

华宝沪深300指数增强型发起式证券投资 基金

2021年中期报告

2021年6月30日

基金管理人：华宝基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2021年8月27日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本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。

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2021年1月1日起至06月30日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

1.2 目录

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

2.2 基金产品说明

2.3 基金管理人和基金托管人

2.4 信息披露方式

2.5 其他相关资料

§ 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

3.2 基金净值表现

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

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

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明

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

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

6.2 利润表

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

6.4 报表附注

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

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

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

[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](#)

[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](#)

[7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明](#)

[7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明](#)

[7.12 投资组合报告附注](#)

§ 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](#)

[8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况](#)

[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](#)

[8.4 发起式基金发起资金持有份额情况](#)

§ 9 开放式基金份额变动

§ 10 重大事件揭示

[10.1 基金份额持有人大会决议](#)

[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](#)

[10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼](#)

[10.4 基金投资策略的改变](#)

[10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况](#)

[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](#)

[10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况](#)

[10.8 其他重大事件](#)

§ 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](#)

§ 12 备查文件目录

[12.1 备查文件目录](#)

[12.2 存放地点](#)

[12.3 查阅方式](#)

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华宝沪深300指数增强型发起式证券投资基金	
基金简称	华宝沪深300增强	
基金主代码	003876	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016年12月9日	
基金管理人	华宝基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	293,357,799.11份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华宝沪深300增强	华宝沪深300增强C
下属分级基金的交易代码	003876	007404
报告期末下属分级基金的份额总额	264,764,075.59份	28,593,723.52份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为沪深300指数增强型基金，在实现对沪深300指数有效跟踪的基础上，通过数量化的方法进行积极的组合配置和管理，力争实现稳定的优于标的指数的投资收益，追求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金主要投资于沪深300指数成分股及备选股票。同时，基于流动性管理及策略性投资的需要，本基金也会在控制风险前提下适度投资于债券、股指期货、货币市场工具及其他金融工具。本基金主要采用量化行业配置模型和量化Alpha选股模型构建指数增强股票组合，在控制跟踪偏离度的前提下力争实现超额表现。
业绩比较基准	沪深300指数收益率*95%+1.5%（指年收益率，评价时按期间折算）。
风险收益特征	本基金为股票型基金，属于高预期风险、高预期收益的证券投资基金品种，其预期风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华宝基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责	姓名	周雷	秦一楠

人	联系电话	021-38505888	010-66060069
	电子邮箱	xxpl@fsfund.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-700-5588、400-820-5050、021-38924558	95599
传真		021-38505777	010-68121816
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	北京市东城区建国门内大街69号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区世纪大道100号上海环球金融中心58楼	北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座F9
邮政编码		200120	100031
法定代表人		XIAOYI HELEN HUANG	谷澍

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)	
	华宝沪深300增强	华宝沪深300增强C
本期已实现收益	48,117,309.95	9,441,061.20
本期利润	23,665,427.05	-686,876.05
加权平均基金份额本期利润	0.0844	-0.0123
本期加权平均净值利润率	3.92%	-0.57%
本期基金份额净值增长率	3.61%	3.40%
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	220,987,170.48	23,376,344.81

期末可供分配基金份额利润	0.8347	0.8175
期末基金资产净值	582,982,272.56	62,458,634.45
期末基金份额净值	2.2019	2.1843
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	120.19%	85.72%

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

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

3、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）。

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。

5、华宝沪深300增强C成立于2019年5月24日。

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

华宝沪深300增强

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
					⑤	⑥
过去一个月	0.43%	0.88%	-1.79%	0.76%	2.2 2%	0.1 2%
过去三个月	6.62%	0.98%	3.70%	0.93%	2.9 2%	0.0 5%
过去六个月	3.61%	1.29%	1.02%	1.25%	2.5 9%	0.0 4%
过去一年	36.59%	1.30%	26.03%	1.27%	10. 56%	0.0 3%

过去三年	93.54%	1.34%	53.03%	1.30%	40.51%	0.04%
自基金合同生效起至今	120.19%	1.19%	58.47%	1.15%	61.72%	0.04%

