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
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。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国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 12

2.1 基金基本情况 12
2.2 基金产品说明 12
2.3 基金管理人和基金托管人 12
2.4 信息披露方式 12
2.5 其他相关资料 12

§3 主要财务指标和基金净值表现 12

3.1 主要会计数据和财务指标 12
3.2 基金净值表现 12
3.3 其他指标 13

§4 管理人报告 13

4.1 基金管理人及基金经理情况 13
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 13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 14
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 14

§5 托管人报告 14

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 14
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 14
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 14

§6 半年度财务会计报告（未经审计） 15

6.1 资产负债表 15
6.2 利润表 15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表 15
6.4 报表附注 15

§7 投资组合报告 24

7.1 期末基金资产组合情况 24
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 24
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 24
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 24
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 25

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..... 25
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..... 25
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..... 25
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..... 25
7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细..... 25
7.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明..... 25
7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明..... 25
7.13 投资组合报告附注..... 26

§8 基金份额持有人信息 26

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构..... 26
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况..... 26
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..... 27
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况..... 27

§9 开放式基金份额变动 27

§10 重大事件揭示 27

10.1 基金份额持有人大会决议..... 27
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..... 27
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼..... 27
10.4 基金投资策略的改变..... 27
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况..... 27
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..... 27
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况..... 27
10.8 其他重大事件..... 28

§11 影响投资者决策的其他重要信息 28

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 28
11.2 影响投资者决策的其他重要信息..... 28

§12 备查文件目录 28

12.1 备查文件目录..... 28
12.2 存放地点..... 28
12.3 查阅方式..... 28

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	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	
基金简称	华宝券商 ETF 联接	
基金主代码	006098	
基金运作方式	契约型开放式、发起式	
基金合同生效日	2018 年 6 月 27 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	3,386,339,226.61 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华宝券商 ETF 联接	华宝券商 ETF 联接 C
下属分级基金的交易代码	006098	007531
报告期末下属分级基金的份额总额	737,882,365.48 份	2,648,456,861.13 份

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	华宝中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	512000
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2016 年 8 月 30 日
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2016 年 9 月 14 日
基金管理人名称	华宝基金管理有限公司
基金托管人名称	中国建设银行股份有限公司

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要通过投资于目标 ETF，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金为 ETF 联接基金，主要通过投资于目标 ETF 实现对标的指数的紧密跟踪。本基金力争将本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.35%以内，年跟踪误差控制在 4%以内。 1、资产配置策略 本基金投资于目标 ETF 的资产比例不低于基金资产净值的 90%；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，持有现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。为更好地实现投资目标，基金还可投资于非标的指数成份股、债券、货币市场工具、股指期货、资产支持证券、权证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。 本基金将根据市场的实际情况，适当调整基金资产在各类资产上的配置比例，以保证对标的指数的有效跟踪。 2、目标 ETF 投资策略 1）投资组合的投资方式 本基金可以通过申购赎回代理券商以成份股实物形式申购及赎回目标 ETF 基金份额，也可以通过券商在二级市场上买卖目标 ETF 基金份额。本基金将根据开放日申购赎回情况、综合考虑流动性、成本、效率等因素，决定目标 ETF 的投资方式。通常情况下，本基金以申购和赎回为主：当收到净申购时，本基金构建股票组合、申购目标 ETF；当收到净赎回时，本基金赎回目标 ETF、卖出股票组合。对于股票停牌或其他原因导致基金投资组合中出现的剩余成份股，本基金将选择作为后续实物申购目标 ETF 的基础证券或者择机在二级市场卖出。本基金在二级市场上买卖目标 ETF 基金份额是出于追求基金充分投资、减少交易成本、降低跟踪误差的目的。 2）投资组合的调整 本基金将根据申购和赎回情况，结合基金的现金头寸管理，对基金投资组合进行调整，从而有效跟踪标的指数。 3、股票投资策略 本基金对于标的指数成份股和备选成份股部分的投资，采用被动式指数化投资的方法进行日常管理。针对我国证券市场新股发行制度的特点，本基金将参与一级市场新股认购。 4、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。 5、资产支持证券投资策略 在严格控制投资风险的前提下，本基金将从信用风险、流动性风险、利率风险、税收因素和提前还款因素等方面综合评估资产支持证券的投资品种，选择低估的品种进行投资。 6、股指期货投资策略 本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，以降低股票仓位调整的交易成本，提高投资效率，从而更好地跟踪标的指数，实现投资目标。 7、其他金融工具投资策略 在法律法规许可时，本基金可基于谨慎原则运用权证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，更好地实现本基金的投资目标。本基金管理人运用上述金融衍生工具必须是出于追求基金充分投资、减少交易成本、降低跟踪误差的目的，不得应用于投机交易目的，或用作杠杆工具放大基金的投资。
业绩比较基准	中证全指证券公司指数收益率×95%＋人民币银行活期存款利率（税后）×5%。
风险收益特征	本基金为 ETF 联接基金，目标 ETF 为指数型基金，本基金的预期风

	险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金，并且具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

2.2.1 目标基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
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、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	中证全指证券公司指数
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金，属于高风险、高收益的开放式基金。 本基金为被动式投资的股票型指数基金，主要采用组合复制策略，跟踪中证全指证券公司指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。

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	本基金半年报置备地点包括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)	
	华宝券商 ETF 联接	华宝券商 ETF 联接 C
本期已实现收益	9,018,824.52	11,277,346.58
本期利润	-82,521,737.06	-222,585,597.75
加权平均基金份额本期利润	-0.1228	-0.1019
本期加权平均净值利润率	-8.06%	-6.76%

