至6月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录 2

1.1 重要提示 2
1.2 目录 3

§2 基金简介 5

2.1 基金基本情况 5
2.2 基金产品说明 5
2.3 基金管理人和基金托管人 6
2.4 信息披露方式 7
2.5 其他相关资料 7

§3 主要财务指标和基金净值表现 7

3.1 主要会计数据和财务指标 7
3.2 基金净值表现 8
3.3 其他指标 10

§4 管理人报告 11

4.1 基金管理人及基金经理情况 11
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 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 14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 16
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 16

§5 托管人报告 16

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 16
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 16
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 16

§6 半年度财务会计报告（未经审计） 16

6.1 资产负债表 16
6.2 利润表 18
6.3 所有者权益（基金净值）变动表 19
6.4 报表附注 20

§7 投资组合报告 51

7.1 期末基金资产组合情况 51
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 52
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 53
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 58
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 59

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..... 59
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..... 59
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..... 60
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..... 60
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明..... 60
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明..... 60
7.12 投资组合报告附注..... 60

§8 基金份额持有人信息 62

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构..... 62
8.2 期末上市基金前十名持有人..... 62
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况..... 63
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况..... 63

§9 开放式基金份额变动 63

§10 重大事件揭示 64

10.1 基金份额持有人大会决议..... 64
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..... 64
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼..... 64
10.4 基金投资策略的改变..... 64
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况..... 64
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..... 64
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况..... 64
10.8 其他重大事件..... 66

§11 影响投资者决策的其他重要信息 68

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 68
11.2 影响投资者决策的其他重要信息..... 68

§12 备查文件目录 68

12.1 备查文件目录..... 68
12.2 存放地点..... 69
12.3 查阅方式..... 69

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华宝标普中国A股红利机会指数证券投资基金(LOF)	
基金简称	华宝标普中国A股红利机会指数(LOF)	
场内简称	红利基金	
基金主代码	501029	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017年1月18日	
基金管理人	华宝基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	928,679,519.38份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所	
上市日期	2017年2月13日	
下属分级基金的基金简称	红利基金LOF	华宝红利基金C
下属分级基金的场内简称	红利基金LOF	-
下属分级基金的交易代码	501029	005125
报告期末下属分级基金的份额总额	906,532,239.62份	22,147,279.76份

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。在正常情况下，本基金力争将基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值控制在0.35%以内，年跟踪误差控制在4%以内。
投资策略	本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好的跟踪标的指数，实现基金投资目标。

	1、组合复制策略 本基金主要采取复制法，即按照标的指数成份股及其权重构建基金的股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动对股票投资组合进行相应地调整。 2、替代性策略 对于出现市场流动性不足、因法律法规原因个别成份股被限制投资等情况，导致本基金无法获得足够数量的股票时，基金管理人将通过投资成份股、非成份股、成份股个股衍生品等进行替代。 3、债券投资策略 本基金基于流动性管理及策略性投资的需要，将投资于国债、金融债等期限在一年期以下的债券，债券投资的目的是保证基金资产流动性，有效利用基金资产，提高基金资产的投资收益。 4、资产支持证券投资策略 本基金本着风险可控和优化组合风险收益的原则，将投资于资产支持证券产品，以期获得稳定的收益。本基金综合考虑信用等级、债券期限结构、分散化投资、行业分布等因素，制定相应的资产支持证券投资计划。 5、股指期货、权证等金融衍生工具投资策略 在法律法规许可的前提下，本基金可基于谨慎原则运用权证、股指期货等相关金融衍生工具对基金投资组合进行管理，以提高投资效率，管理基金投资组合风险水平，降低跟踪误差，以更好地实现本基金的投资目标。 本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本。 本基金在权证投资中将对权证标的证券的基本面进行研究，结合期权定价模型和我国证券市场的交易制度估计权证价值，主要考虑运用的策略包括：杠杆策略、价值挖掘策略、获利保护策略、价差策略、双向权证策略、卖空有保护的认购权证策略、买入保护性的认沽权证策略等。
业绩比较基准	标普中国A股红利机会指数收益率×95%+同期银行活期存款利率（税后）×5%。
风险收益特征	本基金为股票型基金，预期风险与预期收益水平高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数基金，跟踪标的指数的表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华宝基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	周雷	许俊
	联系电话	021-38505888	010-66594319
	电子邮箱	xxpl@fsfund.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-700-5588、400-820-5050、021-38924558	95566
传真		021-38505777	010-66594942

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

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司、基金管理人	北京市西城区太平桥大街17号，中国（上海）自由贸易试验区世纪大道100号上海环球金融中心58楼

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1期间数据和指标	报告期(2021年1月1日-2021年6月30日)	
	红利基金	华宝红利基金C
本期已实现收益	54,522,401.29	1,264,175.42
本期利润	80,087,481.57	1,857,959.28
加权平均基金份额本期利润	0.0830	0.0783
本期加权平均净值利润率	7.19%	6.88%
本期基金份额净值增长率	7.49%	7.28%
3.1.2期末数据和	报告期末(2021年6月30日)	

指标		
期末可供分配利润	162,528,128.58	3,567,606.76
期末可供分配基金份额利润	0.1793	0.1611
期末基金资产净值	1,069,060,368.20	25,714,886.52
期末基金份额净值	1.1793	1.1611
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	21.23%	10.26%

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

红利基金

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	-1.09%	0.48%	-3.08%	0.48%	1.99%	0.00%
过去三个月	0.35%	0.57%	-2.79%	0.59%	3.14%	-0.02%
过去六个月	7.49%	0.80%	3.75%	0.82%	3.74%	-0.02%
过去一年	20.44%	1.01%	11.33%	1.03%	9.11%	-0.02%

过去三年	22.54%	1.16%	4.11%	1.17%	18.43%	-0.01%
自基金合同生效起至今	21.23%	1.05%	1.00%	1.06%	20.23%	-0.01%

