

# 华宝标普中国 A 股质量价值指数证券投资 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。

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

|                                         |           |
|-----------------------------------------|-----------|
| <b>§ 1 重要提示及目录</b>                      | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示                                | 2         |
| 1.2 目录                                  | 3         |
| <b>§ 2 基金简介</b>                         | <b>5</b>  |
| 2.1 基金基本情况                              | 5         |
| 2.2 基金产品说明                              | 5         |
| 2.3 基金管理人和基金托管人                         | 6         |
| 2.4 信息披露方式                              | 6         |
| 2.5 其他相关资料                              | 6         |
| <b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>                | <b>6</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                         | 6         |
| 3.2 基金净值表现                              | 7         |
| <b>§ 4 管理人报告</b>                        | <b>8</b>  |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况                        | 8         |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明              | 11        |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 11        |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明             | 11        |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望             | 12        |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 12        |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 13        |
| 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明       | 13        |
| <b>§ 5 托管人报告</b>                        | <b>13</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明                  | 13        |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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真实、准确和完整发表意见       | 14        |
| <b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>              | <b>14</b> |
| 6.1 资产负债表                               | 14        |
| 6.2 利润表                                 | 15        |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表                      | 16        |
| 6.4 报表附注                                | 18        |
| <b>§ 7 投资组合报告</b>                       | <b>37</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况                          | 37        |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合                    | 37        |
| 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       | 39        |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动                     | 42        |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合                    | 43        |
| 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      | 43        |

|                                            |           |
|--------------------------------------------|-----------|
| 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..... | 43        |
| 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..... | 43        |
| 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.....    | 43        |
| 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....             | 43        |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....             | 44        |
| 7.12 投资组合报告附注.....                         | 44        |
| <b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>                 | <b>45</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....                 | 45        |
| 8.2 期末上市基金前十名持有人.....                      | 45        |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....              | 46        |
| 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.....      | 46        |
| <b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>                 | <b>46</b> |
| <b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>                   | <b>46</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议.....                      | 46        |
| 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.....      | 46        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....           | 46        |
| 10.4 基金投资策略的改变.....                        | 47        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....                 | 47        |
| 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.....         | 47        |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....                | 47        |
| 10.8 其他重大事件.....                           | 50        |
| <b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>           | <b>51</b> |
| 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....   | 51        |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....                   | 51        |
| <b>§ 12 备查文件目录 .....</b>                   | <b>51</b> |
| 12.1 备查文件目录.....                           | 51        |
| 12.2 存放地点.....                             | 51        |
| 12.3 查阅方式.....                             | 52        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|              |                              |
|--------------|------------------------------|
| 基金名称         | 华宝标普中国 A 股质量价值指数证券投资基金 (LOF) |
| 基金简称         | 华宝标普中国 A 股质量价值指数             |
| 场内简称         | 质量基金                         |
| 基金主代码        | 501069                       |
| 基金运作方式       | 上市契约型开放式 (LOF)               |
| 基金合同生效日      | 2019 年 1 月 24 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   | 15,248,351.40 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         | 2019 年 3 月 5 日               |

### 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。正常情况下，本基金力争控制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不超过 0.35%，年化跟踪误差不超过 4%。                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
| 投资策略   | <p>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。</p> <p>1、组合复制策略</p> <p>本基金主要采取完全复制法，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。</p> <p>2、替代性策略</p> <p>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。</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>本基金债券投资的目的是在保证基金资产流动性的同时有效利用基金资产，提高基金资产的投资收益。本基金债券投资组合将采用自上而下的投资策略，根据宏观经济分析、资金面动向分析等判断未来利率变动走势，并利用债券定价技术，进行个券选择。</p> |
| 业绩比较基准 | 标普中国 A 股质量价值指数收益率 $\times 95\%$ + 人民币银行活期存款利率 (税后) $\times 5\%$                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
| 风险收益特征 | 本基金为股票型基金，其长期平均风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。本基金为指数型基金，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<br>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、<br>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<br>纪大道 100 号上海环球金融中心<br>58 楼 | 北京市西城区复兴门内大街 1<br>号  |
| 办公地址        |      | 中国（上海）自由贸易试验区世<br>纪大道 100 号上海环球金融中心<br>58 楼 | 北京市西城区复兴门内大街 1<br>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          | 《中国证券报》                            |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网<br>址 | www.fsfund.com                     |
| 基金中期报告备置地点              | 本基金半年报置备地点包括基金管理人办公场所和<br>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<br>司 | 北京市西城区太平桥大街 17 号 |

# § 3 主要财务指标和基金净值表现

## 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2021 年 1 月 1 日-2021 年 6 月 30 日) |
|---------------|-------------------------------------|
| 本期已实现收益       | 1,976,246.37                        |
| 本期利润          | -9,458.30                           |
| 加权平均基金份额本期利润  | -0.0006                             |
| 本期加权平均净值利润率   | -0.04%                              |
| 本期基金份额净值增长率   | 0.03%                               |
| 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      | 6,755,659.15                        |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.4430                              |
| 期末基金资产净值      | 22,004,010.55                       |

|              |                       |
|--------------|-----------------------|
| 期末基金份额净值     | 1.4430                |
| 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  | 44.30%                |

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

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

3、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③     | ②—④    |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|---------|--------|
| 过去一个月      | -0.16%   | 0.69%       | -0.82%     | 0.72%         | 0.66%   | -0.03% |
| 过去三个月      | 1.12%    | 0.70%       | 0.04%      | 0.72%         | 1.08%   | -0.02% |
| 过去六个月      | 0.03%    | 0.94%       | -1.10%     | 0.95%         | 1.13%   | -0.01% |
| 过去一年       | 15.15%   | 1.18%       | 13.19%     | 1.19%         | 1.96%   | -0.01% |
| 过去三年       | —%       | —%          | —%         | —%            | —%      | —%     |
| 自基金合同生效起至今 | 44.30%   | 1.28%       | 54.62%     | 1.34%         | -10.32% | -0.06% |