本期基金份额净值增长率	-8.46%	-8.64%
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	97,193,126.14	316,663,648.87
期末可供分配基金份额利润	0.1317	0.1196
期末基金资产净值	1,138,222,893.72	4,053,192,914.67
期末基金份额净值	1.5426	1.5304
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	54.26%	21.19%

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

华宝券商 ETF 联接

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	-2.94%	1.13%	-3.06%	1.14%	0.12%	-0.01%
过去三个月	6.54%	1.51%	6.26%	1.52%	0.28%	-0.01%

过去六个月	-8.46%	1.54%	-8.97%	1.57%	0.51%	-0.03%
过去一年	9.59%	1.95%	8.38%	1.99%	1.21%	-0.04%
过去三年	54.28%	1.94%	42.28%	2.04%	12.00%	-0.10%
自基金合同生效起至今	54.26%	1.93%	45.27%	2.04%	8.99%	-0.11%

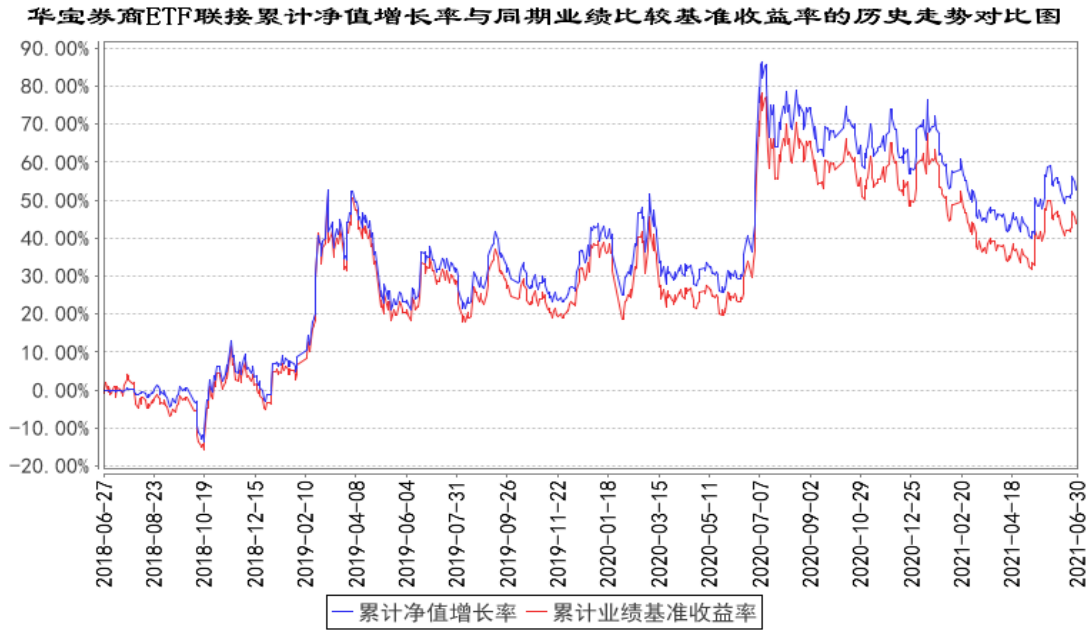
华宝券商 ETF 联接 C

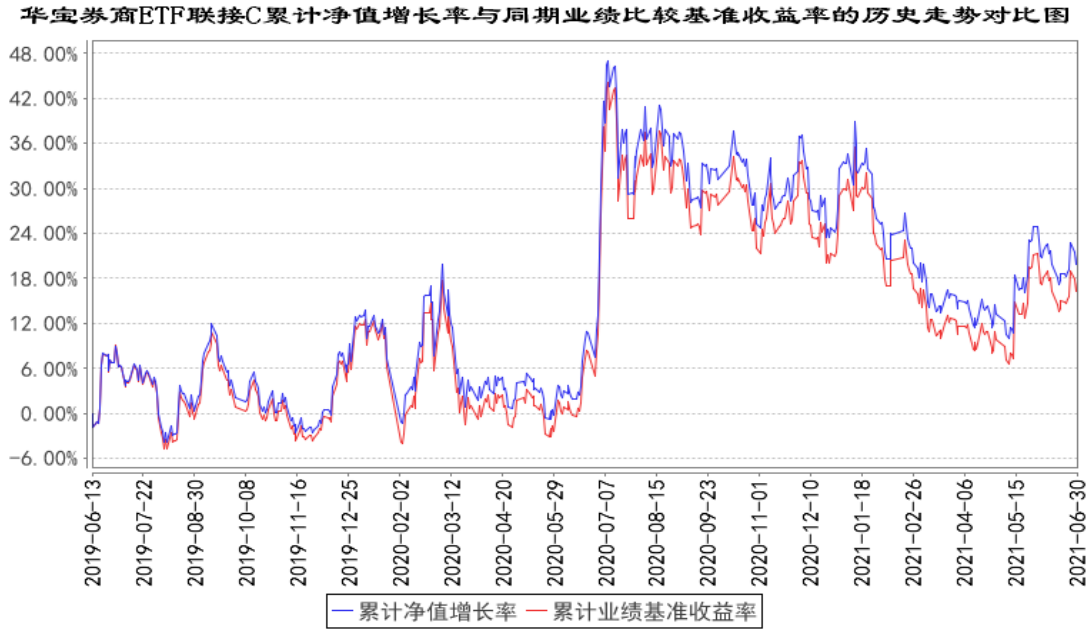
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	-2.97%	1.13%	-3.06%	1.14%	0.09%	-0.01%
过去三个月	6.43%	1.51%	6.26%	1.52%	0.17%	-0.01%
过去六个月	-8.64%	1.54%	-8.97%	1.57%	0.33%	-0.03%
过去一年	9.16%	1.95%	8.38%	1.99%	0.78%	-0.04%
自基金合同生效起至今	21.19%	1.84%	17.53%	1.89%	3.66%	-0.05%