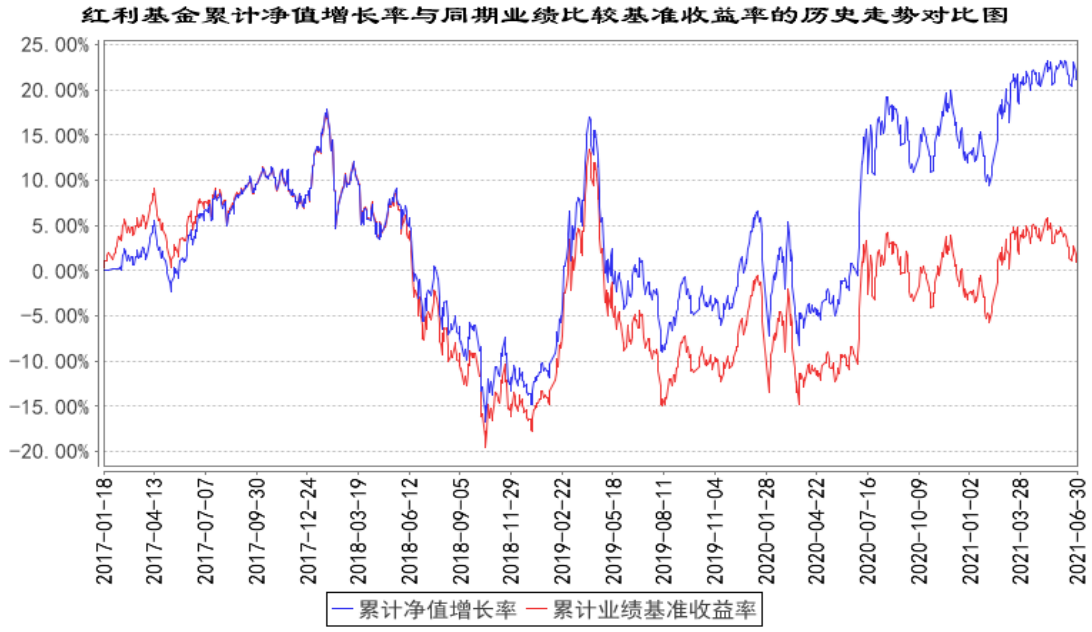
华宝红利基金C

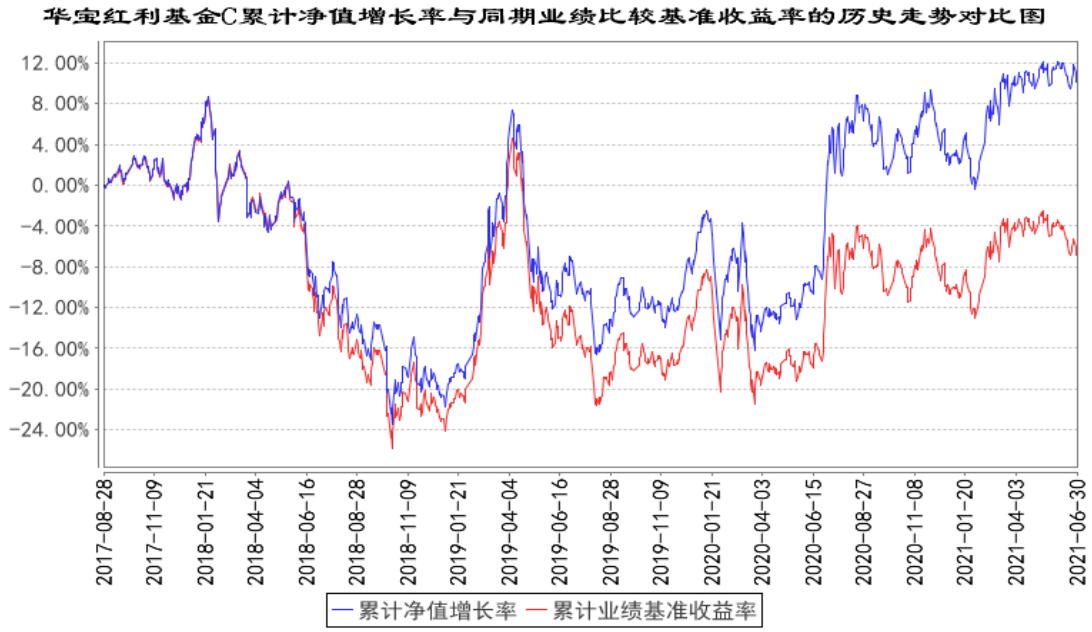
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	-1.12%	0.48%	-3.08%	0.48%	1.96%	0.00%
过去三个月	0.25%	0.57%	-2.79%	0.59%	3.04%	-0.02%
过去六个月	7.28%	0.80%	3.75%	0.82%	3.53%	-0.02%
过去一年	19.95%	1.01%	11.33%	1.03%	8.62%	-0.02%
过去三年	21.07%	1.16%	4.11%	1.17%	16.96%	-0.01%
自基金合同生效起至今	10.26%	1.10%	-6.87%	1.12%	17.13%	-0.02%

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：标普中国A股红利机会指数收益率*95%+同期银行活期存款利率(税后)*5%。

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：1、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 7 月 18 日，本基金已达到合同规定的资产配置比例。

2、华宝红利基金 C 的累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图的数据的计算起始日期为 2017 年 8 月 30 日(以实际份额确认日为准)。

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		

张奇	本基金的基金经理	2021 年 3月8日	-	10年	硕士。曾任毕博管理咨询有限公司业务顾问，德邦证券股份有限公司量化投资部投资经理、董事副总经理。2014年10月加入华宝基金管理有限公司，先后担任量化投资部、指数研发投资部高级数量分析师、基金经理助理等职务，现任指数研发投资部基金经理。2020年6月起任华宝红利精选混合型证券投资基金基金经理。2021年3月起任华宝标普中国A股红利机会指数证券投资基金(LOF)、华宝标普中国A股质量价值指数证券投资基金(LOF)基金经理。
胡洁	本基金基金经理、指数研发投资部总经理	2017 年 1 月 18 日	-	14年	硕士。2006年6月加入华宝基金管理有限公司，先后在交易部、产品开发部和量化投资部工作，现任指数研发投资部总经理。2012年10月至2019年1月任上证180成长交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2012年10月至2018年11月任华宝上证180成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2015年6月至2018年8月任华宝中证1000指数分级证券投资基金基金经理。2015年5月至2021年1月任华宝中证医疗指数分级证券投资基金基金经理。2021年1月至2021年5月任华宝中证医疗指数证券投资基金基金经理。2021年5月起任华宝中证医疗交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2016年8月起任华宝中证军工交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2017年1月起任华宝标普中国A股红利机会指数证券投资基金(LOF)基金经理。2017年7月起任华宝中证银行交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2018年11月起任华宝中证银行交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2019年1月至2021年3月任华宝标普中国A股质量价值指数证券投资基金（LOF）基金经理。2019年5月起任华宝中证医疗交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2019年7月起任华宝中证科技龙头交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2019年8月起任华宝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基金经理。2019年12月起任华宝中证消费龙头指数证券投

					资基金（LOF）基金经理。2021年3月起任华宝中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金、华宝中证全指证券公司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。2021年6月起任华宝中证科创创业50交易型开放式指数证券投资基金基金经理。
单宽之	本基金的基金经理助理	2020年11月23日	2021年3月8日	5年	硕士。曾任前海金融控股有限公司持牌金融事业部投资经理助理。2019年1月加入华宝基金华宝基金管理有限公司，先后担任养老金部分析师、量化投资部高级分析师、指数研发投资部高级分析师。2020年11月任华宝中证军工交易型开放式指数证券投资基金基金经理助理。2020年11月至2021年3月任华宝标普中国A股质量价值指数证券投资基金（LOF）、华宝标普中国A股质量价值指数证券投资基金（LOF）基金经理助理。2021年3月起任华宝中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金、华宝中证全指证券公司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助理。

注：1、任职日期以及离任日期均以基金公告为准。

2、证券从业含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《华宝标普中国A股红利机会指数证券投资基金（LOF）基金合同》和其他相关法律法规的规定、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋取最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，基金管理人通过严格执行投资决策委员会议事规则、公司股票库管理制度、中央交易室制度、防火墙机制、系统中的公平交易程序、每日交易日结报告、定期基金投资绩效评价等机制，确保所管理的所有投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投

资管理活动和环节得到公平对待。同时，基金管理人严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定和公司内部制度要求，分析了本公司旗下所有投资组合之间的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异以及连续四个季度期间内、不同时间窗下同向交易的交易价差；分析结果未发现异常情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

本报告期内，本基金未发现异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2021年上半年，全球经济共振复苏是主基调，在疫苗接种加速推进、各国相继推出大规模刺激性财政和货币政策等诸多因素的带动下，上半年全球经济总体恢复势头良好。今年作为“十四五”的开局之年，随着“十四五”规划的正式编制和落地，政策方向逐步明朗，有望注入新的动力。

市场方面，在新能源、新材料等主题板块的带领下，市场环境整体向好。上半年的行情大致可以分为三段，春节前以“茅20”为代表的白马股表现非常强势，春节后市场出现了短暂而强烈的风格切换，白马股集体出现回调，而以钢铁为代表的周期型价值股则表现强势。二季度，新能源、新材料等概念板块逐渐成为带领市场上涨的主要动力，市场风格再次向成长股切换。本报告期中，作为大盘蓝筹股代表的中证100指数和沪深300指数分别下跌了2.85%和上涨了0.24%；而作为成长股代表的中证1000指数和创业板指数分别上涨了6.58%和17.22%。标普A股红利机会指数在本报告期内上涨了3.92%。