华宝沪深300增强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	0.40%	0.88%	-1.79%	0.76%	2.19%	0.12%
过去三个月	6.51%	0.98%	3.70%	0.93%	2.81%	0.05%
过去六个月	3.40%	1.29%	1.02%	1.25%	2.38%	0.04%
过去一年	36.05%	1.30%	26.03%	1.27%	10.02%	0.03%
自基金合同生效起至今	85.72%	1.24%	47.49%	1.20%	38.23%	0.04%

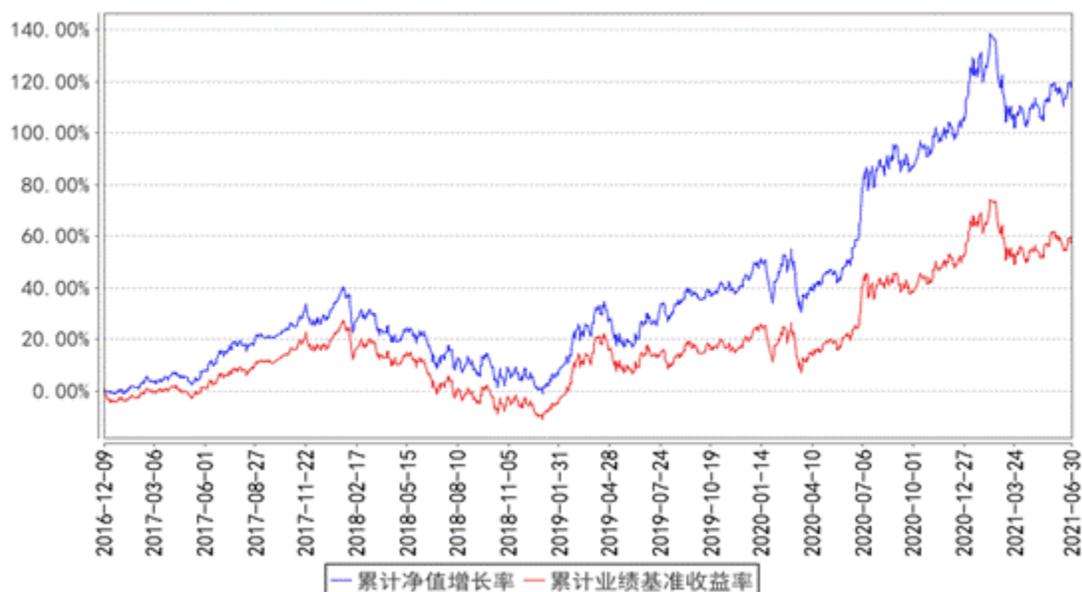
注：1、本基金业绩比较基准为：沪深300指数收益率*95%+1.5%（指年收益率，评价时按期间折算）。