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：中证全指证券公司指数收益率*95%+人民币银行活期存款利率(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，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。截至 2018 年 12 月 27 日，本基金已达到合同规定的资产配置比例。

2、华宝券商 ETF 联接 C 成立于 2019 年 6 月 13 日，本报告中其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 2019 年 6 月 13 日。

§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		
胡洁	本基金基	2021 年	-	14 年	硕士。2006 年 6 月加入华宝基金管理有限

	金经理、指数研发投资部总经理	3 月 8 日			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。
丰晨成	本基金基金经理	2018 年 6 月 27 日	-	11 年	硕士。2009 年加入华宝基金管理有限公司，先后担任助理产品经理、数量分析师、投资经理助理、投资经理等职务。2015 年 11 月起任上证 180 价值交易型开放式

					指数证券投资基金、华宝上证 180 价值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 月起任华宝中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2018 年 4 月至 2021 年 1 月任华宝中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金经理。2018 年 6 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发起式联接基金。2018 年 8 月至 2020 年 11 月任华宝中证 1000 指数分级证券投资基金基金经理。2020 年 11 月起任华宝中证 1000 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	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，在后疫情时代，货币政策回归正常化的预期下，对于流动性预期的拐点的时刻判断，成为左右市场风险偏好的因素，国内资本市场在春节前后出现了截然相反的走势，一月份市场人气高涨，公募基金发行火爆，募资额创新高，但春节后因货币政策收紧担忧预期，市场风险偏好迅速回落，创业板指首当其冲。4 月份开始，随着成长风格逐渐收复失地，市场 6 月下旬明显走出一波科创板创业板行情。截止半年末，沪深两市总成交额在去年“宅家牛”带来的高基数基础上继续同比增长 20%，市场热度不减，券商行业的基本面依旧景气。然而基金所跟踪的中证全指证券公司指数今年没有出现春季行情，因宏观流动性拐点到来可能传导至资本市场热度的担忧，一季度券商走势低迷，直到 5 月中旬才在成长股反弹的过程中走出一波小行情，整体看券商上半年表现在所有一级行业中排名靠后，与资本市场上半年的景气环境以及指数成分股上市公司半年报整体的优异业绩形成了鲜明的反差。一方面是整个传统行业乃至大金融板块在上半年缺少市场资金关注，机构持仓比例低；另一方面也与目前资金抱团方向在几个热门成长类赛道有关。

本报告期本基金为正常运作期，在操作中，我们遵守基金合同，按照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 净值收益率为-8.46%，本报告期基金份额 C 净值收益率为-8.64%，同期业绩比较基准收益率为-8.97%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们认为券商行业正经历行业政策环境较为有利的时期，市场化法治化国际化的政策导向逐渐明晰，深化资本市场改革开放，稳步提高直接融资比重，一系列资本市场支持实体经济发展的政策落地，政策周期向上；同时券商行业本身变革正在提速，增强自身盈利能力，居民存款搬家、外资、养老金等增配 A 股仍是长期趋势，公募财富管理业务有望成为券商未来很长一段时间的驱动力，带动其经纪、资管、机构业务线等多个方向的成长性。上半年看市场成交额的中枢已上台阶，未来不太可能因为流动性原因重回之前水平，尤其关注居民财富的再配置对于券商和基金行业发展的长期意义。券商自身经营水平的提升从海外券商发展经验的对照上看，在财富管理的差异化、投行产业链的上下游延伸、FICC 类衍生品业务的突破上，国内券商仍有巨大发展空间，而依靠券商 ETF 采用指数化投资的方式参与券商股投资不失为一种把握券商股行情机会的工具。

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，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

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	308,861,092.27	239,695,942.85
结算备付金		1,539,475.88	2,359,571.26
存出保证金		991,151.97	517,665.55
交易性金融资产	6.4.7.2	4,881,917,339.04	3,830,098,823.97
其中：股票投资		136,196,461.97	39,070,490.23
基金投资		4,745,720,877.07	3,791,028,333.74
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		-	65,708,303.74
应收利息	6.4.7.5	31,117.75	32,369.90
应收股利		-	-
应收申购款		124,130,178.10	29,313,375.17
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		5,317,470,355.01	4,167,726,052.44
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		51,732,211.29	-
应付赎回款		70,597,831.25	99,179,809.60
应付管理人报酬		111,370.76	112,226.30
应付托管费		22,274.16	22,445.26
应付销售服务费		1,190,785.46	817,318.14
应付交易费用	6.4.7.7	2,275,408.82	1,589,534.85

应交税费		-	1,023,241.87
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	124,664.88	212,569.64
负债合计		126,054,546.62	102,957,145.66
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	3,386,339,226.61	2,422,744,518.24
未分配利润	6.4.7.10	1,805,076,581.78	1,642,024,388.54
所有者权益合计		5,191,415,808.39	4,064,768,906.78
负债和所有者权益总计		5,317,470,355.01	4,167,726,052.44

注： 报告截止日 2021 年 06 月 30 日,基金份额总额 3,386,339,226.61 份，其中华宝券商 ETF 联接基金份额总额 737,882,365.48 份，基金份额净值 1.5426 元。华宝券商 ETF 联接 C 基金份额总额 2,648,456,861.13 份，基金份额净值 1.5304 元;

6.2 利润表

会计主体：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

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		-295,246,473.47	67,292,843.92
1.利息收入		575,474.02	338,599.19
其中：存款利息收入	6.4.7.11	575,474.02	338,599.19
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）		27,544,307.30	10,418,515.18
其中：股票投资收益	6.4.7.12	2,048,226.25	-2,641,636.58
基金投资收益	6.4.7.13	25,493,406.03	13,053,003.76
债券投资收益	6.4.7.14	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.14.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-	-
股利收益	6.4.7.17	2,675.02	7,148.00