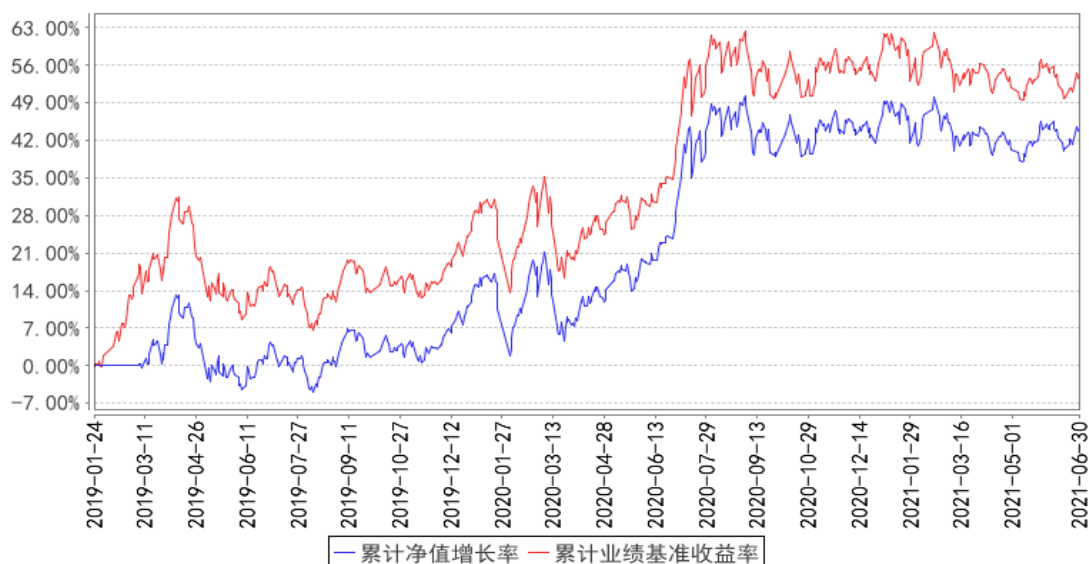
注：1、净值以及比较基准相关数据计算中涉及天数的，包括所有交易日以及季末最后一自然日（如非交易日）。

2、本基金业绩比较基准为：标普中国 A 股质量价值指数收益率\*95%+人民币银行活期存款利率(税后)\*5%。

3、本基金成立于 2019 年 1 月 24 日。

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

华宝标普中国A股质量价值指数累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：按照基金合同的约定，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 2019 年 7 月 24 日，本基金已达到合同规定的资产配置比例。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截至本报告期末（2021 年 6 月 30 日），本公司正在管理运作的证券投资基金包括：华宝宝

康债券投资基金、华宝宝康消费品证券投资基金、华宝宝康灵活配置证券投资基金、华宝现金宝货币市场基金、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 | 2019 年 1 月 24 日 | 2021 年 3 月 8 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<br>之 | 本基金的<br>基金经理<br>助理 | 2020 年<br>11 月 23<br>日 | 2021 年<br>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 股质量价值指数证券投资基金（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，在全球经济复苏继续演绎的背景下，大宗商品价格持续走高，并带来主要经济体通胀数据的攀升，美国国债收益率冲高后回落，国内外权益市场在经济持续复苏与流动性充裕的环境下，继续波动上行。国内经济方面，二季度实际 GDP 同比 7.9%，出口增速在海外大面积复工复产的背景下也没有大幅下降，显示出经济仍然有较强的韧劲。

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力，市场风格再次向成长股切换。本报告期内，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%。标普中国 A 股质量价值指数在本报告期内下跌了 1.2%。

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

本报告期基金份额净值增长率为 0.03%，业绩比较基准收益率为 -1.10%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2021 年三季度，全球经济复苏的态势料将延续。国内经济的主要动能可能由外需切换为内需，但消费与投资支撑经济韧性仍在。核心产业的转型升级仍然是国内经济关注的焦点，科技创新和消费升级仍然是未来政策支持的重点。如果海外疫情再次出现反复，对于国内出口下降的压力会有所减小。如果经济平稳复苏，那么关注的重点将是国内和全球主要经济体的货币和财政政策何时转向和转向力度。目前医药、食品饮料、科技等热门板块的估值处于高位，成长股的估值对市场流动性非常敏感，如果流动性有所收紧，或者资产的成长性出现变化，这部分资产大概率难以维持目前的估值水平。标普中国 A 股质量价值指数在关注资产基本面质量的同时，也关注其估值，契合经典价值投资理念，投资策略更加稳健，值得投资者长期关注。

## 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

本基金本报告期亏损，未有应分未分的利润。

### 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

本基金基金合同于 2019 年 1 月 24 日生效，截至本报告期末，本基金基金资产净值存在连续超过六十个工作日低于五千万元的情形。根据相关规定，本基金管理人已拟定了相应的解决方案，并已将方案报告监管机构。

## § 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 股质量价值指数证券投资基金（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”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 股质量价值指数证券投资基金（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<br>2021 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日 |
|-------------|---------|------------------------|--------------------------|
| <b>资 产：</b> |         |                        |                          |
| 银行存款        | 6.4.7.1 | 1,326,389.95           | 1,927,394.62             |
| 结算备付金       |         | —                      | 1,894.84                 |
| 存出保证金       |         | 5,964.62               | 4,039.20                 |
| 交易性金融资产     | 6.4.7.2 | 20,909,017.84          | 24,498,904.60            |
| 其中：股票投资     |         | 20,909,017.84          | 24,498,904.60            |
| 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         |            | -                              | 90,994.13                        |
| 应收利息            | 6.4.7.5    | 138.60                         | 199.97                           |
| 应收股利            |            | -                              | -                                |
| 应收申购款           |            | 11,697.24                      | 31,597.35                        |
| 递延所得税资产         |            | -                              | -                                |
| 其他资产            | 6.4.7.6    | -                              | -                                |
| 资产总计            |            | 22,253,208.25                  | 26,555,024.71                    |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2021 年 6 月 30 日</b> | <b>上年度末<br/>2020 年 12 月 31 日</b> |
| <b>负 债:</b>     |            |                                |                                  |
| 短期借款            |            | -                              | -                                |
| 交易性金融负债         |            | -                              | -                                |
| 衍生金融负债          | 6.4.7.3    | -                              | -                                |
| 卖出回购金融资产款       |            | -                              | -                                |
| 应付证券清算款         |            | -                              | -                                |
| 应付赎回款           |            | 52,174.32                      | 353,899.36                       |
| 应付管理人报酬         |            | 13,592.24                      | 16,784.66                        |
| 应付托管费           |            | 1,812.31                       | 2,237.96                         |
| 应付销售服务费         |            | -                              | -                                |
| 应付交易费用          | 6.4.7.7    | 63,907.73                      | 51,502.42                        |
| 应交税费            |            | -                              | -                                |
| 应付利息            |            | -                              | -                                |
| 应付利润            |            | -                              | -                                |
| 递延所得税负债         |            | -                              | -                                |
| 其他负债            | 6.4.7.8    | 117,711.10                     | 300,856.96                       |
| 负债合计            |            | 249,197.70                     | 725,281.36                       |
| <b>所有者权益:</b>   |            |                                |                                  |
| 实收基金            | 6.4.7.9    | 15,248,351.40                  | 17,906,094.84                    |
| 未分配利润           | 6.4.7.10   | 6,755,659.15                   | 7,923,648.51                     |
| 所有者权益合计         |            | 22,004,010.55                  | 25,829,743.35                    |
| 负债和所有者权益总计      |            | 22,253,208.25                  | 26,555,024.71                    |

注： 报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.4430 元，基金份额总额 15,248,351.40 份