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

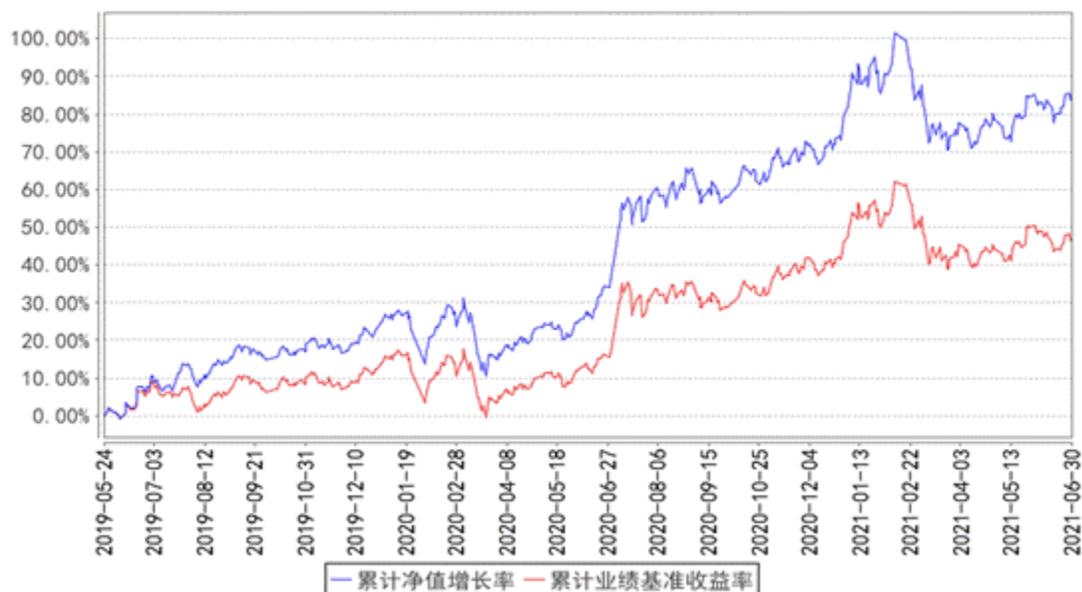
3.2.2

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

华宝沪深300增强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



华宝沪深300增强C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同生效于2016年12月9日，按照基金合同的约定，自基金成立日期的6个月内达到规定的资产组合，截至2017年6月9日，本基金已达到合同规定的资产配置比例。

2、华宝沪深300增强C成立于2019年5月24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5月24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		
王正	本基金基金经理	2020年1月2日	-	8年	硕士。2012年7月加入华宝基金管理有限公司，先后担任助理量化分析师、分析师、基金经理助理等职务。2020年1月起任华宝量化对冲策略混合型发起式证券投资基金、华宝沪深300指数增强型发起式证券投资基金基金经理。2021年1月起任华宝智慧产业灵活配置混合型证券投资基金、华宝第三产业灵活配置混合型证券投资基金、华宝中证500指数增强型发起式证券投资基金基金经理。2021年6月起任华宝安盈混合型证券投资基金基金经理。
徐林明	本基金基金经理、量化投资部总经理、量化投资总监、董事总经理	2016年12月9日	-	18年	硕士。曾在兴业证券、凯龙财经（上海）有限公司、中原证券从事金融工程研究工作。2005年8月加入华宝基金管理有限公司，先后担任金融工程部数量分析师、金融工程部副总经理、投资副总监、量化投资部总经理等职务。现任量化投资部总经理、量化投资总监、董事总经理。2009年9月至2015年11月任华宝中证100指数型证券投资基金基金经理。2010年4月至2015年11月任上证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。2014年9月起任华宝量化对冲策略混合型发起式证券投资基金基金经理。2015年4月至2020年2月任华宝事件驱动混合型证券投资基金基金经理。2016年12月起任华宝沪深300指数增强型发起式证券投资基金基金经理。2019年2月起任华宝科技先锋混合型证券投资基金基金经理。
唐雪倩	本基金的基金经理助理	2018年1月23日	-	5年	硕士。2015年加入华宝基金管理有限公司，先后担任助理量化分析师、分析师、基金经理助理等。2018年1月至2018年6月任华宝新动力一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理。2018年1月至2018年7月任华宝新回报一年定期开放混合型证券投资基金基金经理助理。2018年1月至2018年8月任华宝新优选一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理。2018年1月起任华宝量化对冲策略混合型发起式证券投资基金、华宝沪深300指数增强型发起式证券投资基金、华宝新价值灵活配置混合型证券投资基金、华宝新机遇灵活配置混合型证

				券投资基金（LOF）、华宝新起点灵活配置混合型证券投资基金、华宝新飞跃灵活配置混合型证券投资基金。2019年2月起任华宝科技先锋混合型证券投资基金基金经理助理。2019年7月起任华宝新活力灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理。
--	--	--	--	--

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、《华宝沪深300指数增强型发起式证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋取最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，基金管理人通过严格执行投资决策委员会议事规则、公司股票库管理制度、中央交易室制度、防火墙机制、系统中的公平交易程序、每日交易日结报告、定期基金投资绩效评价等机制，确保所管理的所有投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。同时，基金管理人严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定和公司内部制度要求，分析了本公司旗下所有投资组合之间的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异以及连续四个季度期间内、不同时间窗下同向交易的交易价差；分析结果未发现异常情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