3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-325,403,505.91	54,949,886.85
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	2,037,251.12	1,585,842.70
减：二、费用		9,860,861.34	2,408,729.02
1．管理人报酬	6.4.10.2.1	651,199.00	187,681.13
2．托管费	6.4.10.2.2	130,239.82	37,536.29
3．销售服务费	6.4.10.2.3	6,562,163.28	1,192,735.58
4．交易费用	6.4.7.20	2,209,850.53	869,119.33
5．利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6．税金及附加		202,985.36	46,990.81
7．其他费用	6.4.7.21	104,423.35	74,665.88
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-305,107,334.81	64,884,114.90
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-305,107,334.81	64,884,114.90

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：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

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）	2,422,744,518.24	1,642,024,388.54	4,064,768,906.78
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-305,107,334.81	-305,107,334.81
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）	963,594,708.37	468,159,528.05	1,431,754,236.42
其中：1.基金申购款	4,859,966,937.53	2,620,199,976.85	7,480,166,914.38
2.基金赎	-3,896,372,229.16	-2,152,040,448.80	-6,048,412,677.96

回款			
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	3,386,339,226.61	1,805,076,581.78	5,191,415,808.39
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）	297,421,079.78	125,257,246.44	422,678,326.22
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	64,884,114.90	64,884,114.90
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）	821,323,971.35	261,773,975.62	1,083,097,946.97
其中：1.基金申购款	2,471,399,001.51	847,724,768.59	3,319,123,770.10
2.基金赎回款	-1,650,075,030.16	-585,950,792.97	-2,236,025,823.13
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）	1,118,745,051.13	451,915,336.96	1,570,660,388.09

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(以下简称“本基金”)系由基金管理人华宝基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《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合同》(以下简称“基金合同”)及其他有关法律法规的规定，经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)以证监许可[2018]912 号文批准公开募集。本基金为契约开放式、发起式，存续期限为不定期，首次设立募集基金份额为 10,656,959.56 份，经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)验证，并出具了编号为德师报(验)字(18)第 00006 号的验资报告。基金合同于 2018 年 6 月 27 日正式生效。本基金的基金管理人为华宝基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《华宝基金管理有限公司关于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合同》，自 2019 年 6 月 13 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。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、截至报告期末最新公告的基金合同及《华宝兴业中证银行交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金主要投资于目标 ETF 基金份额、标的指数成份股、备选成份股。本基金还可投资于国内依法发行上市的非标的指数成份股(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、债券回购、货币市场工具、股指期货、资产支持证券、权证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)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：本基金投资于目标 ETF 的资产比例不低于基金资产净值的 90%。本基金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，持有现金(不包括结算备付

金、存出保证金、应收申购款等)或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。股指期货的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准为：本基金的业绩比较基准为：中证全指证券公司指数收益率×95%+人民币银行活期存款利率(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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

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	308,861,092.27
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	308,861,092.27

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		135,172,761.00	136,196,461.97	1,023,700.97
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		4,793,165,073.16	4,745,720,877.07	-47,444,196.09
其他		-	-	-
合计		4,928,337,834.16	4,881,917,339.04	-46,420,495.12

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	29,978.95

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	692.80
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	446.00
合计	31,117.75

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	2,275,408.82
银行间市场应付交易费用	-
合计	2,275,408.82

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	20,526.53
应付证券出借违约金	-
预提费用	104,138.35
合计	124,664.88

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

华宝券商 ETF 联接

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	619,731,567.46	619,731,567.46
本期申购	628,355,132.97	628,355,132.97
本期赎回（以“-”号填列）	-510,204,334.95	-510,204,334.95
-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	737,882,365.48	737,882,365.48

华宝券商 ETF 联接 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	1,803,012,950.78	1,803,012,950.78
本期申购	4,231,611,804.56	4,231,611,804.56
本期赎回（以“-”号填列）	-3,386,167,894.21	-3,386,167,894.21
-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	2,648,456,861.13	2,648,456,861.13

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

华宝券商 ETF 联接

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	71,003,762.89	353,625,610.16	424,629,373.05
本期利润	9,018,824.52	-91,540,561.58	-82,521,737.06
本期基金份额交易产生的变动数	17,170,538.73	41,062,353.52	58,232,892.25
其中：基金申购款	85,850,958.12	268,254,600.33	354,105,558.45
基金赎回款	-68,680,419.39	-227,192,246.81	-295,872,666.20
本期已分配利润	-	-	-
本期末	97,193,126.14	303,147,402.10	400,340,528.24

华宝券商 ETF 联接 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	190,233,493.89	1,027,161,521.60	1,217,395,015.49
本期利润	11,277,346.58	-233,862,944.33	-222,585,597.75
本期基金份额交易产生的变动数	115,152,808.40	294,773,827.40	409,926,635.80
其中：基金申	532,823,612.75	1,733,270,805.65	2,266,094,418.40

购款			
基金赎回款	-417,670,804.35	-1,438,496,978.25	-1,856,167,782.60
本期已分配利润	-	-	-
本期末	316,663,648.87	1,088,072,404.67	1,404,736,053.54

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	518,757.07
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	43,895.59
其他	12,821.36
合计	575,474.02

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	1,183,801.45
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	864,424.80
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	2,048,226.25

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	44,894,998.24
减：卖出股票成本总额	43,711,196.79
买卖股票差价收入	1,183,801.45

6.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.12.4 股票投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
申购基金份额总额	2,747,621,100.00
减：现金支付申购款总额	915,205,910.66
减：申购股票成本总额	1,831,550,764.54
申购差价收入	864,424.80

6.4.7.12.5 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期内无股票投资收益-证券出借差价收入。