本报告期本基金为正常运作期，我们在操作中严格遵守基金合同，坚持既定的指数化投资策略，在指数权重调整和基金申赎变动时，应用指数复制和数量化技术降低冲击成本和减少跟踪误差。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金份额A净值增长率为7.49%；本报告期基金份额C净值增长率为7.28%；同期业绩比较基准收益率为3.75%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观经济与市场方面，展望2021年下半年，全球经济复苏的态势或将延续，但与此同时全球范围内的疫情反复仍不容忽视。国内货币政策“稳中趋松”，消费与投资支撑经济的韧性仍在，科技创新和消费升级仍然是国内经济关注的焦点。证券市场方面，目前市场整体稳中向好，但波动在增加，板块之间的分化较为明显，未来结构性行情或将延续。与此同时，高股息资产在2019年以来的结构性牛市行情中已经沉寂了2年，目前估值水平依然在历史底部，安全边际很高，其中不乏盈利能力稳健，基本面优质的上市公司。对于稳健型投资者，可以关注高分红资产的左侧配置价值。

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，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在华宝标普中国A股红利机会指数证券投资基金(LOF)（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华宝标普中国A股红利机会指数证券投资基金(LOF)

报告截止日：2021年6月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	69,973,251.69	127,160,315.67
结算备付金		-	-
存出保证金		140,274.61	138,275.74
交易性金融资产	6.4.7.2	1,031,610,242.22	1,151,874,167.67
其中：股票投资		1,031,610,242.22	1,151,874,167.67
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		-	685,589.87
应收利息	6.4.7.5	49,396.75	58,275.44
应收股利		398,115.60	7,150.00
应收申购款		371,638.39	581,857.06
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,102,542,919.26	1,280,505,631.45
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		2,209,357.08	-
应付赎回款		2,885,549.63	58,250,474.79
应付管理人报酬		688,778.65	836,521.05
应付托管费		137,755.75	167,304.22
应付销售服务费		8,599.67	8,734.45
应付交易费用	6.4.7.7	1,617,633.11	2,029,986.62
应交税费		3,465.23	4,740.22
应付利息		-	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	216,525.42	629,782.38
负债合计		7,767,664.54	61,927,543.73
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	928,679,519.38	1,111,031,572.57
未分配利润	6.4.7.10	166,095,735.34	107,546,515.15
所有者权益合计		1,094,775,254.72	1,218,578,087.72
负债和所有者权益总计		1,102,542,919.26	1,280,505,631.45

注： 报告截止日2021年06月30日,基金份额总额928,679,519.38份，其中红利基金基金份额总额906,532,239.62份，基金份额净值1.1793元。华宝红利基金C基金份额总额22,147,279.76份，基金份额净值1.1611元;

6.2 利润表

会计主体：华宝标普中国A股红利机会指数证券投资基金(LOF)

本报告期：2021年1月1日至2021年6月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 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
一、收入		89,024,609.64	-51,073,467.50
1.利息收入		495,910.19	386,725.44
其中：存款利息收入	6.4.7.11	135,764.43	327,470.81
债券利息收入		-	951.04
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		360,145.76	58,303.59
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		62,134,683.86	65,898,488.25
其中：股票投资收益	6.4.7.12	33,905,435.82	22,899,192.66
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	297,024.26
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	28,229,248.04	42,702,271.33
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列）	6.4.7.17	26,158,864.14	-118,198,708.36

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	235,151.45	840,027.17
减：二、费用		7,079,168.79	12,309,600.23
1．管理人报酬	6.4.10.2.1	4,240,349.03	6,692,357.03
2．托管费	6.4.10.2.2	848,069.90	1,338,471.33
3．销售服务费	6.4.10.2.3	53,493.97	46,833.91
4．交易费用	6.4.7.19	1,715,876.91	3,939,917.54
5．利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6．税金及附加		1,296.76	213.37
7．其他费用	6.4.7.20	220,082.22	291,807.05
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		81,945,440.85	-63,383,067.73
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		81,945,440.85	-63,383,067.73

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华宝标普中国A股红利机会指数证券投资基金(LOF)

本报告期：2021年1月1日至2021年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	1,111,031,572.57	107,546,515.15	1,218,578,087.72
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	81,945,440.85	81,945,440.85
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-182,352,053.19	-23,396,220.66	-205,748,273.85
其中：1.基金申购款	131,837,745.02	20,701,565.57	152,539,310.59
2.基金赎回款	-314,189,798.21	-44,097,786.23	-358,287,584.44

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)	928,679,519.38	166,095,735.34	1,094,775,254.72
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)	2,290,117,933.89	4,664,179.71	2,294,782,113.60
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-63,383,067.73	-63,383,067.73
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）	-712,073,329.25	25,649,775.88	-686,423,553.37
其中：1.基金申购款	220,083,155.12	-6,999,551.16	213,083,603.96
2.基金赎回款	-932,156,484.37	32,649,327.04	-899,507,157.33
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	1,578,044,604.64	-33,069,112.14	1,544,975,492.50

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署：

黄小薏	向辉	张幸骏
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华宝标普中国A股红利机会指数证券投资基金(LOF)(原名为华宝兴业标普中国A股红利机会指数证券投资基金(LOF)，以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2016]第1215号《关于准予华宝兴业标普中国A股红利机会指数证券投资基金(LOF)注册的批复》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《华宝兴业标普中国A股红利机会指数证券投资基金(LOF)基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币402,189,544.09元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2017)第035号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华宝兴业标普中国A股红利机会指数证券投资基金(LOF)基金合同》于2017年1月18日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为402,321,190.70份基金份额，其中认购资金利息折合131,646.61份基金份额。本基金的基金管理人为华宝基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2017]34号核准，本基金213,425,151.00份基金份额于2017年2月13日在上交所挂牌交易。基金份额持有人通过场外销售机构持有的基金份额，需转托管至上交所场内后即可上市流通。

根据《华宝兴业基金管理有限公司关于华宝兴业标普中国A股红利机会指数证券投资基金(LOF)增加C类基金份额并修改基金合同的公告》及更新后的《华宝兴业标普中国A股红利机会指数证券投资基金(LOF)基金合同》，自2017年8月28日起，本基金增设C类基金份额。本基金根据销售服务费及申购费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者申购时收取申购费且不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为A类基金份额；在投资者申购时不收取申购费但从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为C类基金份额。A类基金份额和C类基金份额分别设置代码，分别计算并公布基金份额净值和基金份额累计净值。投资人可自行选择申购的基金份额类别。投资人可通过场内、场外两种渠道申购与赎回A类基金份额；可通过场外渠道申购与赎回C类基金份额。A类基金份额参与上市交易，C类基金份额不参与上市交易。

根据《华宝基金管理有限公司关于旗下基金更名事宜的公告》，华宝兴业标普中国A股红利机会指数证券投资基金(LOF)于2017年12月30日起更名为华宝标普中国A股红利机会指数证券投资基金(LOF)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华宝标普中国A股红利机会指数证券投资基金(LOF)基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板和其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、资产支持证券、权证、股指期货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)。本基金投资于股票的比例不低于基金资产的90%，投资于标普中国A股红利机会指数成份股及其备选成份股的市值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，应保持不低于基金资产净值5%的现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或到期日在一年以内的政府债券。本基金的业绩比较基准为：标普中国A股红利机会指数收益率×95%+同期银行活期存款利率(税后)×5%。

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

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则－基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华宝标普中国A股红利机会指数证券投资基金(LOF)基金合同》和在财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于2021年6月30日的财务状况以及2021年上半年度的经营成果和净值变动情况。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[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	69,973,251.69
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	69,973,251.69

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		1,009,776,366.31	1,031,610,242.22	21,833,875.91
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		1,009,776,366.31	1,031,610,242.22	21,833,875.91

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	6,775.39
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	-
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	0.90
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	42,557.36
其他	63.10
合计	49,396.75

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	1,617,633.11
银行间市场应付交易费用	-
合计	1,617,633.11