本报告期内，本基金未发现异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

宏观环境来看，随着疫苗接种的推进，新冠疫情逐渐得到控制。上半年全球经济持续复苏，国内工业生产及出口较为景气。但疫情期间扩张的流动性导致大宗商品普遍上涨，以PPI为代表的通胀指标快速上升。市场方面，上半年大盘整体表现不俗，沪深300指数累计上涨0.24%，中证500指数上涨6.93%，创业板指上涨17.22%，但波动加剧。在经济复苏和通胀压力、流动性收紧预期的矛盾中市场呈现了较大的结构性调整，风格出现了明显切换。行业层面，与碳中和及国产替代相关的电气设备、电子等高景气行业以及与大宗商品涨价相关的钢铁、煤炭、有色、化工等周期性行业涨幅居前，而景气度弱的家用电器、保险、农林牧渔、房地产等板块跌幅居前。风格层面，上半年整体成长因子强于价值因子，尤其是二季度以来成长、分析师预期因子等持续强势，另外大小盘风格的切换也反映了市值下沉的资金趋势。总体而言，当前市场分化较为极致，业绩的成长性、持续性和确定性是市场非常看重的要素，盈利能力与景气延续性仍然是判断股票投资价值的重要方向。

沪深300增强基金运用量化Alpha多因子选股模型和行业配置模型进行股票筛选和权重配置，在沪深300成分股及备选股内精选业绩和估值相匹配、基本面优质的股票，在有限的行业偏离、个股偏离下实现了在紧密跟踪沪深300指数的基础上获取稳定的超越指数的表现。另外，基金也通过积极参与新股申购等低风险机会来增厚业绩。

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3.61%；本报告期基金份额C净值收益率为3.40%，同期业绩比较基准收益率为1.02%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，中国仍然是疫情控制最好、经济复苏最快的经济体，国内经济仍将保持较强的活力与韧性，A股的优质资产在全球横向比较来看仍有极强的配置吸引力，我们对市场的长期前景保持乐观态度。但另一方面，尽管货币政策大概率保持平稳，但通胀的压制依然存在，市场会容忍部分高景气板块的高估值，但不会有全面的估值扩张。风格的切换可能仍会往极端的方向演绎，市场波动也会随之加剧，在这种背景下我们将更加重视盈利的确定性、估值的合理性和成长的可持续性。在行业方面，一方面符合经济结构化转型及政策鼓励方向的电气设备新能源、半导体、高端制造等长逻辑板块仍然有望保持较高的景气度；另一方面，前期调整充分、基本面预期边际改善的传统经济板块可能存在估值修复的机会，我们对此保持密切关注。

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

(1) 日常估值流程

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

(2) 特殊业务估值流程

根据中国证券监督管理委员会[2017]13

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末进行利润分配，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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—

华宝基金管理有限公司2021年1月1日至2021年6月30日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

5.2

托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本托管人认为，

华宝基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，华宝基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§ 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：华宝沪深300指数增强型发起式证券投资基金

报告截止日：2021年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	50,214,369.79	63,329,188.18
结算备付金		18,764,670.28	9,993,852.91
存出保证金		2,880,251.95	5,784,040.70
交易性金融资产	6.4.7.2	587,598,159.18	640,109,070.83
其中：股票投资		585,720,373.04	625,288,560.03
基金投资		-	-
债券投资		1,877,786.14	14,820,510.80
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		38,452,321.84	620,228.90
应收利息	6.4.7.5	19,759.75	338,614.75
应收股利		-	-
应收申购款		2,099,718.99	1,065,577.71
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		700,029,251.78	721,240,573.98
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		-	1,723,512.76
应付赎回款		49,377,477.19	3,121,090.49
应付管理人报酬		584,778.22	579,929.24
应付托管费		87,716.72	86,989.39
应付销售服务费		34,802.95	37,656.29

应付交易费用	6.4.7.7	4,374,336.80	2,266,106.48
应交税费		3.04	9,367.72
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	129,229.85	209,964.04
负债合计		54,588,344.77	8,034,616.41
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	293,357,799.11	335,908,917.77
未分配利润	6.4.7.10	352,083,107.90	377,297,039.80
所有者权益合计		645,440,907.01	713,205,957.57
负债和所有者权益总计		700,029,251.78	721,240,573.98

注：

报告截止日2021年06月30日，基金份额总额293,357,799.11份，其中华宝沪深300增强基金份额总额264,764,075.59份，基金份额净值2.2019元。华宝沪深300增强C基金份额总额28,593,723.52份，基金份额净值2.1843元；