。

## 6.2 利润表

会计主体：华宝标普中国 A 股质量价值指数证券投资基金（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<br>2021 年 1 月 1 日至 2021<br>年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 1 日至 2020<br>年 6 月 30 日 |
|------------------------|------------|------------------------------------------|-----------------------------------------------|
| 一、收入                   |            | 270,544.31                               | 3,707,586.67                                  |
| 1. 利息收入                |            | 3,328.98                                 | 7,384.42                                      |
| 其中：存款利息收入              | 6.4.7.11   | 3,328.98                                 | 7,384.42                                      |
| 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）      |            | 2,241,224.60                             | 4,701,479.36                                  |
| 其中：股票投资收益              | 6.4.7.12   | 1,832,573.10                             | 4,171,158.13                                  |
| 基金投资收益                 | -          | -                                        | -                                             |
| 债券投资收益                 | 6.4.7.13   | -                                        | -                                             |
| 资产支持证券投资收益             | 6.4.7.13.2 | -                                        | -                                             |
| 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   | 408,651.50                               | 530,321.23                                    |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.17   | -1,985,704.67                            | -1,026,068.89                                 |
| 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   | 11,695.40                                | 24,791.78                                     |
| 减：二、费用                 |            | 280,002.61                               | 373,235.61                                    |
| 1. 管理人报酬               | 6.4.10.2.1 | 85,967.96                                | 116,331.59                                    |
| 2. 托管费                 | 6.4.10.2.2 | 11,462.38                                | 15,510.84                                     |
| 3. 销售服务费               | 6.4.10.2.3 | -                                        | -                                             |
| 4. 交易费用                | 6.4.7.19   | 63,322.65                                | 89,520.38                                     |
| 5. 利息支出                |            | -                                        | -                                             |
| 其中：卖出回购金融资产支出          |            | -                                        | -                                             |
| 6. 税金及附加               |            | -                                        | -                                             |
| 7. 其他费用                | 6.4.7.20   | 119,249.62                               | 151,872.80                                    |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）    |            | -9,458.30                                | 3,334,351.06                                  |
| 减：所得税费用                |            | -                                        | -                                             |
| 四、净利润（净亏损以“-”          |            | -9,458.30                                | 3,334,351.06                                  |

|      |  |  |  |
|------|--|--|--|
| 号填列) |  |  |  |
|------|--|--|--|

### 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 股质量价值指数证券投资基金（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<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日      |               |                |
|----------------------------------------|--------------------------------------------|---------------|----------------|
|                                        | 实收基金                                       | 未分配利润         | 所有者权益合计        |
| 一、期初所有者权益（基金净值）                        | 17,906,094.84                              | 7,923,648.51  | 25,829,743.35  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                                          | -9,458.30     | -9,458.30      |
| 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）      | -2,657,743.44                              | -1,158,531.06 | -3,816,274.50  |
| 其中：1. 基金申购款                            | 7,187,755.98                               | 3,250,738.37  | 10,438,494.35  |
| 2. 基金赎回款                               | -9,845,499.42                              | -4,409,269.43 | -14,254,768.85 |
| 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）                        | 15,248,351.40                              | 6,755,659.15  | 22,004,010.55  |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |               |                |
|                                        | 实收基金                                       | 未分配利润         | 所有者权益合计        |
| 一、期初所有者权益（基金净值）                        | 35,801,357.85                              | 4,647,044.51  | 40,448,402.36  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                                          | 3,334,351.06  | 3,334,351.06   |
| 三、本期基金份额                               | -12,476,433.05                             | -2,078,030.33 | -14,554,463.38 |

|                                        |                |               |                |
|----------------------------------------|----------------|---------------|----------------|
| 额交易产生的基金净值变动数<br>(净值减少以“-”号填列)         |                |               |                |
| 其中：1. 基金申购款                            | 13,605,241.02  | 1,567,317.14  | 15,172,558.16  |
| 2. 基金赎回款                               | -26,081,674.07 | -3,645,347.47 | -29,727,021.54 |
| 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)                        | 23,324,924.80  | 5,903,365.24  | 29,228,290.04  |

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 股质量价值指数证券投资基金(LOF)(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》、《华宝标普中国 A 股质量价值指数证券投资基金(LOF)(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]1058 号文批准公开募集。本基金为上市契约型开放式基金,存续期限为不定期,首次设立募集基金份额为 279,640,252.85 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(19)第 00021 号的验资报告。基金合同于 2019 年 1 月 24 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,基金托管人为中国银行股份有限公司。

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《华宝标普中国 A 股质量价值指数证券投资基金(LOF)招募说明书》的有关规定,本基金的投资范围包括标的指数成份股、备选成份股、国内依法发行上市的其他股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府

支持债券、地方政府债、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、权证、股指期货以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。本基金可以参与融资和转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人可在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：本基金投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，且投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，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 股质量价值指数收益率  $\times 95\%$  + 人民币银行活期存款利率（税后） $\times 5\%$ 。

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

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

## 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

无

### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

无

### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

## 6.4.6 税项

### (1) 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

### (2) 增值税

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

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。

### (3) 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011 年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个体，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

### (4) 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

### (5) 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；

持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目             | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款           | 1,326,389.95           |
| 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             | 1,326,389.95           |

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日 |               |            |
|---------------|------------------------|---------------|------------|
|               | 成本                     | 公允价值          | 公允价值变动     |
| 股票            | 20,140,594.09          | 20,909,017.84 | 768,423.75 |
| 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            | 20,140,594.09          | 20,909,017.84 | 768,423.75 |

##### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目         | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日 |
|------------|------------------------|
| 应收活期存款利息   | 135.90                 |
| 应收定期存款利息   | —                      |
| 应收其他存款利息   | —                      |
| 应收结算备付金利息  | —                      |
| 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         | 2.70                   |
| 合计         | 138.60                 |

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 63,907.73              |
| 银行间市场应付交易费用 | —                      |
| 合计          | 63,907.73              |

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | —                      |

|           |            |
|-----------|------------|
| 应付赎回费     | 88.72      |
| 应付证券出借违约金 | —          |
| 预提费用      | 9,916.99   |
| 应付指数使用费   | 97,987.50  |
| 应付数据使用费   | 9,717.89   |
| 合计        | 117,711.10 |

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期                              |               |
|---------------|---------------------------------|---------------|
|               | 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |               |
|               | 基金份额（份）                         | 账面金额          |
| 上年度末          | 17,906,094.84                   | 17,906,094.84 |
| 本期申购          | 7,187,755.98                    | 7,187,755.98  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -9,845,499.42                   | -9,845,499.42 |
| — 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           | 15,248,351.40                   | 15,248,351.40 |

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

| 项目             | 已实现部分         | 未实现部分         | 未分配利润合计       |
|----------------|---------------|---------------|---------------|
| 上年度末           | 7,526,628.97  | 397,019.54    | 7,923,648.51  |
| 本期利润           | 1,976,246.37  | -1,985,704.67 | -9,458.30     |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -1,180,480.30 | 21,949.24     | -1,158,531.06 |
| 其中：基金申购款       | 3,290,537.73  | -39,799.36    | 3,250,738.37  |
| 基金赎回款          | -4,471,018.03 | 61,748.60     | -4,409,269.43 |
| 本期已分配利润        | —             | —             | —             |
| 本期末            | 8,322,395.04  | -1,566,735.89 | 6,755,659.15  |