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	4,482.26
应付证券出借违约金	-
预提费用	89,260.15
应付指数使用费	113,075.98
应付数据使用费	9,707.03
合计	216,525.42

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

红利基金

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	1,087,642,574.85	1,087,642,574.85
本期申购	123,439,713.11	123,439,713.11
本期赎回（以“-”号填列）	-304,550,048.34	-304,550,048.34
-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	906,532,239.62	906,532,239.62

华宝红利基金C

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	23,388,997.72	23,388,997.72
本期申购	8,398,031.91	8,398,031.91
本期赎回（以“-”号填列）	-9,639,749.87	-9,639,749.87
-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	22,147,279.76	22,147,279.76

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

红利基金

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	178,453,394.87	-72,832,312.16	105,621,082.71
本期利润	54,522,401.29	25,565,080.28	80,087,481.57
本期基金份额交易产生的变动数	-32,623,996.07	9,443,560.37	-23,180,435.70
其中：基金申购款	22,296,503.57	-2,761,277.84	19,535,225.73
基金赎回款	-54,920,499.64	12,204,838.21	-42,715,661.43
本期已分配利润	-	-	-

本期末	200,351,800.09	-37,823,671.51	162,528,128.58

华宝红利基金C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	3,490,913.41	-1,565,480.97	1,925,432.44
本期利润	1,264,175.42	593,783.86	1,857,959.28
本期基金份额交易产生的变动数	-257,039.68	41,254.72	-215,784.96
其中：基金申购款	1,374,742.37	-208,402.53	1,166,339.84
基金赎回款	-1,631,782.05	249,657.25	-1,382,124.80
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,498,049.15	-930,442.39	3,567,606.76

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	129,005.47
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	5,408.49
其他	1,350.47
合计	135,764.43

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	33,905,435.82
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	33,905,435.82

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	621,747,048.68
减：卖出股票成本总额	587,841,612.86
买卖股票差价收入	33,905,435.82

6.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

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

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

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

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

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	28,229,248.04
其中：证券出借权益补偿收入	1,744,585.52

基金投资产生的股利收益	-
合计	28,229,248.04

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	26,158,864.14
股票投资	26,158,864.14
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	26,158,864.14

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	234,553.42
基金转换费收入	598.03
合计	235,151.45

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%归入基金财产。

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，其中转出基金的赎回费不低于25%的部分归入转出基金的基金财产。

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	1,715,876.91
银行间市场交易费用	-
合计	1,715,876.91

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	29,752.78

信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	8,039.06
指数使用费	122,783.01
合计	220,082.22

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、C类基金份额注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	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
宝山钢铁股份有限公司(“宝钢股份”)	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	1,743,406.11	0.17	-	-

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期内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

本基金本报告期内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

本基金本报告期内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（%）
华宝证券	1,588.76	0.16	1,588.76	0.10
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（%）
-	-	-	-	-

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	4,240,349.03	6,692,357.03
其中：支付销售机构的客户维护费	1,338,002.55	2,091,892.92

注：支付基金管理人华宝基金的管理人报酬按前一日基金资产净值0.75%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 × 0.75% / 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	848,069.90	1,338,471.33

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费＝前一日基金资产净值 × 0.15% / 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	红利基金	华宝红利基金C	合计
华宝证券	-	1.97	1.97
华宝基金	-	36,564.28	36,564.28
合计	-	36,566.25	36,566.25
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	红利基金	华宝红利基金C	合计
华宝基金	-	28,648.57	28,648.57
华宝证券	-	4.35	4.35
合计	-	28,652.92	28,652.92

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值 0.40%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给华宝基金，再由华宝基金计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

日销售服务费＝前一日 C 类基金份额基金资产净值× 0.40% /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

单位：人民币元

本期 2021年1月1日至2021年6月30日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
华宝证券	909,598.00	17.2	909,290.00	17.2
上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
-	-	-	-	-

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

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

红利基金

关联方名称	本期 2021年6月30日		上年度末 2020年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例 （%）	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例（%）
交通银行股份有限公司－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）	-	-	1,206,913.00	0.1100

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
中国银行股份有限公司	69,973,251.69	129,005.47	92,225,037.04	313,344.15

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本期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	新股锁定	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02	-

			日							
300919	中伟股份	2020年12月15日	2021年7月2日	新股锁定	24.6	163	610	15,006.00	99,430.00	-
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1月13日	2021年7月21日	新股锁定	13.11	24.48	322	4,221.42	7,882.56	-
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	2,896.32	8,809.92	-
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	3,747.44	11,609.28	-
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	2,989.00	13,105.24	-
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	3,917.32	13,317.66	-
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	2,352.33	12,634.36	-
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	2,496.45	5,867.55	-
300945	曼卡	2021	2021	新股锁	4.56	18.88	474	2,161.44	8,949.12	-

	龙	年2月3日	年8月10日	定						
300948	冠中生态	2021年2月18日	2021年8月25日	新股锁定	13	27.42	324	2,808.00	8,884.08	-
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	1,841.79	8,569.47	-
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	3,984.80	9,207.20	-
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	6,904.80	23,964.00	-
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	3,834.96	10,688.24	-
300956	英力股份	2021年3月16日	2021年9月27日	新股锁定	12.85	25.8	371	4,767.35	9,571.80	-
300957	贝泰妮	2021年3月18日	2021年9月27日	新股锁定	47.33	251.96	837	39,615.21	210,890.52	-
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	2,559.00	8,166.00	-
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	2,826.72	5,396.04	-
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	3,341.12	8,695.58	-
300962	中金辐照	2021年3月	2021年10	新股锁定	3.4	16.37	576	1,958.40	9,429.12	-

		29日	月11日							
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	3,432.79	6,364.67	-
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	2,356.64	9,020.44	-
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	2,301.78	5,850.78	-
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	7,982.94	14,025.34	-
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	4,468.80	6,931.05	-
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	3,091.70	5,439.50	-
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	10,180.80	41,655.60	-
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	2,696.16	6,410.76	-
300978	东箭科技	2021年4月15日	2021年10月26日	新股锁定	8.42	13.6	593	4,993.06	8,064.80	-
300979	华利集团	2021年4月15日	2021年10月26日	新股锁定	33.22	87.5	925	30,728.50	80,937.50	-
300981	中红医疗	2021年4月	2021年10	新股锁定	48.59	90.39	601	29,202.59	54,324.39	-

		19日	月27日							
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	295	7,345.50	7,318.95	-
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	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	2021年12	新股锁定	18.71	57.62	201	3,760.71	11,581.62	-

		27日	月7日							
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6月9日	2021年12月20日	新股锁定	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	-
301011	华立科技	2021年6月9日	2021年12月17日	新股锁定	14.2	33.84	175	2,485.00	5,922.00	-
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	1,368.50	4,124.20	-
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	3,529.68	17,939.46	-
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	3,781.25	9,069.50	-
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	44,255.70	44,255.70	-
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	7,029	58,270.41	58,270.41	-
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	24,681.14	24,681.14	-
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	8,358.39	8,358.39	-
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	11,014.44	11,014.44	-

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	54,219.24	54,219.24	-
688109	品茗股份	2021年3月22日	2021年9月30日	新股锁定	50.05	72.1	1,301	65,115.05	93,802.10	-
688183	生益电子	2021年2月10日	2021年8月25日	新股锁定	12.42	14.19	18,394	228,453.48	261,010.86	-
688195	腾景科技	2021年3月18日	2021年9月27日	新股锁定	13.6	19.87	2,693	36,624.80	53,509.91	-
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	17,289.06	17,289.06	-
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	56,550.48	56,550.48	-
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	31,031.26	92,373.84	-
688517	金冠电气	2021年6月10日	2021年12月20日	新股锁定	7.71	11.88	2,892	22,297.32	34,356.96	-
688597	煜邦电力	2021年6月9日	2021年12月17日	新股锁定	5.88	10.16	3,907	22,973.16	39,695.12	-
688601	力芯微	2021年6月18日	2021年12月28日	新股锁定	36.48	133.69	1,174	42,827.52	156,952.06	-
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	51,736.31	198,452.74	-
688660	电气风电	2021年5月11日	2021年11月19日	新股锁定	5.44	7.26	51,238	278,734.72	371,987.88	-