6.2 利润表

会计主体：华宝沪深300指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：2021年1月1日至2021年6月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2021年1月1日至2021年6月30日	2020年1月1日至2020年6月30日
一、收入		31,070,368.06	42,513,729.34
1. 利息收入		500,221.33	545,341.78
其中：存款利息收入	6.4.7.11	379,923.78	110,860.73
债券利息收入		120,297.55	380,281.80
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	54,199.25
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		64,197,671.18	28,591,127.21
其中：股票投资收益	6.4.7.12	57,168,918.41	23,685,853.59
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	299,087.32	14,760.77
资产支持证券投资收	6.4.7.13	-	-

益	.5		
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	1,991,542.15	552,182.04
股利收益	6.4.7.16	4,738,123.30	4,338,330.81
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-34,579,820.15	12,552,426.35
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	952,295.70	824,834.00
减：二、费用		8,091,817.06	4,660,595.69
1. 管理人报酬	6.4.10.2 .1	3,605,092.76	2,165,272.92
2. 托管费	6.4.10.2 .2	540,763.88	324,791.00
3. 销售服务费	6.4.10.2 .3	237,457.77	42,653.33
4. 交易费用	6.4.7.19	3,537,505.90	1,996,077.52
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		13,926.35	1,988.28
7. 其他费用	6.4.7.20	157,070.40	129,812.64
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		22,978,551.00	37,853,133.65
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		22,978,551.00	37,853,133.65

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华宝沪深300指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：2021年1月1日至2021年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	335,908,917.77	377,297,039.80	713,205,957.57
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	22,978,551.00	22,978,551.00
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）	-	-	-
	42,551,11	48,192,48	90,743,60

	8.66	2.90	1.56
其中：1. 基金申购款	162,495,286.64	193,166,598.46	355,661,885.10
2. 基金赎回款	205,046,405.30	241,359,081.36	446,405,486.66
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）	293,357,799.11	352,083,107.90	645,440,907.01
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）	244,217,721.70	116,166,262.57	360,383,984.27
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	37,853,133.65	37,853,133.65
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）	36,098,722.03	17,445,796.17	53,544,518.20
其中：1. 基金申购款	231,945,933.92	105,374,705.04	337,320,638.96
2. 基金赎回款	195,847,211.89	87,928,908.87	283,776,120.76
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）	280,316,443.73	171,465,192.39	451,781,636.12

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1

至 6.4

财务报表由下列负责人签署：

黄小慧

向辉

张幸骏

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华宝沪深300指数增强型发起式证券投资基金（原名华宝兴业沪深300指数增强型发起式证券投资基金，以下简称“本基金”）系由基金管理人华宝基金管理有限公司（原华宝兴业基金

管理有限公司，已于2017年10月17日办理完成工商变更登记）依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《华宝兴业沪深300指数增强型发起式证券投资基金基金合同》（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[2016]2663号文批准公开募集。本基金为契约型开放式基金、发起式基金，存续期限为不定期，首次设立募集基金份额为10,000,450.05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（16）第0862号的验资报告。基金合同于2016年12月9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，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《华宝基金管理有限公司关于旗下基金更名事宜的公告》，华宝兴业沪深300指数增强型发起式证券投资基金于2017年12月30日起更名为华宝沪深300指数增强型发起式证券投资基金。

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《华宝沪深300指数增强型发起式证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包含中小板、创业板、存托凭证及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（含国债、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、分离交易可转债、可交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、货币市场工具、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金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，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

根据《华宝基金管理有限公司关于华宝沪深300指数增强型发起式证券投资基金增加C类基金份额并修改基金合同的公告》，自2019年5月24日起，增设C类基金份额。增加C类基金份额后，本基金原有基金份额为A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。不从本类别基金资产中计提销售服务费，且收取申购费的基金份额类别为A类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费，且不收取申购费的基金份额类别为C类基金份额。两类基金份额分设不同的基金代码，并分别计算并公布基金份额净值和基金份额累计净值。

本基金的投资组合比例为：本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产的80%，其中投资于沪深300指数成分股及备选成分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，基金保留的现金（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的比例合计不低于基金资产净值的5%。本基金投资股指期货、权证及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