#### 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  | 3,130.02                        |
| 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 | 150.38                          |
| 其他        | 48.58                           |
| 合计        | 3,328.98                        |

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目               | 本期<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |
|------------------|----------------------------|
| 股票投资收益——买卖股票差价收入 | 1,832,573.10               |
| 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               | 1,832,573.10               |

##### 6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目         | 本期<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 22,182,959.42              |
| 减：卖出股票成本总额 | 20,350,386.32              |
| 买卖股票差价收入   | 1,832,573.10               |

#### 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 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。

#### 6.4.7.15 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<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
|---------------|---------------------------------------|
| 股票投资产生的股利收益   | 408,651.50                            |
| 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            | 408,651.50                            |

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称                   | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
|------------------------|---------------------------------------|
| 1. 交易性金融资产             | -1,985,704.67                         |
| 股票投资                   | -1,985,704.67                         |
| 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                     | -1,985,704.67                         |

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
|---------|---------------------------------------|
| 基金赎回费收入 | 11,695.40                             |
| 合计      | 11,695.40                             |

注：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。

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 63,322.65                             |
| 银行间市场交易费用 | —                                     |
| 合计        | 63,322.65                             |

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
|---------|---------------------------------------|
| 审计费用    | 9,916.99                              |
| 信息披露费   | —                                     |
| 证券出借违约金 | —                                     |
| 银行费用    | 1,627.24                              |
| 指数使用费   | 107,705.39                            |
| 合计      | 119,249.62                            |

#### 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、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<br>(Warburg Pincus Asset Management, L.P.) | 基金管理人的股东          |
| 中国宝武钢铁集团有限公司(“宝武集团”)                                  | 华宝信托的最终控制人        |
| 华宝证券股份有限公司(“华宝证券”)                                    | 受宝武集团控制的公司、基金销售机构 |
| 华宝投资有限公司(“华宝投资”)                                      | 受宝武集团控制的公司        |
| 宝武集团财务有限责任公司(“宝武财务”)                                  | 受宝武集团控制的公司        |

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |                         | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |                     |
|-------|---------------------------------------|-------------------------|--------------------------------------------|---------------------|
|       | 成交金额                                  | 占当期股票<br>成交总额的比例<br>(%) | 成交金额                                       | 占当期股票<br>成交总额的比例(%) |
| 华宝证券  | 1,011,183.00                          | 2.47                    | —                                          | —                   |

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

##### 6.4.10.1.2 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日      |                    |              |                      |
|-------|--------------------------------------------|--------------------|--------------|----------------------|
|       | 当期<br>佣金                                   | 占当期佣金总量<br>的比例 (%) | 期末应付佣金余<br>额 | 占期末应付佣金<br>总额的比例 (%) |
| 华宝证券  | 921.52                                     | 2.46               | 921.52       | 1.44                 |
| 关联方名称 | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |                    |              |                      |
|       | 当期<br>佣金                                   | 占当期佣金总量<br>的比例 (%) | 期末应付佣金余<br>额 | 占期末应付佣金<br>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<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 |
|----|--------------------------------|---------------------------------|
|----|--------------------------------|---------------------------------|

|                 | 月 30 日    | 年 6 月 30 日 |
|-----------------|-----------|------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 85,967.96 | 116,331.59 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 31,177.58 | 42,258.26  |

注：注：基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.75% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.75\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6<br>月 30 日 | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 1 日至 2020<br>年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------------------------|-----------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 11,462.38                                | 15,510.84                                     |

注：基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期内及上年度可比期间均未发生转融通证券出借业务。

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

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

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

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<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |          | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |          |
|------------|---------------------------------------|----------|--------------------------------------------|----------|
|            | 期末余额                                  | 当期利息收入   | 期末余额                                       | 当期利息收入   |
| 中国银行股份有限公司 | 1,326,389.95                          | 3,130.02 | 2,065,227.86                               | 6,974.60 |

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

本基金本报告期内及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

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

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

| 股票代码   | 股票名称 | 停牌日期            | 停牌原因   | 期末估值单价 | 复牌日期           | 复牌开盘单价 | 数量(股) | 期末成本总额    | 期末估值总额    | 备注 |
|--------|------|-----------------|--------|--------|----------------|--------|-------|-----------|-----------|----|
| 300660 | 江苏雷利 | 2021 年 6 月 21 日 | 重大事项停牌 | 20.57  | 2021 年 7 月 5 日 | 20.82  | 3,000 | 55,186.87 | 61,710.00 | -  |

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为指数型基金，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 股质量价值指数。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同责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于本报告期末，本基金无债券投资。

#### 6.4.13.3 流动性风险

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

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

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

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（自 2017 年 10 月 1 日起施行）等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限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）。

本基金所持证券均在证券交易所上市，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 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。本基金所持证券均在证券交易所上市，不存在具有重大流动性风险的投资品种。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价

值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量因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、存出保证金和应收申购款等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2021 年 6 月 30 日 | 1 年以内        | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息           | 合计            |
|------------------------|--------------|-------|-------|---------------|---------------|
| 资产                     |              |       |       |               |               |
| 银行存款                   | 1,326,389.95 | -     | -     | -             | 1,326,389.95  |
| 存出保证金                  | 5,964.62     | -     | -     | -             | 5,964.62      |
| 交易性金融资产                | -            | -     | -     | 20,909,017.84 | 20,909,017.84 |
| 应收利息                   | -            | -     | -     | 138.60        | 138.60        |
| 应收申购款                  | 5.00         | -     | -     | 11,692.24     | 11,697.24     |
| 资产总计                   | 1,332,359.57 | -     | -     | 20,920,848.68 | 22,253,208.25 |
| 负债                     |              |       |       |               |               |
| 应付赎回款                  | -            | -     | -     | 52,174.32     | 52,174.32     |
| 应付管理人报酬                | -            | -     | -     | 13,592.24     | 13,592.24     |
| 应付托管费                  | -            | -     | -     | 1,812.31      | 1,812.31      |
| 应付交易费用                 | -            | -     | -     | 63,907.73     | 63,907.73     |
| 其他负债                   | -            | -     | -     | 117,711.10    | 117,711.10    |
| 负债总计                   | -            | -     | -     | 249,197.70    | 249,197.70    |
| 利率敏感度缺口                | 1,332,359.57 | -     | -     | 20,671,650.98 | 22,004,010.55 |