6.4.7.13 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
卖出/赎回基金成交总额	1,526,532,409.96
减：卖出/赎回基金成本总额	1,501,039,003.93
基金投资收益	25,493,406.03

注：卖出基金成本总额含卖出基金差价收入应缴纳增值税额 1671.30 元。

6.4.7.14 债券投资收益

6.4.7.14.1 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。

6.4.7.14.2 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。

6.4.7.14.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.14.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.14.5 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。

6.4.7.15 贵金属投资收益

6.4.7.15.1 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。

6.4.7.15.2 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。

6.4.7.15.3 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。

6.4.7.15.4 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。

6.4.7.16 衍生工具收益

6.4.7.16.1 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。

6.4.7.16.2 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。

6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	2,675.02
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	2,675.02

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	-325,403,505.91
股票投资	-1,351,241.79
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-324,052,264.12
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	-325,403,505.91

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	2,027,981.18
基金转换费收入	9,269.94
合计	2,037,251.12

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。

6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	2,103,875.72
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	105,974.81
其中：申购费	35,850.94
赎回费	-
交易费	70,123.87
合计	2,209,850.53

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
审计费用	44,630.98
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	285.00
合计	104,423.35

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
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
华宝中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金(“目标 ETF”)	本基金的基金管理人管理的其他基金

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	579,385,443.49	28.70	154,216,178.87	19.17

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 基金交易

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	占当期基金成交总额的比例（%）	成交金额	占当期基金成交总额的比例（%）
华宝证券	254,856,099.46	16.35	197,814,801.40	33.91

6.4.10.1.5 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。

6.4.10.1.6 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	539,582.62	28.70	539,582.62	23.71
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	143,621.94	19.17	24,928.85	4.28

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	651,199.00	187,681.13
其中：支付销售机构的客户维护费	4,202,401.09	996,693.88

注：支付基金管理人华宝基金的基金管理人报酬按前一日基金资产净值扣除所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产净值后的余额的 0.50%年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：日基金管理人报酬=MAX(前一日的基金资产净值扣除前一日所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产净值×0.50%÷当年天数，0)。

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	130,239.82	37,536.29

注：支付基金托管人中国建设银行的基金托管费按前一日基金资产净值扣除所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产净值后的余额的 0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：日基金托管费=MAX(前一日的基金资产净值扣除前一日所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产净值×0.10%÷当年天数，0)。

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

	华宝券商 ETF 联接	华宝券商 ETF 联接 C	合计
华宝证券	-	355.13	355.13
华宝基金	-	312,672.89	312,672.89
合计	-	313,028.02	313,028.02
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		
	华宝券商 ETF 联接	华宝券商 ETF 联接 C	合计
华宝基金	-	64,551.65	64,551.65
华宝证券	-	235.15	235.15
合计	-	64,786.80	64,786.80

注：支付基金销售机构的基金销售服务费按前一日基金资产净值的约定年费率计提，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。C 类基金份额持有人约定的年基金销售服务费率为 0.40%。其计算公式为：

日基金销售服务费＝前一日基金资产净值×约定年费率 / 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

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固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
	华宝券商 ETF 联接	华宝券商 ETF 联接 C
基金合同生效日（ 2018 年 6 月 27 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	10,000,450.05	-
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	10,000,450.05	-

额		
报告期末持有的基金份额	0.00	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%	-
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
	华宝券商 ETF 联接	华宝券商 ETF 联接 C
基金合同生效日（ 2018 年 6 月 27 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	10,000,450.05	-
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	10,000,450.05	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	2.57%	-

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

本报告期末及上年度末除基金管理人外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	308,861,092.27	518,757.07	89,031,840.66	310,995.59

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

于本报告期末，本基金持有 4,471,189,822.00 份目标 ETF 基金份额，占其份额的比例为

19.90%（上年度末，本基金持有 3,244,354,586.00 份目标 ETF 基金份额，占其总份额的比例为 16.51%）。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末(2021 年 6 月 30 日)本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末持有的证券中无因新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本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因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为 ETF 联接基金，主要通过投资于目标 ETF 以达到投资目标，属于较高风险品种。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，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)。

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

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

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金和存出保证金等。

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	308,861,092.27	-	-	-	308,861,092.27
结算备付金	1,539,475.88	-	-	-	1,539,475.88
存出保证金	991,151.97	-	-	-	991,151.97
交易性金融资产	-	-	-	4,881,917,339.04	4,881,917,339.04
应收利息	-	-	-	31,117.75	31,117.75
应收申购款	-	-	-	124,130,178.10	124,130,178.10
资产总计	311,391,720.12	-	-	5,006,078,634.89	5,317,470,355.01
负债					

应付赎回款	-	-	-	70,597,831.25	70,597,831.25
应付管理人报酬	-	-	-	111,370.76	111,370.76
应付托管费	-	-	-	22,274.16	22,274.16
应付证券清算款	-	-	-	51,732,211.29	51,732,211.29
应付销售服务费	-	-	-	1,190,785.46	1,190,785.46
应付交易费用	-	-	-	2,275,408.82	2,275,408.82
其他负债	-	-	-	124,664.88	124,664.88
负债总计	-	-	-	126,054,546.62	126,054,546.62
利率敏感度缺口	311,391,720.12	-	-	4,880,024,088.27	5,191,415,808.39
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	239,695,942.85	-	-	-	239,695,942.85
结算备付金	2,359,571.26	-	-	-	2,359,571.26
存出保证金	517,665.55	-	-	-	517,665.55
交易性金融资产	-	-	-	3,830,098,823.97	3,830,098,823.97
应收利息	-	-	-	32,369.90	32,369.90
应收申购款	223,326.76	-	-	29,090,048.41	29,313,375.17
应收证券清算款	-	-	-	65,708,303.74	65,708,303.74
资产总计	242,796,506.42	-	-	3,924,929,546.02	4,167,726,052.44
负债					
应付赎回款	-	-	-	99,179,809.60	99,179,809.60
应付管理人报酬	-	-	-	112,226.30	112,226.30
应付托管费	-	-	-	22,445.26	22,445.26
应付销售服务费	-	-	-	817,318.14	817,318.14
应付交易费用	-	-	-	1,589,534.85	1,589,534.85
应交税费	-	-	-	1,023,241.87	1,023,241.87
其他负债	-	-	-	212,569.64	212,569.64
负债总计	-	-	-	102,957,145.66	102,957,145.66
利率敏感度缺口	242,796,506.42	-	-	3,821,972,400.36	4,064,768,906.78