本基金的业绩比较准为：沪深300指数收益率 \times 95%+1.5%（指年收益率，评价时按期间折算）。

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

6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金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，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、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

（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 2021年6月30日
活期存款	50,214,369.79
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	50,214,369.79

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	513,386,432.14	585,720,373.04	72,333,940.90
贵金属投资- 金交所黄金合约	-	-	-

债券	交易所市场	1,534,196.98	1,877,786.14	343,589.16
	银行间市场	-	-	-
	合计	1,534,196.98	1,877,786.14	343,589.16
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		514,920,629.12	587,598,159.18	72,677,530.06

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	23,444,065.32	-	-	-
其中：股指期货投资	23,444,065.32	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	23,444,065.32	-	-	-

注：衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为0。于本报告期末，本基金持有15手IF2109多头持仓，合约市值为23,248,800.00元，公允价值变动-195,265.32元；。上述股指期货持仓抵销相关期货暂收款195,265.32元后的净额为0。

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有买入返售金融资产。

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	11,316.77
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	7,824.34
应收债券利息	578.04
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	40.60
合计	19,759.75

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	4,374,336.80
银行间市场应付交易费用	-
合计	4,374,336.80

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	6,803.75
应付证券出借违约金	-
预提费用	94,219.55
应付指数使用费	28,206.55
合计	129,229.85

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

华宝沪深300增强

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	283,257,214.04	283,257,214.04
本期申购	117,495,180.72	117,495,180.72
本期赎回（以“-”号填列）	-135,988,319.17	-135,988,319.17

-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	264,764,075.59	264,764,075.59

华宝沪深300增强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	52,651,703.73	52,651,703.73
本期申购	45,000,105.92	45,000,105.92
本期赎回（以“-”号填列）	-69,058,086.13	-69,058,086.13
-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	28,593,723.52	28,593,723.52

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

华宝沪深300增强

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	187,771,056.40	130,953,779.62	318,724,836.02
本期利润	48,117,309.95	-24,451,882.90	23,665,427.05
本期基金份额交易产生的变动数	-14,901,195.87	-9,270,870.23	-24,172,066.10
其中：基金申购款	87,434,682.49	51,740,069.89	139,174,752.38
基金赎回款	-102,335,878.36	-61,010,940.12	-163,346,818.48
本期已分配利润	-	-	-
本期末	220,987,170.48	97,231,026.49	318,218,196.97

华宝沪深300增强C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	34,286,650.84	24,285,552.94	58,572,203.78
本期利润	9,441,061.20	-10,127,937.25	-686,876.05
本期基金份额交易产生的变动数	-20,351,367.23	-3,669,049.57	-24,020,416.80
其中：基金申购款	32,430,292.25	21,561,553.83	53,991,846.08
基金赎回款	-52,781,659.48	-25,230,603.40	-78,012,262.88
本期已分配利润	-	-	-

本期末	23,376,344.81	10,488,566.12	33,864,910.93
-----	---------------	---------------	---------------

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	285,357.02	
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	92,648.89	
其他	1,917.87	
合计	379,923.78	

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	57,168,918.41	
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	57,168,918.41	

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	1,179,768,600.28	
减：卖出股票成本总额	1,122,599,681.87	
买卖股票差价收入	57,168,918.41	

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

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2021年1月1日至2021年6月30日
债券投资收益—— 买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	299,087.32
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	299,087.32

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	56,180,667.10
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	55,240,207.12
减：应收利息总额	641,372.66
买卖债券差价收入	299,087.32

6.4.7.13.3 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

无。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2021年1月1日至2021年6月30日
股指期货投资收益	1,991,542.15

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	4,738,123.30
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	4,738,123.30

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
1. 交易性金融资产	-32,094,594.83
股票投资	-32,417,704.29
债券投资	323,109.46
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-2,485,225.32
权证投资	-
期货投资	-2,485,225.32
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	-34,579,820.15

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
基金赎回费收入	819,903.58
基金转换费收入	132,392.12
合计	952,295.70

注：（1）本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的25%归入基金资产。

（2）本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中不低于转出基金的赎回费的25%归入转出基金的基金资产。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
交易所市场交易费用	3,517,141.69