| 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日 | 1 年以内        | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息           | 合计            |
|--------------------------|--------------|-------|-------|---------------|---------------|
| 资产                       |              |       |       |               |               |
| 银行存款                     | 1,927,394.62 | -     | -     | -             | 1,927,394.62  |
| 结算备付金                    | 1,894.84     | -     | -     | -             | 1,894.84      |
| 存出保证金                    | 4,039.20     | -     | -     | -             | 4,039.20      |
| 交易性金融资产                  | -            | -     | -     | 24,498,904.60 | 24,498,904.60 |
| 应收利息                     | -            | -     | -     | 199.97        | 199.97        |
| 应收申购款                    | 5.00         | -     | -     | 31,592.35     | 31,597.35     |
| 应收证券清算款                  | -            | -     | -     | 90,994.13     | 90,994.13     |
| 资产总计                     | 1,933,333.66 | -     | -     | 24,621,691.05 | 26,555,024.71 |
| 负债                       |              |       |       |               |               |
| 应付赎回款                    | -            | -     | -     | 353,899.36    | 353,899.36    |
| 应付管理人报酬                  | -            | -     | -     | 16,784.66     | 16,784.66     |
| 应付托管费                    | -            | -     | -     | 2,237.96      | 2,237.96      |
| 应付交易费用                   | -            | -     | -     | 51,502.42     | 51,502.42     |
| 其他负债                     | -            | -     | -     | 300,856.96    | 300,856.96    |
| 负债总计                     | -            | -     | -     | 725,281.36    | 725,281.36    |
| 利率敏感度缺口                  | 1,933,333.66 | -     | -     | 23,896,409.69 | 25,829,743.35 |

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的股票，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 股质量价值指数。本基金投资于标的指数成分股及其备选成分股的比例不低于本基金资产净值的 90%，且投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应保持不低于本基金资产净值 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本基金进行风险度量，包括 VaR（Value at Risk）指标等来测试基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日 |              | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日 |              |
|---------------|------------------------|--------------|--------------------------|--------------|
|               | 公允价值                   | 占基金资产净值比例（%） | 公允价值                     | 占基金资产净值比例（%） |
| 交易性金融资产—股票投资  | 20,909,017.84          | 95.02        | 24,498,904.60            | 94.85        |
| 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            | 20,909,017.84          | 95.02        | 24,498,904.60            | 94.85        |

#### 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%       | 1,085,584.26                | 1,275,672.78           |
|    | 2. 业绩比较基准下降 5%       | -1,085,584.26               | -1,275,672.78          |

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括银行存款、结算备付金、存出保证金、应收证券清算款、应收利息、应收申购款以及其他金融负债，其因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

##### (b) 以公允价值计量的金融工具

##### (i) 各层次金融工具公允价值

于本报告期末，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币 20,847,307.84 元，第二层次的余额为人民币 61,710.00 元，无划分为第三层次的余额（于上年度末，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币 24,496,430.86 元，第二层次的余额为人民币 2,473.74 元，无划分为第三层次的余额）。

##### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的证券等，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关证券等的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关证券公允价值应属第二层次或第三层次。

##### (iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

本基金于本报告期初未持有公允价值归属于第三层次的金融工具，本基金本报告期及上年度可比期间未发生第三层次公允价值转入转出情况。

##### (2) 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大承诺事项。

##### (3) 其他事项

## § 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  | 20,909,017.84 | 93.96         |
|    | 其中：股票 | 20,909,017.84 | 93.96         |
| 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      | 1,326,389.95  | 5.96   |
| 8 | 其他各项资产            | 17,800.46     | 0.08   |
| 9 | 合计                | 22,253,208.25 | 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         | -             | -            |
| B  | 采矿业              | 197,271.00    | 0.90         |
| C  | 制造业              | 14,883,404.84 | 67.64        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 162,381.00    | 0.74         |
| E  | 建筑业              | 326,644.00    | 1.48         |
| F  | 批发和零售业           | 906,838.00    | 4.12         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 115,557.00    | 0.53         |
| H  | 住宿和餐饮业           | -             | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 2,451,800.00  | 11.14        |
| J  | 金融业              | -             | -            |
| K  | 房地产业             | -             | -            |
| L  | 租赁和商务服务业         | 952,734.00    | 4.33         |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 806,480.00    | 3.67         |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 44,198.00     | 0.20         |
| 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               | 20,847,307.84 | 94.74        |

## 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         | —         | —            |
| B  | 采矿业              | —         | —            |
| C  | 制造业              | 61,710.00 | 0.28         |
| 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              | —         | —            |
| 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               | 61,710.00 | 0.28         |

## 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  | 002555 | 三七互娱 | 39,500 | 948,790.00 | 4.31         |
| 2  | 300676 | 华大基因 | 6,800  | 806,480.00 | 3.67         |
| 3  | 002127 | 南极电商 | 80,700 | 788,439.00 | 3.58         |
| 4  | 603026 | 石大胜华 | 4,500  | 729,225.00 | 3.31         |
| 5  | 000739 | 普洛药业 | 24,700 | 726,180.00 | 3.30         |

|    |        |      |         |            |      |
|----|--------|------|---------|------------|------|
| 6  | 603156 | 养元饮品 | 20,200  | 577,316.00 | 2.62 |
| 7  | 601216 | 君正集团 | 109,000 | 554,810.00 | 2.52 |
| 8  | 002585 | 双星新材 | 24,600  | 495,198.00 | 2.25 |
| 9  | 002563 | 森马服饰 | 33,000  | 394,350.00 | 1.79 |
| 10 | 002281 | 光迅科技 | 15,500  | 381,300.00 | 1.73 |
| 11 | 000999 | 华润三九 | 13,300  | 355,775.00 | 1.62 |
| 12 | 603198 | 迎驾贡酒 | 7,900   | 349,970.00 | 1.59 |
| 13 | 600507 | 方大特钢 | 50,833  | 344,647.74 | 1.57 |
| 14 | 600993 | 马应龙  | 11,300  | 326,344.00 | 1.48 |
| 15 | 002191 | 劲嘉股份 | 28,800  | 306,432.00 | 1.39 |
| 16 | 000877 | 天山股份 | 22,700  | 295,781.00 | 1.34 |
| 17 | 002318 | 久立特材 | 24,300  | 292,086.00 | 1.33 |
| 18 | 002242 | 九阳股份 | 8,900   | 289,161.00 | 1.31 |
| 19 | 002705 | 新宝股份 | 10,900  | 286,125.00 | 1.30 |
| 20 | 002233 | 塔牌集团 | 27,800  | 285,784.00 | 1.30 |
| 21 | 002091 | 江苏国泰 | 30,500  | 277,550.00 | 1.26 |
| 22 | 600329 | 中新药业 | 9,800   | 275,282.00 | 1.25 |
| 23 | 002867 | 周大生  | 13,900  | 274,803.00 | 1.25 |
| 24 | 000951 | 中国重汽 | 10,100  | 273,306.00 | 1.24 |
| 25 | 603599 | 广信股份 | 8,600   | 258,688.00 | 1.18 |
| 26 | 300036 | 超图软件 | 11,800  | 257,948.00 | 1.17 |
| 27 | 600850 | 电科数字 | 9,500   | 255,645.00 | 1.16 |
| 28 | 600720 | 祁连山  | 22,500  | 237,150.00 | 1.08 |
| 29 | 002803 | 吉宏股份 | 7,600   | 215,688.00 | 0.98 |
| 30 | 300679 | 电连技术 | 7,400   | 213,268.00 | 0.97 |
| 31 | 000915 | 华特达因 | 7,900   | 211,167.00 | 0.96 |
| 32 | 603298 | 杭叉集团 | 11,600  | 210,424.00 | 0.96 |
| 33 | 600006 | 东风汽车 | 28,700  | 209,510.00 | 0.95 |
| 34 | 603686 | 龙马环卫 | 13,300  | 202,293.00 | 0.92 |
| 35 | 002020 | 京新药业 | 23,700  | 201,450.00 | 0.92 |
| 36 | 002106 | 莱宝高科 | 17,800  | 200,250.00 | 0.91 |
| 37 | 300459 | 金科文化 | 60,800  | 196,384.00 | 0.89 |
| 38 | 300607 | 拓斯达  | 5,600   | 194,880.00 | 0.89 |
| 39 | 300131 | 英唐智控 | 25,200  | 192,528.00 | 0.87 |
| 40 | 002216 | 三全食品 | 11,570  | 190,557.90 | 0.87 |
| 41 | 000717 | 韶钢松山 | 40,500  | 185,895.00 | 0.84 |
| 42 | 002884 | 凌霄泵业 | 7,640   | 177,935.60 | 0.81 |
| 43 | 603355 | 莱克电气 | 2,800   | 174,244.00 | 0.79 |
| 44 | 600750 | 江中药业 | 12,800  | 169,600.00 | 0.77 |
| 45 | 600512 | 腾达建设 | 55,600  | 169,024.00 | 0.77 |
| 46 | 300432 | 富临精工 | 12,100  | 168,190.00 | 0.76 |
| 47 | 002088 | 鲁阳节能 | 7,300   | 167,827.00 | 0.76 |