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	31,344.96	48,550.08	-
688685	迈信林	2021年4月30日	2021年11月15日	新股锁定	9.02	19.5	2,612	23,560.24	50,934.00	-
688690	纳微科技	2021年6月16日	2021年12月23日	新股锁定	8.07	79.89	3,477	28,059.39	277,777.53	
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	4,917.30	4,917.30	
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	782	6,482.78	6,482.78	
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	2,743.40	2,743.40	

注：1. 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。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后6个月内不得转让。

2. 根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于6个月的限售期。

3. 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。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	出借到期日	期末估值单价	数量（单位：股）	期末估值总额
1	000090	天健集团	2021年7月2日-2021年7月9日	5.53	506,100	2,798,733.00
2	000402	金融街	2021年7月5日-2021年7月16日	6.75	353,000	2,382,750.00
3	000537	广宇发展	2021年7月9日	5.23	282,000	1,474,860.00
4	000581	威孚高科	2021年7月7日-2021年7月13日	20.83	84,800	1,766,384.00
5	000656	金科股份	2021年7月2日-2021年7月14日	5.79	33,700	195,123.00
6	000672	上峰水泥	2021年7月1日	17.48	102,000	1,782,960.00
7	000778	新兴铸管	2021年7月6日-2021年7月16日	3.72	429,400	1,597,368.00
8	000789	万年青	2021年7月1日-2021年7月13日	11.44	192,800	2,205,632.00
9	000830	鲁西化工	2021年7月9日	18.73	103,000	1,929,190.00
10	001696	宗申动力	2021年7月7日-2021年7月14日	7.98	225,000	1,795,500.00
11	001979	招商蛇口	2021年7月2日	10.95	15,600	170,820.00
12	002110	三钢闽光	2021年7月1日-2021年7月12日	6.74	245,400	1,653,996.00
13	002146	荣盛发	2021年7月2日-2021	5.64	470,200	2,651,928

		展	年7月14日			.00
14	002233	塔牌集团	2021年7月2日-2021年7月16日	10.28	156,500	1,608,820.00
15	002293	罗莱生活	2021年7月2日-2021年7月12日	13.39	156,000	2,088,840.00
16	002299	圣农发展	2021年7月6日-2021年7月16日	23.88	15,700	374,916.00
17	002440	闰土股份	2021年7月6日-2021年7月16日	8.85	22,500	199,125.00
18	002601	龙佰集团	2021年7月1日-2021年7月9日	34.58	30,000	1,037,400.00
19	600048	保利地产	2021年7月2日-2021年7月14日	12.04	56,500	680,260.00
20	600057	厦门象屿	2021年7月7日-2021年7月12日	6.25	257,900	1,611,875.00
21	600064	南京高科	2021年7月1日-2021年7月6日	9.29	204,300	1,897,947.00
22	600188	兖州煤业	2021年7月1日-2021年7月16日	15.36	263,400	4,045,824.00
23	600282	南钢股份	2021年7月2日-2021年7月13日	3.56	835,600	2,974,736.00
24	600295	鄂尔多斯	2021年7月1日-2021年7月14日	17.89	157,900	2,824,831.00
25	600325	华发股份	2021年7月1日-2021年7月20日	6.74	461,900	3,113,206.00
26	600340	华夏幸福	2021年7月1日-2021年7月2日	5.24	148,700	779,188.00
27	600348	华阳股份	2021年7月6日-2021年7月8日	7.42	319,500	2,370,690.00
28	600373	中文传媒	2021年7月1日	9.86	201,800	1,989,748.00
29	600376	首开股份	2021年7月5日-2021年7月7日	5.60	106,600	596,960.00
30	600383	金地集团	2021年7月2日-2021年7月14日	10.24	144,700	1,481,728.00
31	600395	盘江股份	2021年7月6日-2021年7月14日	7.10	283,300	2,011,430.00
32	600466	蓝光发展	2021年7月2日-2021年7月14日	2.95	477,800	1,409,510.00
33	600566	济川药业	2021年7月2日-2021年7月16日	17.90	117,900	2,110,410.00
34	600606	绿地控股	2021年7月2日-2021年7月14日	5.45	306,100	1,668,245.00
35	600642	申能股	2021年7月2日	6.14	234,000	1,436,760

		份				.00
36	600663	陆家嘴	2021年7月14日	13.32	179,600	2,392,272.00
37	600704	物产中大	2021年7月1日-2021年7月14日	7.87	605,800	4,767,646.00
38	600720	祁连山	2021年7月2日	10.54	132,000	1,391,280.00
39	600782	新钢股份	2021年7月5日-2021年7月8日	5.58	274,000	1,528,920.00
40	600790	轻纺城	2021年7月2日	3.05	482,000	1,470,100.00
41	600801	华新水泥	2021年7月2日-2021年7月6日	17.57	82,800	1,454,796.00
42	600823	世茂股份	2021年7月1日-2021年7月5日	4.04	544,400	2,199,376.00
43	600863	内蒙华电	2021年7月6日-2021年7月16日	2.33	261,600	609,528.00
44	600900	长江电力	2021年7月5日	20.64	10,000	206,400.00
45	600901	江苏租赁	2021年7月6日-2021年7月16日	5.20	16,500	85,800.00
46	600970	中材国际	2021年7月9日-2021年7月14日	9.17	184,000	1,687,280.00
47	600971	恒源煤电	2021年7月1日-2021年7月16日	6.65	464,700	3,090,255.00
48	600997	开滦股份	2021年7月2日-2021年7月14日	7.50	189,000	1,417,500.00
49	601003	柳钢股份	2021年7月2日-2021年7月15日	5.90	555,300	3,276,270.00
50	601006	大秦铁路	2021年7月2日	6.58	47,800	314,524.00
51	601155	新城控股	2021年7月1日	41.60	10,000	416,000.00
52	601225	陕西煤业	2021年7月13日	11.85	1,400	16,590.00
53	601229	上海银行	2021年7月6日	8.20	10,000	82,000.00
54	601838	成都银行	2021年7月6日-2021年7月8日	12.64	106,000	1,339,840.00
55	603858	步长制药	2021年7月1日-2021年7月16日	22.49	90,800	2,042,092.00
合计	-	-	-	-	12,249,300	90,506,162.00

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为指数型基金，采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好的跟踪标的指数，跟踪标普中国A股红利机会指数。本基金为股票型基金，预期风险与预期收益水平高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现与跟踪指数相同的风险收益目标。

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

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款均存放于大型股份制商业银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均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，本基金以约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过该方式向证券公司出借证券，本基金的基金管理人对借券证券公司的偿付能力等进行了必要的尽职调查与严格的准入管理，对不同的借券证券公司实施交易额度管理并进行动态调整，且借券证券公司最近1年的分类结果为A类，违约风险可能性很小。

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)。

6.4.13.2.1 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

无

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无

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时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