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标的 ETF、备选成分股和债券，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。

本基金采用被动式指数化投资，主要通过投资目标 ETF、标的指数成份股和备选成份股达到跟踪指数的目标。本基金投资于目标 ETF 的资产比例不低于该基金资产净值的 90%，本基金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，持有现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。同时为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于新股、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，该部分资产比例不高于基金资产净值的 10%。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	136,196,461.97	2.62	39,070,490.23	0.96
交易性金融资产－基金投资	4,745,720,877.07	91.41	3,791,028,333.74	93.27
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	4,881,917,339.04	94.04	3,830,098,823.97	94.23

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%	181,391,106.00	197,000,650.97
	2.业绩比较基准下降 5%	-181,391,106.00	-197,000,650.97

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)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。

(b)以公允价值计量的金融工具

(i)各层次金融工具公允价值

于本报告期末，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为人民币 4,881,917,339.04 元，无属于第二、第三层次的余额。(上年度末：第一层次 3,830,098,823.97 元，无第二层次或第三层次)。

(ii)公允价值所属层次间的重大变动

对于本基金投资的证券，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，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间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，确定相关证券公允价值应属第二层次或第三层次。

(iii) 第三层次公允价值计量的金融工具

无。

(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	136,196,461.97	2.56
	其中：股票	136,196,461.97	2.56
2	基金投资	4,745,720,877.07	89.25
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	310,400,568.15	5.84
8	其他各项资产	125,152,447.82	2.35
9	合计	5,317,470,355.01	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	-	-
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
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	-	-
J	金融业	136,196,461.97	2.62
K	房地产业	-	-
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	-	-
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	136,196,461.97	2.62

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	300059	东方财富	644,400	21,129,876.00	0.41
2	600030	中信证券	683,000	17,034,020.00	0.33
3	600837	海通证券	768,930	8,842,695.00	0.17
4	601688	华泰证券	420,000	6,636,000.00	0.13
5	601211	国泰君安	359,311	6,158,590.54	0.12
6	600999	招商证券	296,491	5,639,258.82	0.11
7	601377	兴业证券	435,950	4,211,277.00	0.08
8	000776	广发证券	252,000	3,815,280.00	0.07
9	000166	申万宏源	718,300	3,361,644.00	0.06
10	600958	东方证券	336,215	3,358,787.85	0.06
11	601901	方正证券	336,000	3,144,960.00	0.06
12	601788	光大证券	168,000	3,005,520.00	0.06
13	601066	中信建投	84,000	2,640,120.00	0.05
14	601995	中金公司	42,000	2,583,000.00	0.05
15	002736	国信证券	230,200	2,474,650.00	0.05
16	600109	国金证券	193,576	2,456,479.44	0.05
17	000783	长江证券	309,500	2,265,540.00	0.04
18	601108	财通证券	210,000	2,202,900.00	0.04
19	601555	东吴证券	252,000	2,101,680.00	0.04
20	000728	国元证券	252,000	2,008,440.00	0.04
21	002797	第一创业	268,800	1,919,232.00	0.04
22	601099	太平洋	546,000	1,850,940.00	0.04
23	600061	国投资本	210,068	1,783,477.32	0.03
24	601990	南京证券	168,000	1,767,360.00	0.03
25	601162	天风证券	346,000	1,681,560.00	0.03
26	601878	浙商证券	126,000	1,648,080.00	0.03
27	601696	中银证券	72,000	1,482,480.00	0.03
28	600909	华安证券	252,000	1,403,640.00	0.03
29	601198	东兴证券	126,000	1,377,180.00	0.03
30	600369	西南证券	265,300	1,292,011.00	0.02

31	000750	国海证券	304,400	1,290,656.00	0.02
32	002926	华西证券	126,300	1,216,269.00	0.02
33	002673	西部证券	143,200	1,181,400.00	0.02
34	601881	中国银河	102,600	1,106,028.00	0.02
35	002670	国盛金控	93,700	1,067,243.00	0.02
36	000686	东北证券	126,000	1,064,700.00	0.02
37	600155	华创阳安	98,500	1,053,950.00	0.02
38	002939	长城证券	84,000	934,920.00	0.02
39	601375	中原证券	168,000	818,160.00	0.02
40	601236	红塔证券	58,900	798,684.00	0.02
41	000712	锦龙股份	42,000	722,400.00	0.01
42	601456	国联证券	46,600	717,640.00	0.01
43	600621	华鑫股份	43,000	682,840.00	0.01
44	600918	中泰证券	61,000	660,020.00	0.01
45	002945	华林证券	42,000	580,440.00	0.01
46	600095	湘财股份	44,300	518,753.00	0.01
47	600864	哈投股份	84,000	505,680.00	0.01