|    |        |      |        |            |      |
|----|--------|------|--------|------------|------|
| 48 | 002517 | 恺英网络 | 38,500 | 166,320.00 | 0.76 |
| 49 | 300206 | 理邦仪器 | 10,400 | 165,360.00 | 0.75 |
| 50 | 600742 | 一汽富维 | 16,200 | 165,078.00 | 0.75 |
| 51 | 300280 | 紫天科技 | 4,500  | 164,295.00 | 0.75 |
| 52 | 002737 | 葵花药业 | 10,000 | 163,200.00 | 0.74 |
| 53 | 002900 | 哈三联  | 4,900  | 163,023.00 | 0.74 |
| 54 | 600452 | 涪陵电力 | 11,300 | 162,381.00 | 0.74 |
| 55 | 002677 | 浙江美大 | 8,700  | 159,036.00 | 0.72 |
| 56 | 600846 | 同济科技 | 18,500 | 157,620.00 | 0.72 |
| 57 | 601126 | 四方股份 | 16,800 | 150,360.00 | 0.68 |
| 58 | 002367 | 康力电梯 | 16,700 | 149,298.00 | 0.68 |
| 59 | 002026 | 山东威达 | 10,800 | 147,528.00 | 0.67 |
| 60 | 002111 | 威海广泰 | 8,100  | 146,853.00 | 0.67 |
| 61 | 002263 | 大东南  | 48,900 | 138,387.00 | 0.63 |
| 62 | 600855 | 航天长峰 | 9,700  | 129,204.00 | 0.59 |
| 63 | 300129 | 泰胜风能 | 20,900 | 128,117.00 | 0.58 |
| 64 | 603100 | 川仪股份 | 7,200  | 126,072.00 | 0.57 |
| 65 | 000935 | 四川双马 | 9,200  | 125,488.00 | 0.57 |
| 66 | 002582 | 好想你  | 13,400 | 125,290.00 | 0.57 |
| 67 | 002194 | 武汉凡谷 | 9,100  | 121,849.00 | 0.55 |
| 68 | 000576 | 甘化科工 | 10,100 | 120,291.00 | 0.55 |
| 69 | 601568 | 北元集团 | 13,900 | 118,984.00 | 0.54 |
| 70 | 000859 | 国风塑业 | 19,800 | 117,414.00 | 0.53 |
| 71 | 603223 | 恒通股份 | 3,900  | 115,557.00 | 0.53 |
| 72 | 300543 | 朗科智能 | 7,220  | 110,321.60 | 0.50 |
| 73 | 000655 | 金岭矿业 | 10,500 | 105,735.00 | 0.48 |
| 74 | 002993 | 奥海科技 | 2,300  | 100,165.00 | 0.46 |
| 75 | 002959 | 小熊电器 | 1,500  | 99,660.00  | 0.45 |
| 76 | 300552 | 万集科技 | 2,900  | 96,512.00  | 0.44 |
| 77 | 603258 | 电魂网络 | 3,600  | 92,124.00  | 0.42 |
| 78 | 000923 | 河钢资源 | 4,800  | 91,536.00  | 0.42 |
| 79 | 002443 | 金洲管道 | 14,400 | 90,720.00  | 0.41 |
| 80 | 603002 | 宏昌电子 | 13,200 | 89,760.00  | 0.41 |
| 81 | 002487 | 大金重工 | 11,900 | 88,893.00  | 0.40 |
| 82 | 000922 | 佳电股份 | 12,800 | 87,808.00  | 0.40 |
| 83 | 002232 | 启明信息 | 7,000  | 82,740.00  | 0.38 |
| 84 | 002381 | 双箭股份 | 9,800  | 80,556.00  | 0.37 |
| 85 | 300690 | 双一科技 | 3,200  | 79,936.00  | 0.36 |
| 86 | 002987 | 京北方  | 2,220  | 70,929.00  | 0.32 |
| 87 | 600814 | 杭州解百 | 10,100 | 68,983.00  | 0.31 |
| 88 | 603927 | 中科软  | 1,600  | 68,720.00  | 0.31 |
| 89 | 603988 | 中电电机 | 3,700  | 62,160.00  | 0.28 |

|     |        |      |        |           |      |
|-----|--------|------|--------|-----------|------|
| 90  | 002553 | 南方轴承 | 6,100  | 61,976.00 | 0.28 |
| 91  | 300547 | 川环科技 | 5,800  | 59,740.00 | 0.27 |
| 92  | 002940 | 昂利康  | 1,600  | 59,648.00 | 0.27 |
| 93  | 002164 | 宁波东力 | 10,400 | 54,288.00 | 0.25 |
| 94  | 603380 | 易德龙  | 2,200  | 52,844.00 | 0.24 |
| 95  | 002763 | 汇洁股份 | 5,200  | 49,348.00 | 0.22 |
| 96  | 002980 | 华盛昌  | 1,300  | 46,735.00 | 0.21 |
| 97  | 002887 | 绿茵生态 | 4,100  | 44,198.00 | 0.20 |
| 98  | 600724 | 宁波富达 | 12,900 | 43,989.00 | 0.20 |
| 99  | 603787 | 新日股份 | 1,800  | 43,164.00 | 0.20 |
| 100 | 300945 | 曼卡龙  | 2,100  | 41,433.00 | 0.19 |