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

券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

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

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

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

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现

金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款和存出保证金等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	69,973,251.69	-	-	-	69,973,251.69
存出保证金	140,274.61	-	-	-	140,274.61
交易性金融资产	-	-	-	1,031,610,242.22	1,031,610,242.22
应收利息	-	-	-	49,396.75	49,396.75
应收股利	-	-	-	398,115.60	398,115.60
应收申购款	4,287.82	-	-	367,350.57	371,638.39
资产总计	70,117,814.12	-	-	1,032,425,105.14	1,102,542,919.26
负债					
应付赎回款	-	-	-	2,885,549.63	2,885,549.63
应付管理人报酬	-	-	-	688,778.65	688,778.65
应付托管费	-	-	-	137,755.75	137,755.75
应付证券清算款	-	-	-	2,209,357.08	2,209,357.08
应付销售服务费	-	-	-	8,599.67	8,599.67
应付交易费用	-	-	-	1,617,633.11	1,617,633.11
应交税费	-	-	-	3,465.23	3,465.23
其他负债	-	-	-	216,525.42	216,525.42
负债总计	-	-	-	7,767,664.54	7,767,664.54
利率敏感度缺口	70,117,814.12	-	-	1,024,657,440.60	1,094,775,254.72
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	127,160,315.67	-	-	-	127,160,315.67
存出保证金	138,275.74	-	-	-	138,275.74
交易性金融资产	-	-	-	1,151,874,167.67	1,151,874,167.67
应收利息	-	-	-	58,275.44	58,275.44
应收股利	-	-	-	7,150.00	7,150.00
应收申购款	371.79	-	-	581,485.27	581,857.06
应收证券清算款	-	-	-	685,589.87	685,589.87
资产总计	127,298,963.20	-	-	1,153,206,668.25	1,280,505,631.45
负债					
应付赎回款	-	-	-	58,250,474.79	58,250,474.79
应付管理人报酬	-	-	-	836,521.05	836,521.05
应付托管费	-	-	-	167,304.22	167,304.22
应付销售服务费	-	-	-	8,734.45	8,734.45

应付交易费用	-	-	-	2,029,986.62	2,029,986.62
应交税费	-	-	-	4,740.22	4,740.22
其他负债	-	-	-	629,782.38	629,782.38
负债总计	-	-	-	61,927,543.73	61,927,543.73
利率敏感度缺口	127,298,963.20	-	-	1,091,279,124.52	1,218,578,087.72

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本报告期末，本基金未持有交易性债券投资(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。

本基金采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好的跟踪标的指数，实现基金投资目标，股票资产跟踪的标的指数为标普中国A股红利机会指数。本基金持有股票的比例不低于基金资产的90%，投资于标普中国A股红利机会指数成份股及其备选成份股的市值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，应保持不低于基金资产净值5%的现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或到期日在一年以内的政府债券。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	1,031,610,242.22	94.23	1,151,874,167.67	94.53
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	1,031,610,242.22	94.23	1,151,874,167.67	94.53

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%	53,587,184.88	60,215,189.29
	2.业绩比较基准下降5%	-53,587,184.88	-60,215,189.29

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1,028,723,523.82元，属于第二层次的余额为2,886,718.40元，无属于第三层次的余额(于上年度末：第一层次1,122,202,909.28元，第二层次29,671,258.39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(上年度末：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	1,031,610,242.22	93.57
	其中：股票	1,031,610,242.22	93.57
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	69,973,251.69	6.35
8	其他各项资产	959,425.35	0.09
9	合计	1,102,542,919.26	100.00

注：参与转融通证券出借业务出借证券的公允价值为 90,506,162.00 元，占基金资产净值的比例为 8.27%。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	16,468,863.00	1.50
B	采矿业	88,597,752.10	8.09
C	制造业	359,194,448.74	32.81
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	57,646,755.12	5.27
E	建筑业	31,360,442.00	2.86
F	批发和零售业	47,341,227.40	4.32
G	交通运输、仓储和邮政业	14,792,701.98	1.35
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	172,704,317.08	15.78
K	房地产业	160,259,292.48	14.64
L	租赁和商务服务业	19,283,190.00	1.76
M	科学研究和技术服务业	9,791,366.00	0.89
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	32,149,426.00	2.94
S	综合	18,230,904.00	1.67
	合计	1,027,820,685.90	93.88

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

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	-	-
C	制造业	2,645,895.53	0.24
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,020.39	0.00
E	建筑业	25,371.37	0.00
F	批发和零售业	95,577.58	0.01
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	140,053.74	0.01
J	金融业	34,721.10	0.00
K	房地产业	779,188.00	0.07
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	44,438.33	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	3,789,556.32	0.35

7.2.3 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

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600282	南钢股份	6,205,700	22,092,292.00	2.02
2	600704	物产中大	2,532,682	19,932,207.34	1.82
3	600603	广汇物流	4,512,600	18,230,904.00	1.67
4	600188	兖州煤业	1,142,600	17,550,336.00	1.60
5	601003	柳钢股份	2,872,500	16,947,750.00	1.55

6	600828	茂业商业	4,356,289	15,421,263.06	1.41
7	601328	交通银行	3,071,814	15,051,888.60	1.37
8	601006	大秦铁路	2,248,131	14,792,701.98	1.35
9	002534	杭锅股份	972,200	14,437,170.00	1.32
10	601088	中国神华	739,300	14,431,136.00	1.32
11	603858	步长制药	633,031	14,236,867.19	1.30
12	600348	华阳股份	1,893,400	14,049,028.00	1.28
13	600325	华发股份	2,065,100	13,918,774.00	1.27
14	002327	富安娜	1,723,102	13,336,809.48	1.22
15	603878	武进不锈	1,781,860	13,096,671.00	1.20
16	600971	恒源煤电	1,947,338	12,949,797.70	1.18
17	603365	水星家纺	899,000	12,864,690.00	1.18
18	600376	首开股份	2,284,192	12,791,475.20	1.17
19	601169	北京银行	2,582,740	12,577,943.80	1.15
20	002146	荣盛发展	2,224,001	12,543,365.64	1.15
21	600606	绿地控股	2,280,700	12,429,815.00	1.14
22	600000	浦发银行	1,234,600	12,346,000.00	1.13
23	600295	鄂尔多斯	689,300	12,331,577.00	1.13
24	600919	江苏银行	1,734,760	12,316,796.00	1.13
25	600479	千金药业	1,379,360	12,276,304.00	1.12
26	603587	地素时尚	491,600	12,245,756.00	1.12
27	601009	南京银行	1,153,600	12,135,872.00	1.11
28	600985	淮北矿业	985,100	12,028,071.00	1.10
29	600153	建发股份	1,479,970	11,987,757.00	1.09
30	600016	民生银行	2,709,523	11,948,996.43	1.09
31	000090	天健集团	2,115,900	11,700,927.00	1.07
32	601988	中国银行	3,731,000	11,491,480.00	1.05
33	002233	塔牌集团	1,105,389	11,363,398.92	1.04
34	601019	山东出版	1,975,100	11,337,074.00	1.04
35	600023	浙能电力	3,050,700	11,196,069.00	1.02
36	600970	中材国际	1,216,300	11,153,471.00	1.02
37	601288	农业银行	3,621,200	10,972,236.00	1.00
38	601928	凤凰传媒	1,526,900	10,902,066.00	1.00
39	600782	新钢股份	1,950,800	10,885,464.00	0.99
40	600566	济川药业	607,641	10,876,773.90	0.99
41	600025	华能水电	1,865,700	10,802,403.00	0.99
42	600663	陆家嘴	794,700	10,585,404.00	0.97
43	601398	工商银行	2,032,800	10,509,576.00	0.96
44	001979	招商蛇口	933,400	10,220,730.00	0.93
45	600790	轻纺城	3,328,300	10,151,315.00	0.93
46	600801	华新水泥	571,800	10,046,526.00	0.92
47	601229	上海银行	1,224,900	10,044,180.00	0.92