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	600030	中信证券	400,786,118.22	9.86
2	601688	华泰证券	167,509,805.83	4.12
3	600837	海通证券	166,223,108.87	4.09
4	600999	招商证券	138,484,400.97	3.41
5	601211	国泰君安	133,814,586.17	3.29
6	601377	兴业证券	80,263,680.44	1.97
7	600958	东方证券	70,636,096.01	1.74
8	601901	方正证券	65,508,431.64	1.61
9	601066	中信建投	63,901,259.91	1.57
10	601788	光大证券	59,278,881.08	1.46
11	600109	国金证券	59,126,955.86	1.45
12	601108	财通证券	49,456,146.19	1.22
13	601555	东吴证券	46,915,186.32	1.15
14	601878	浙商证券	42,790,641.36	1.05
15	601099	太平洋	39,607,493.12	0.97
16	600061	国投资本	35,547,310.82	0.87
17	601162	天风证券	32,822,240.18	0.81
18	601198	东兴证券	30,183,051.53	0.74
19	601990	南京证券	29,320,244.34	0.72
20	600369	西南证券	27,399,832.92	0.67

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	600030	中信证券	8,988,398.84	0.22
2	601688	华泰证券	4,025,431.16	0.10
3	600837	海通证券	3,834,361.49	0.09
4	600999	招商证券	3,238,404.00	0.08
5	601211	国泰君安	3,126,621.00	0.08
6	601377	兴业证券	1,841,145.00	0.05
7	600958	东方证券	1,651,147.67	0.04
8	601066	中信建投	1,572,139.00	0.04
9	601901	方正证券	1,463,280.00	0.04
10	601788	光大证券	1,440,218.00	0.04
11	600109	国金证券	1,388,867.00	0.03
12	601108	财通证券	1,252,374.00	0.03
13	601555	东吴证券	1,136,521.00	0.03
14	601878	浙商证券	1,116,850.00	0.03
15	601099	太平洋	918,464.17	0.02
16	600061	国投资本	788,040.00	0.02
17	601162	天风证券	786,053.00	0.02
18	601198	东兴证券	764,114.00	0.02
19	600369	西南证券	695,550.00	0.02
20	601990	南京证券	687,605.00	0.02

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	1,973,739,174.86
卖出股票收入（成交）总额	44,894,998.24

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 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

金额单位：人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	华宝中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金	指数基金	交易型开放式	华宝基金管理有限公司	4,745,720,877.07	91.41

7.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.11.1 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。

7.11.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金未投资股指期货。

7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.12.1 本期国债期货投资政策

本基金未投资国债期货。

7.12.2 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。

7.12.3 本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

7.13 投资组合报告附注

7.13.1

券商 ETF 联接基金截至 2021 年 6 月 30 日持仓前十名证券中的海通证券（600837）的发行人海通证券股份有限公司于 2021 年 03 月 31 日公告，因公司在业务开展过程中存在以下行为：一、

公司在开展部分投资顾问、私募资产管理业务过程中，未按照审慎经营原则，有效控制和防范风险，未能审慎评估公司经营管理行为对证券市场的影响；二、公司未将相关业务行为纳入全面合规风控体系，合规风控机制存在缺失；三、公司投资银行业务内部控制存在漏洞，债券承销与资产管理等业务缺少有效隔离，利益冲突审查机制存在缺失；于 2021 年 03 月 31 日收到中国证券监督管理委员会上海监管局以下处罚：一、责令公司自本决定作出之日起 1 年内，每 3 个月开展一次内部合规检查，并在每次检查后 10 个工作日内，向上海证监局报送合规检查报告；二是责令公司自本决定作出之日起 12 个月内，暂停为机构投资者提供债券投资顾问业务。

券商 ETF 联接基金截至 2021 年 6 月 30 日持仓前十名证券中的华泰证券（601688）于 2020 年 11 月 24 日收到江苏证监局出具警示函的行政监管措施，因公司 2019 年 8 月存在重大信息安全事件未报告。上述行为违反了《证券期货业信息安全事件报告与调查处理办法》（证监会公告〔2012〕46 号）第十一条、第十六条，以及《证券基金经营机构信息技术管理办法》（证监会令第 152 号）第五十四条的相关规定。

券商 ETF 联接基金截至 2021 年 6 月 30 日持仓前十名证券中的国泰君安（601211）的发行人国泰君安证券股份有限公司于 2020 年 04 月 30 日公告，因公司存在以下违规行为：公司作为富贵鸟股份有限公司公开发行 2014 年公司债券的承销机构和受托管理人，在尽职调查和受托管理过程中未严格遵守执业规范，未能勤勉尽责地履行相关责任，于 2020 年 04 月 30 日收到中国证券监督管理委员会福建监管局出具警示函的监督管理措施。

券商 ETF 联接基金截至 2021 年 6 月 30 日持仓前十名证券中的招商证券（600999）的发行人招商证券股份有限公司因存在以下违规行为：1.未按规定履行客户身份识别义务；2.未按规定报送大额交易报告或者可疑交易报告，于 2021 年 5 月 26 日被中国人民银行深圳市中心支行罚款 173 万元。

券商 ETF 联接基金截至 2021 年 6 月 30 日持仓前十名证券中的广发证券（000776）的发行人广发证券股份有限公司于 2020 年 07 月 21 日公告，因公司存在以下违规行为：公司在康美药业股份有限公司 2014 年非公开发行优先股项目、2015 年公司债券项目、2016 年非公开发行股票项目、2018 年公司债券项目、康美实业投资控股有限公司 2017 年可交换公司债券项目中未勤勉尽责，尽职调查环节基本程序缺失，缺乏应有的执业审慎，内部质量控制流于形式，未按规定履行持续督导与受托管理义务，于 2020 年 07 月 20 日收到中国证券监督管理委员会广东监管局的以下监管措施：一、责令改正。二、2020 年 7 月 20 日至 2021 年 1 月 19 日期间，暂停广发证券的保荐机构资格；在 2020 年 7 月 20 日至 2021 年 7 月 19 日期间，暂不受理广发证券债券承销业务有关文件。三、责令限制高级管理人员权利。