### 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  | 300660 | 江苏雷利 | 3,000 | 61,710.00 | 0.28         |

### 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  | 300676 | 华大基因 | 812,575.00 | 3.15           |
| 2  | 002127 | 南极电商 | 701,936.00 | 2.72           |
| 3  | 603156 | 养元饮品 | 612,485.00 | 2.37           |
| 4  | 603026 | 石大胜华 | 587,622.00 | 2.27           |
| 5  | 601216 | 君正集团 | 584,668.00 | 2.26           |
| 6  | 002585 | 双星新材 | 481,563.48 | 1.86           |
| 7  | 002555 | 三七互娱 | 405,512.00 | 1.57           |
| 8  | 002563 | 森马服饰 | 380,472.00 | 1.47           |
| 9  | 002281 | 光迅科技 | 378,183.00 | 1.46           |
| 10 | 000999 | 华润三九 | 345,454.00 | 1.34           |
| 11 | 002705 | 新宝股份 | 311,696.00 | 1.21           |
| 12 | 000877 | 天山股份 | 311,111.00 | 1.20           |
| 13 | 300036 | 超图软件 | 293,301.00 | 1.14           |
| 14 | 000951 | 中国重汽 | 282,635.00 | 1.09           |
| 15 | 002318 | 久立特材 | 272,287.00 | 1.05           |
| 16 | 000538 | 云南白药 | 270,018.00 | 1.05           |
| 17 | 002091 | 江苏国泰 | 257,180.00 | 1.00           |
| 18 | 000739 | 普洛药业 | 254,016.00 | 0.98           |
| 19 | 603599 | 广信股份 | 253,170.00 | 0.98           |
| 20 | 600329 | 中新药业 | 227,402.00 | 0.88           |

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  | 000538 | 云南白药 | 1,665,184.00 | 6.45           |
| 2  | 000333 | 美的集团 | 1,315,339.00 | 5.09           |
| 3  | 600600 | 青岛啤酒 | 1,234,994.36 | 4.78           |
| 4  | 600585 | 海螺水泥 | 1,199,309.00 | 4.64           |
| 5  | 002508 | 老板电器 | 868,044.00   | 3.36           |
| 6  | 600486 | 扬农化工 | 859,060.00   | 3.33           |
| 7  | 603816 | 顾家家居 | 643,471.76   | 2.49           |
| 8  | 002028 | 思源电气 | 643,418.12   | 2.49           |
| 9  | 002131 | 利欧股份 | 617,308.00   | 2.39           |
| 10 | 002299 | 圣农发展 | 572,680.00   | 2.22           |
| 11 | 000997 | 新大陆  | 521,303.00   | 2.02           |
| 12 | 002081 | 金螳螂  | 483,518.00   | 1.87           |
| 13 | 002056 | 横店东磁 | 475,178.00   | 1.84           |
| 14 | 300418 | 昆仑万维 | 432,390.00   | 1.67           |
| 15 | 000800 | 一汽解放 | 400,404.00   | 1.55           |
| 16 | 002555 | 三七互娱 | 341,042.00   | 1.32           |
| 17 | 300171 | 东富龙  | 336,659.00   | 1.30           |
| 18 | 603606 | 东方电缆 | 334,417.00   | 1.29           |
| 19 | 600685 | 中船防务 | 315,707.00   | 1.22           |
| 20 | 002262 | 恩华药业 | 309,570.22   | 1.20           |

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 | 18,746,204.23 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 22,182,959.42 |

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   | 5,964.62  |
| 2  | 应收证券清算款 | —         |
| 3  | 应收股利    | —         |
| 4  | 应收利息    | 138.60    |
| 5  | 应收申购款   | 11,697.24 |
| 6  | 其他应收款   | —         |
| 7  | 待摊费用    | —         |
| 8  | 其他      | —         |
| 9  | 合计      | 17,800.46 |

## 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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

### 7.12.5.2 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  | 300660 | 江苏雷利 | 61,710.00   | 0.28         | 重大事项停牌   |

## 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，合计数可能不等于分项之和。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数 | 户均持有的 | 持有人结构 |
|-------|-------|-------|
|-------|-------|-------|

| (户)   | 基金份额     | 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 (%) |
| 8,007 | 1,904.38 | 2,626,709.00 | 17.23      | 12,621,642.40 | 82.77      |

## 8.2 期末上市基金前十名持有人

| 序号 | 持有人名称        | 持有份额 (份)     | 占上市总份额比例 (%) |
|----|--------------|--------------|--------------|
| 1  | 中国国际金融股份有限公司 | 2,626,709.00 | 79.36        |
| 2  | 肖青青          | 180,000.00   | 5.44         |
| 3  | 王世权          | 114,000.00   | 3.44         |
| 4  | 李泳滨          | 67,800.00    | 2.05         |
| 5  | 蔡兰灯          | 45,000.00    | 1.36         |
| 6  | 季益           | 43,100.00    | 1.30         |
| 7  | 王丽艳          | 38,800.00    | 1.17         |
| 8  | 原维军          | 33,716.00    | 1.02         |
| 9  | 宋佳燕          | 15,500.00    | 0.47         |
| 10 | 华国丰          | 15,000.00    | 0.45         |

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目               | 持有份额总数 (份) | 占基金总份额比例 (%) |
|------------------|------------|--------------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 67,832.26  | 0.4448       |

## 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                             | 持有基金份额总量的数量区间 (万份) |
|--------------------------------|--------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | 0                  |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 0                  |

# § 9 开放式基金份额变动

单位：份

|                                  |                |
|----------------------------------|----------------|
| 基金合同生效日 (2019 年 1 月 24 日) 基金份额总额 | 279,640,252.85 |
| 本报告期期初基金份额总额                     | 17,906,094.84  |
| 本报告期基金总申购份额                      | 7,187,755.98   |
| 减：本报告期基金总赎回份额                    | 9,845,499.42   |
| 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                     | 15,248,351.40  |

## § 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

报告期内本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，无涉及本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