48	601155	新城控股	241,304	10,038,246.40	0.92
49	000830	鲁西化工	534,529	10,011,728.17	0.91
50	601939	建设银行	1,493,985	9,935,000.25	0.91
51	600642	申能股份	1,614,200	9,911,188.00	0.91
52	600373	中文传媒	1,005,100	9,910,286.00	0.91
53	000402	金 融 街	1,462,900	9,874,575.00	0.90
54	002884	凌霄泵业	421,431	9,815,127.99	0.90
55	600261	阳光照明	2,509,000	9,810,190.00	0.90
56	601818	光大银行	2,594,000	9,805,320.00	0.90
57	603017	中衡设计	933,400	9,791,366.00	0.89
58	300498	温氏股份	677,100	9,729,927.00	0.89
59	600997	开滦股份	1,291,300	9,684,750.00	0.88
60	000656	金科股份	1,653,584	9,574,251.36	0.87
61	601838	成都银行	756,700	9,564,688.00	0.87
62	600395	盘江股份	1,334,604	9,475,688.40	0.87
63	002443	金洲管道	1,483,600	9,346,680.00	0.85
64	600823	世茂股份	2,306,837	9,319,621.48	0.85
65	002540	亚太科技	1,911,650	9,309,735.50	0.85
66	600863	内蒙华电	3,977,800	9,268,274.00	0.85
67	601998	中信银行	1,812,300	9,242,730.00	0.84
68	000789	万年青	806,626	9,227,801.44	0.84
69	600057	厦门象屿	1,461,100	9,131,875.00	0.83
70	002533	金杯电工	1,752,600	9,008,364.00	0.82
71	000069	华侨城A	1,194,310	8,885,666.40	0.81
72	600027	华电国际	2,571,000	8,844,240.00	0.81
73	002293	罗莱生活	658,100	8,811,959.00	0.80
74	002394	联发股份	1,064,900	8,700,233.00	0.79
75	600170	上海建工	3,081,900	8,506,044.00	0.78
76	001696	宗申动力	1,063,900	8,489,922.00	0.78
77	000672	上峰水泥	482,400	8,432,352.00	0.77
78	600901	江苏租赁	1,603,400	8,337,680.00	0.76
79	000537	广宇发展	1,590,500	8,318,315.00	0.76
80	000581	威孚高科	395,833	8,245,201.39	0.75
81	601225	陕西煤业	684,700	8,113,695.00	0.74
82	600466	蓝光发展	2,720,000	8,024,000.00	0.73
83	600383	金地集团	774,400	7,929,856.00	0.72
84	600048	保利地产	657,100	7,911,484.00	0.72
85	000778	新兴铸管	2,126,600	7,910,952.00	0.72
86	600064	南京高科	849,700	7,893,713.00	0.72
87	600900	长江电力	369,408	7,624,581.12	0.70
88	002110	三钢闽光	1,108,729	7,472,833.46	0.68
89	002381	双箭股份	827,600	6,802,872.00	0.62

90	002299	圣农发展	282,200	6,738,936.00	0.62
91	002440	闰土股份	745,046	6,593,657.10	0.60
92	600720	祁连山	622,900	6,565,366.00	0.60
93	601166	兴业银行	312,600	6,423,930.00	0.59
94	002677	浙江美大	346,100	6,326,708.00	0.58
95	002869	金溢科技	250,550	5,933,024.00	0.54
96	002601	龙佰集团	163,590	5,656,942.20	0.52

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	600340	华夏幸福	148,700	779,188.00	0.07
2	688660	电气风电	51,238	371,987.88	0.03
3	688690	纳微科技	3,477	277,777.53	0.03
4	688183	生益电子	18,394	261,010.86	0.02
5	300957	贝泰妮	837	210,890.52	0.02
6	688630	芯碁微装	3,397	198,452.74	0.02
7	688601	力芯微	1,174	156,952.06	0.01
8	300919	中伟股份	610	99,430.00	0.01
9	688109	品茗股份	1,301	93,802.10	0.01
10	688329	艾隆科技	1,846	92,373.84	0.01
11	300979	华利集团	925	80,937.50	0.01
12	301018	申菱环境	7,811	64,753.19	0.01
13	688239	航宇科技	4,926	56,550.48	0.01
14	300981	中红医疗	601	54,324.39	0.00
15	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.00
16	688195	腾景科技	2,693	53,509.91	0.00
17	688685	迈信林	2,612	50,934.00	0.00
18	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.00
19	688683	莱尔科技	3,296	48,550.08	0.00
20	300894	火星人	628	42,704.00	0.00
21	300973	立高食品	360	41,655.60	0.00
22	688597	煜邦电力	3,907	39,695.12	0.00
23	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.00
24	688517	金冠电气	2,892	34,356.96	0.00
25	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.00
26	300953	震裕科技	240	23,964.00	0.00
27	301015	百洋医药	462	17,939.46	0.00
28	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
29	300925	法本信息	600	15,774.00	0.00
30	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00
31	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.00

32	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
33	300940	南极光	307	13,317.66	0.00
34	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
35	300937	药易购	244	13,105.24	0.00
36	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00
37	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
38	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
39	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.00
40	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
41	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
42	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
43	300996	普联软件	241	10,177.43	0.00
44	300956	英力股份	371	9,571.80	0.00
45	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
46	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
47	301016	雷尔伟	275	9,069.50	0.00
48	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
49	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
50	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
51	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
52	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
53	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
54	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
55	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
56	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
57	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
58	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
59	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
60	300993	玉马遮阳	410	7,908.90	0.00
61	300930	屹通新材	322	7,882.56	0.00
62	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00
63	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
64	301004	嘉益股份	312	6,845.28	0.00
65	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
66	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
67	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
68	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
69	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
70	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
71	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
72	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
73	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
74	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00

75	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
76	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
77	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
78	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
79	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
80	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
81	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	300498	温氏股份	14,918,688.80	1.22
2	600023	浙能电力	13,444,248.00	1.10
3	600790	轻纺城	12,892,298.62	1.06
4	600373	中文传媒	12,219,520.98	1.00
5	601928	凤凰传媒	11,780,710.55	0.97
6	002443	金洲管道	11,700,033.33	0.96
7	600170	上海建工	11,198,796.82	0.92
8	000537	广宇发展	11,098,546.00	0.91
9	600261	阳光照明	11,061,975.00	0.91
10	002540	亚太科技	10,856,966.57	0.89
11	002533	金杯电工	10,774,710.13	0.88
12	603587	地素时尚	10,733,099.00	0.88
13	000672	上峰水泥	10,589,503.00	0.87
14	600663	陆家嘴	10,574,876.09	0.87
15	600027	华电国际	10,410,439.00	0.85
16	600642	申能股份	10,362,223.50	0.85
17	600720	祁连山	9,653,442.65	0.79
18	002869	金溢科技	9,493,901.00	0.78
19	603017	中衡设计	9,474,030.80	0.78
20	600340	华夏幸福	8,040,972.70	0.66

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	000718	苏宁环球	35,002,052.08	2.87
2	688981	中芯国际	24,723,727.95	2.03
3	600188	兖州煤业	24,274,038.91	1.99
4	600019	宝钢股份	16,954,046.27	1.39

5	600681	百川能源	15,805,216.41	1.30
6	601636	旗滨集团	13,918,052.98	1.14
7	603579	荣泰健康	13,333,848.48	1.09
8	002458	益生股份	12,377,267.53	1.02
9	002601	龙佰集团	12,263,102.66	1.01
10	600741	华域汽车	11,294,714.57	0.93
11	002303	美盈森	10,987,409.00	0.90
12	603167	渤海轮渡	10,932,187.63	0.90
13	600724	宁波富达	10,761,238.91	0.88
14	600548	深高速	10,616,209.84	0.87
15	000429	粤高速A	10,032,375.69	0.82
16	600398	海澜之家	9,914,323.97	0.81
17	601886	江河集团	9,219,429.80	0.76
18	002884	凌霄泵业	9,184,719.17	0.75
19	600295	鄂尔多斯	9,106,764.19	0.75
20	600340	华夏幸福	8,510,873.82	0.70

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	441,418,823.27
卖出股票收入（成交）总额	621,747,048.68

注：买入股票成本、卖出股票收入均不包括相关交易费用。

7.5 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投资。

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	140,274.61
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	398,115.60
4	应收利息	49,396.75
5	应收申购款	371,638.39
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	959,425.35