本基金管理人通过对上述上市公司进行进一步了解和分析，认为上述处分不会对公司的投资价值构成实质性影响，因此本基金管理人对上述证券的投资判断未发生改变。报告期内，本基金投资的前十名证券的其余五名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

7.13.2

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。

7.13.3 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	991,151.97
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	31,117.75
5	应收申购款	124,130,178.10
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	125,152,447.82

7.13.4 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。

7.13.5 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。

7.13.6 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（%）

华宝券商 ETF 联接	83,916	8,793.11	57,002,556.11	7.73	680,879,809.37	92.27
华宝券商 ETF 联接 C	400,401	6,614.51	163,387,605.32	6.17	2,485,069,255.81	93.83
合计	484,317	6,991.99	220,390,161.43	6.51	3,165,949,065.18	93.49

8.2 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	华宝券商 ETF 联接	290,125.74	0.0393
	华宝券商 ETF 联接 C	4,536.46	0.0002
	合计	294,662.20	0.0087

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	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	华宝券商 ETF 联接	10~50
	华宝券商 ETF 联接 C	-
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	华宝券商 ETF 联接	-
	华宝券商 ETF 联接 C	-
	合计	-

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例(%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例(%)	发起份额承诺持有期限

基金管理人固有资金	-	-	10,000,450.05	0.30	不少于 3 年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	-	-	10,000,450.05	0.30	-

注：1、本基金募集期间，本基金管理人运用固有资金作为发起资金总计 10,001,000.00 元认购了本基金。发起资金认购的基金份额自基金合同生效之日起持有期不少于 3 年；2、本基金管理人运用固有资金于 2018 年 6 月 21 日通过本公司直销柜台认购本基金作为发起资金的认购费用为 1,000 元。符合基金合同和招募说明书等法律文件的约定。3、发起份额已满足承诺持有期限，管理人于 2021 年 6 月 29 日赎回 10,000,450.05 份。

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华宝券商 ETF 联接	华宝券商 ETF 联接 C
基金合同生效日（2018 年 6 月 27 日）基金份额总额	10,656,959.56	-
本报告期期初基金份额总额	619,731,567.46	1,803,012,950.78
本报告期基金总申购份额	628,355,132.97	4,231,611,804.56
减：本报告期基金总赎回份额	510,204,334.95	3,386,167,894.21
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	737,882,365.48	2,648,456,861.13

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、基金管理人的重大人事变动

本报告期内，基金管理人无重大人事变动。

2、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内基金托管人未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金资产和基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未发生变更。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

基金管理人为本基金聘任的会计师事务所向本基金提供的审计服务持续期限为：2019 年 11 月 20 日起至本报告期末。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

1、本报告期内，本基金管理人及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华宝证券	1	579,385,443.49	28.70%	539,582.62	28.70%	-
申万宏源	1	454,191,455.86	22.50%	422,989.36	22.50%	-
上海证券	1	410,355,040.57	20.33%	382,163.30	20.33%	-
国信证券	1	385,709,358.64	19.11%	359,211.08	19.11%	-

安信证券	2	78,112,655.48	3.87%	72,746.70	3.87%	-
华泰证券	1	66,540,984.32	3.30%	61,970.02	3.30%	-
第一创业	1	44,312,738.74	2.20%	41,268.47	2.20%	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	3	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
中金财富	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-

注：1、基金管理人选择交易单元的标准和程序如下：

（1）选择标准： 资力雄厚，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、本报告期租用的证券公司交易单元无变化。

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	债券交易	债券回购交易	权证交易	基金交易

称	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
华宝证券	-	-	-	-	-	-	254,856,099.46	16.35%
申万宏源	-	-	-	-	-	-	516,165,234.88	33.12%
上海证券	-	-	-	-	-	-	71,476,090.00	4.59%
国信证券	-	-	-	-	-	-	70,263,266.80	4.51%
安信证券	-	-	-	-	-	-	645,585,463.53	41.43%
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金财富	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证	-	-	-	-	-	-	-	-

券								

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华宝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招募说明书（更新）	基金管理人网站	2021-3-31
2	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合同	基金管理人网站	2021-3-31
3	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招募说明书（更新）	基金管理人网站	2021-3-10
4	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（A 类份额）基金产品资料概要（更新）	基金管理人网站	2021-3-31
5	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 2020 年第 4 季度报告	基金管理人网站	2021-1-22
6	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 2021 年第 1 季度报告	基金管理人网站	2021-4-22
7	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 2020 年年度报告	基金管理人网站	2021-3-31
8	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（A 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
10	华宝基金关于旗下部分开放式基金新增招商银行为代销机构的公告	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	2021-3-31
11	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
12	华宝基金关于旗下部分开放式基金新增平安银行为代销机构的公告	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	2021-6-10
13	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

14	华宝基金管理有限公司关于旗下部分基金根据《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号-指数基金指引》、《存托凭证发行与交易管理办法（试行）》修改基金合同部分条款的公告	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
15	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
16	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
17	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
18	华宝基金管理有限公司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变更公告	基金管理人网站,证券时报	2021-3-8
19	华宝基金关于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新增国信证券为代销机构的公告	基金管理人网站,证券时报	2021-6-17
20	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（C 类份额）基金产品资料概要（更新）	基金管理人网站	2021-3-10
21	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（C 类份额）基金产品资料概要（更新）	基金管理人网站	2021-3-31
22	华宝基金关于旗下部分开放式基金新增银河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	2021-3-31
23	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	2021-3-16
24	华宝基金关于旗下部分开放式基金新增平安银行为代销机构的公告	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	2021-6-10
25	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	2021-5-13

§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

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合同；

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招募说明书；

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

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。

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