### 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：2019 年 11 月 20 日起至本报告期末。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、托管人及其高级管理人员未有受到稽查或处罚的情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易          |              | 应支付该券商的佣金 |            | 备注 |
|------|--------|---------------|--------------|-----------|------------|----|
|      |        | 成交金额          | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金        | 占当期佣金总量的比例 |    |
| 广发证券 | 2      | 19,694,030.38 | 48.20%       | 17,947.05 | 47.84%     | —  |
| 海通证券 | 2      | 11,644,294.79 | 28.50%       | 10,827.00 | 28.86%     | —  |
| 东方财富 | 2      | 1,750,646.22  | 4.28%        | 1,629.10  | 4.34%      | —  |
| 中金公司 | 2      | 1,260,912.31  | 3.09%        | 1,149.21  | 3.06%      | —  |
| 华宝证券 | 1      | 1,011,183.00  | 2.47%        | 921.52    | 2.46%      | —  |
| 方正证券 | 1      | 724,728.00    | 1.77%        | 660.61    | 1.76%      | —  |
| 长江证券 | 1      | 689,263.00    | 1.69%        | 641.99    | 1.71%      | —  |
| 宏信证券 | 2      | 666,182.79    | 1.63%        | 607.12    | 1.62%      | —  |
| 华创证券 | 2      | 547,249.58    | 1.34%        | 498.62    | 1.33%      | —  |
| 东方证券 | 1      | 511,584.00    | 1.25%        | 466.15    | 1.24%      | —  |
| 国海证券 | 2      | 461,067.00    | 1.13%        | 420.21    | 1.12%      | —  |
| 国元证券 | 2      | 368,716.00    | 0.90%        | 336.00    | 0.90%      | —  |
| 中信建投 | 1      | 326,457.00    | 0.80%        | 303.99    | 0.81%      | —  |
| 申万宏源 | 3      | 290,684.36    | 0.71%        | 270.74    | 0.72%      | —  |
| 天风证券 | 3      | 222,935.00    | 0.55%        | 203.17    | 0.54%      | —  |
| 浙商证券 | 2      | 179,252.48    | 0.44%        | 163.38    | 0.44%      | —  |
| 开源证券 | 2      | 112,571.00    | 0.28%        | 103.61    | 0.28%      | —  |
| 中泰证券 | 1      | 111,758.65    | 0.27%        | 104.07    | 0.28%      | —  |
| 光大证券 | 2      | 101,915.00    | 0.25%        | 92.87     | 0.25%      | —  |
| 国信证券 | 1      | 99,311.00     | 0.24%        | 92.49     | 0.25%      | —  |
| 财通证券 | 2      | 81,829.00     | 0.20%        | 76.21     | 0.20%      | —  |
| 安信证券 | 2      | —             | —            | —         | —          | —  |
| 国金证券 | 2      | —             | —            | —         | —          | —  |
| 国联证券 | 3      | —             | —            | —         | —          | —  |
| 国泰君安 | 1      | —             | —            | —         | —          | —  |
| 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 | - | - | - | - | - |
| 兴业证券  | 2 | - | - | - | - | - |
| 招商证券  | 1 | - | - | - | - | - |
| 中信金通  | 1 | - | - | - | - | - |
| 中信证券  | 1 | - | - | - | - | - |
| 中银国际  | 2 | - | - | - | - | - |

注：基金管理人选择交易单元的标准和程序如下：

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

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

2. 本基金本报告期券商交易单元新增：天风证券、国联证券、开源证券、财通证券、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

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 |              | 债券回购交易 |                | 权证交易 |              |
|------|------|--------------|--------|----------------|------|--------------|
|      | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额   | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 广发证券 | -    | -            | -      | -              | -    | -            |
| 海通证券 | -    | -            | -      | -              | -    | -            |
| 东方财富 | -    | -            | -      | -              | -    | -            |
| 中金公司 | -    | -            | -      | -              | -    | -            |
| 华宝证券 | -    | -            | -      | -              | -    | -            |

|       |   |   |   |   |   |   |
|-------|---|---|---|---|---|---|
| 方正证券  | - | - | - | - | - | - |
| 长江证券  | - | - | - | - | - | - |
| 宏信证券  | - | - | - | - | - | - |
| 华创证券  | - | - | - | - | - | - |
| 东方证券  | - | - | - | - | - | - |
| 国海证券  | - | - | - | - | - | - |
| 国元证券  | - | - | - | - | - | - |
| 中信建投  | - | - | - | - | - | - |
| 申万宏源  | - | - | - | - | - | - |
| 浙商证券  | - | - | - | - | - | - |
| 中泰证券  | - | - | - | - | - | - |
| 光大证券  | - | - | - | - | - | - |
| 国信证券  | - | - | - | - | - | - |
| 天风证券  | - | - | - | - | - | - |
| 安信证券  | - | - | - | - | - | - |
| 国金证券  | - | - | - | - | - | - |
| 国联证券  | - | - | - | - | - | - |
| 国泰君安  | - | - | - | - | - | - |
| 华金证券  | - | - | - | - | - | - |
| 太平洋证券 | - | - | - | - | - | - |
| 新时代证券 | - | - | - | - | - | - |
| 兴业证券  | - | - | - | - | - | - |
| 招商证券  | - | - | - | - | - | - |
| 中信金通  | - | - | - | - | - | - |
| 中信证券  | - | - | - | - | - | - |
| 中银国际  | - | - | - | - | - | - |

## 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 股质量价值指数证券投资基金 (LOF) 2020 年第 4 季度报告     | 基金管理人网站                           | 2021-1-22 |
| 3  | 华宝基金管理有限公司华宝标普中国 A 股质量价值指数证券投资基金 (LOF) 基金经理变更公告 | 基金管理人网站, 上海证券报                    | 2021-3-8  |

|    |                                                                                    |                                   |           |
|----|------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------|-----------|
| 4  | 华宝标普中国 A 股质量价值指数证券投资基金 (LOF) 招募说明书 (更新)                                            | 基金管理人网站                           | 2021-3-10 |
| 5  | 华宝标普中国 A 股质量价值指数证券投资基金 (LOF) 基金产品资料概要 (更新)                                         | 基金管理人网站                           | 2021-3-10 |
| 6  | 华宝标普中国 A 股质量价值指数证券投资基金 (LOF) 2020 年年度报告                                            | 基金管理人网站                           | 2021-3-31 |
| 7  | 华宝标普中国 A 股质量价值指数证券投资基金 (LOF) 基金合同                                                  | 基金管理人网站                           | 2021-3-31 |
| 8  | 华宝标普中国 A 股质量价值指数证券投资基金 (LOF) 招募说明书 (更新)                                            | 基金管理人网站                           | 2021-3-31 |
| 9  | 华宝标普中国 A 股质量价值指数证券投资基金 (LOF) 基金产品资料概要 (更新)                                         | 基金管理人网站                           | 2021-3-31 |
| 10 | 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 |
| 11 | 华宝标普中国 A 股质量价值指数证券投资基金 (LOF) 招募说明书 (更新)                                            | 基金管理人网站                           | 2021-4-2  |
| 12 | 华宝标普中国 A 股质量价值指数证券投资基金 (LOF) 基金产品资料概要 (更新)                                         | 基金管理人网站                           | 2021-4-2  |
| 13 | 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 |
| 14 | 华宝标普中国 A 股质量价值指数证券投资基金 (LOF) 2021 年第 1 季度报告                                        | 基金管理人网站                           | 2021-4-22 |
| 15 | 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 |
| 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 | 2021-5-28 |

## § 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 股质量价值指数证券投资基金（LOF）基金合同；  
华宝标普中国 A 股质量价值指数证券投资基金（LOF）招募说明书；  
华宝标普中国 A 股质量价值指数证券投资基金（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