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	600282	南钢股份	2,974,736.00	0.27	转融通流通受限
2	600704	物产中大	4,767,646.00	0.44	转融通流通受限
3	600188	兖州煤业	4,045,824.00	0.37	转融通流通受限
4	601003	柳钢股份	3,276,270.00	0.30	转融通流通受限
5	601006	大秦铁路	314,524.00	0.03	转融通流通受限

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	600340	华夏幸福	779,188.00	0.07	转融通流通受限
2	688660	电气风电	371,987.88	0.03	新股锁定
3	688690	纳微科技	277,777.53	0.03	新股锁定
4	688183	生益电子	261,010.86	0.02	新股锁定

5	300957	贝泰妮	210,890.52	0.02	新股锁定

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

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）
红利基金	75,787	11,961.58	72,330,097.53	7.98	834,202,142.09	92.02
华宝红利基金C	2,683	8,254.67	16,071,417.81	72.57	6,075,861.95	27.43
合计	78,470	11,834.84	88,401,515.34	9.52	840,278,004.04	90.48

8.2 期末上市基金前十名持有人

红利基金

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例（%）
1	中国中金财富证券有限公司转融通担保证券明细账户	13,105,773.00	4.27
2	中国国际金融股份有限公司	1,924,024.00	0.63
3	刘承杨	1,920,500.00	0.62
4	夏志军	1,710,474.00	0.56
5	郝富泉	1,683,100.00	0.55
6	周少华	1,580,500.00	0.51
7	胡云峰	1,503,298.00	0.49
8	钟漫求	1,450,000.00	0.47

9	李怀智	1,440,000.00	0.47
10	泰康人寿保险有限责任公司－分红－个人分红－019L－FH002沪	1,403,002.00	0.46

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	红利基金	520,985.88	0.0575
	华宝红利基金C	11,901.11	0.0537
	合计	532,886.99	0.0574

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	红利基金	10~50
	华宝红利基金C	-
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	红利基金	-
	华宝红利基金C	-
	合计	-

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	红利基金	华宝红利基金C
基金合同生效日（2017年1月18日）基金份额总额	402,321,190.70	-
本报告期期初基金份额总额	1,087,642,574.85	23,388,997.72
本报告期基金总申购份额	123,439,713.11	8,398,031.91
减：本报告期基金总赎回份额	304,550,048.34	9,639,749.87
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	906,532,239.62	22,147,279.76

§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，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	
中泰证券	1	294,286,452.46	27.94%	274,070.99	28.19%	-
国元证券	2	214,910,865.21	20.40%	195,848.05	20.14%	-
海通证券	2	182,831,714.22	17.36%	170,162.59	17.50%	-
方正证券	1	100,125,289.28	9.50%	91,244.50	9.39%	-
中金公司	2	39,006,494.88	3.70%	35,546.59	3.66%	-
国信证券	1	28,373,290.16	2.69%	26,423.58	2.72%	-
光大证券	2	26,562,248.97	2.52%	24,206.31	2.49%	-
东方财富	2	25,996,050.04	2.47%	24,186.32	2.49%	-
浙商证券	2	22,445,427.60	2.13%	20,710.89	2.13%	-
兴业证券	2	17,749,010.01	1.68%	16,528.32	1.70%	-
开源证券	2	17,534,158.62	1.66%	16,264.69	1.67%	-

宏信证券	2	15,843,701.37	1.50%	14,519.34	1.49%	-
长江证券	1	13,369,995.76	1.27%	12,451.47	1.28%	-
申万宏源	3	11,188,218.00	1.06%	10,419.77	1.07%	-
中信建投	1	10,404,693.78	0.99%	9,690.21	1.00%	-
华创证券	2	5,594,310.35	0.53%	5,098.14	0.52%	-
国海证券	2	5,593,558.11	0.53%	5,097.38	0.52%	-
天风证券	3	5,117,564.55	0.49%	4,663.69	0.48%	-
广发证券	2	4,995,299.26	0.47%	4,552.27	0.47%	-
招商证券	1	4,711,460.00	0.45%	4,293.54	0.44%	-
东方证券	1	4,366,704.85	0.41%	3,979.39	0.41%	-
华宝证券	1	1,743,406.11	0.17%	1,588.76	0.16%	-
国泰君安	1	374,034.69	0.04%	348.33	0.04%	-
财通证券	2	331,029.00	0.03%	308.30	0.03%	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
国金证	2	-	-	-	-	-

券						
国联证券	3	-	-	-	-	-
华金证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	2	-	-	-	-	-
太平洋证券	1	-	-	-	-	-
新时代证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
中信金通	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	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、报告期内券商交易单元新增财通证券、开源证券、民生证券、信达证券。

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

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	华宝基金关于旗下部分基金增加招商银行招赢通为销售平台并参加招商银行招赢通平台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	2021-1-9
2	华宝标普中国A股红利机会指数证券投资基金(LOF)2020年第4季度报告	基金管理人网站	2021-1-22
3	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
4	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
5	华宝基金管理有限公司华宝标普中国A股红利机会指数证券投资基金(LOF)基金经理变更公告	基金管理人网站,上海证券报	2021-3-8
6	华宝基金管理有限公司关于提示投资者完善身份信息的的公告	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
7	华宝标普中国A股红利机会指数证券投资基金（LOF）招募说明书（更新）	基金管理人网站	2021-3-10
8	华宝标普中国A股红利机会指数证券投资基金(LOF)（C类份额）基金产品资料概要（更新）	基金管理人网站	2021-3-10
9	华宝标普中国A股红利机会指数证券投资基金(LOF)（A类份额）基金产品资料概要（更新）	基金管理人网站	2021-3-10
10	华宝标普中国A股红利机会指数证券投资基金(LOF)2020年年度报告	基金管理人网站	2021-3-31
11	华宝标普中国A股红利机会指数证券投资基金(LOF)基金合同	基金管理人网站	2021-3-31
12	华宝标普中国A股红利机会指数证券投资基金（LOF）招募说明书（更新）	基金管理人网站	2021-3-31
13	华宝标普中国A股红利机会指数证券投资基金(LOF)（A类份额）基金产品资料概要（更新）	基金管理人网站	2021-3-31
14	华宝标普中国A股红利机会指数证	基金管理人网站	2021-3-31

	券投资基金(LOF)（C类份额）基金产品资料概要（更新）		
15	华宝基金管理有限公司关于旗下部分基金根据《公开募集证券投资基金运作指引第3号-指数基金指引》、《存托凭证发行与交易管理办法(试行）》修改基金合同部分条款的公告	基金管理人网站,上海证券报,证券日报,证券时报,中国证券报	2021-3-31
16	关于华宝现金宝货币基金E类份额转换、赎回转申购、定期转换、定期赎回转申购业务费率优惠公告	基金管理人网站,上海证券报,证券日报,证券时报,中国证券报	2021-4-15
17	华宝标普中国A股红利机会指数证券投资基金(LOF)2021年第1季度报告	基金管理人网站	2021-4-22
18	华宝基金关于旗下部分开放式基金新增阳光人寿为代销机构的公告	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	2021-5-14
19	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
20	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
21	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
22	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	2021-5-28
23	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
24	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
25	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

根据《公开募集证券投资基金运作指引第3号-指数基金指引》的要求，2021年3月31日，基金管理人发布关于修订旗下部分基金基金合同的公告，对基金管理人旗下34只指数基金基金合同部分条款进行相应更新，具体内容可详见相关公告，请投资者予以关注。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

中国证监会批准基金设立的文件；

华宝标普中国A股红利机会指数证券投资基金（LOF）基金合同；

华宝标普中国A股红利机会指数证券投资基金（LOF）招募说明书；

华宝标普中国A股红利机会指数证券投资基金（LOF）托管协议；

基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；

基金管理人报告期内在指定报刊上披露的各种公告；

基金托管人业务资格批件和营业执照。

12.2 存放地点

以上文件存于基金管理人及基金托管人住所备投资者查阅。

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