银行间市场交易费用	-
期货交易费用	20,364.21
合计	3,537,505.90

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
审计费用	34,712.18
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	5,169.26
指数使用费	57,681.59
合计	157,070.40

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(以下简称“华宝基金”)	基金管理人、基金销售机构、基金注册登记机构
中国农业银行股份有限公司(以下简称“中国农业银行”)	基金托管人
华宝信托有限责任公司(以下简称“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 Mangement, L.P.)	基金管理人的股东
中国宝武钢铁集团有限公司(以下简称“宝武集团”)	华宝信托的最终控制人

华宝证券股份有限公司(以下简称“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(以下简称“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(以下简称“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

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行交易。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30 日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30 日
当期发生的基金应支付的管理费	3,605,092.76	2,165,272.92
其中：支付销售机构的客户维护费	762,467.13	346,040.42

注：支付基金管理人华宝兴业的基金管理人报酬按前一日基金资产净值1.0%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：日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×1.0%÷当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30 日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30 日
当期发生的基金应支付的托管费	540,763.88	324,791.00

注：支付基金托管人中国农业银行的基金托管费按前一日基金资产净值0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.15%÷当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华宝沪深300增强	华宝沪深300增强C	合计
华宝证券	-	3,766.54	3,766.54
华宝基金	-	44,970.03	44,970.03
合计	-	48,736.57	48,736.57
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		
	华宝沪深300增强	华宝沪深300增强C	合计
华宝基金	-	14,938.56	14,938.56
华宝证券	-	176.52	176.52
合计	-	15,115.08	15,115.08

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：

$$\text{日基金销售服务费} = \text{前一日基金资产净值} \times \text{约定年费率} / \text{当年天数}。$$

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1

与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
	华宝沪深300增强	华宝沪深300增强C
基金合同生效日（2016年12月9日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	478,795.12	-
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	478,795.12	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.18%	-
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
	华宝沪深300增强	华宝沪深300增强C
基金合同生效日（2016年12月9日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	10,479,245.17	-
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	10,479,245.17	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	3.90%	-

代码	名称	认购日	日	型	价格	单价	(单位:股)	成本总额	总额	注
300614	百川畅银	2021年5月18日	2021年11月25日	新股锁定	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02	-
300919	中伟股份	2020年12月15日	2021年7月2日	新股锁定	24.6	163	610	15,006.00	99,430.00	-
300926	博俊科技	2020年12月29日	2021年7月12日	新股锁定	10.76	22.2	359	3,862.84	7,969.80	-
300927	江天化学	2020年12月29日	2021年7月7日	新股锁定	13.39	30.1	217	2,905.63	6,531.70	-
300929	华骐环保	2021年1月12日	2021年7月21日	新股锁定	13.87	29.55	183	2,538.21	5,407.65	-
300930	屹通新材	2021年1月13日	2021年7月21日	新股锁定	13.11	24.48	322	4,221.42	7,882.56	-
300931	通用电梯	2021年1月13日	2021年7月21日	新股锁定	4.31	13.11	672	2,896.32	8,809.92	-
300933	中辰股份	2021年1月15日	2021年7月22日	新股锁定	3.37	10.44	1,112	3,747.44	11,609.28	-
300937	药易购	2021年1月20日	2021年7月27日	新股锁定	12.25	53.71	244	2,989.00	13,105.24	-
300940	南极光	2021年1月27日	2021年8月3日	新股锁定	12.76	43.38	307	3,917.32	13,317.66	-
300942	易瑞生物	2021年2月2日	2021年8月9日	新股锁定	5.31	28.52	443	2,352.33	12,634.36	-

300943	春晖智控	2021年2月3日	2021年8月10日	新股锁定	9.79	23.01	255	2,496.45	5,867.55	-
300945	曼卡龙	2021年2月3日	2021年8月10日	新股锁定	4.56	18.88	474	2,161.44	8,949.12	-
300948	冠中生态	2021年2月18日	2021年8月25日	新股锁定	13	27.42	324	2,808.00	8,884.08	-
300950	德固特	2021年2月24日	2021年9月3日	新股锁定	8.41	39.13	219	1,841.79	8,569.47	-
300952	恒辉安防	2021年3月3日	2021年9月13日	新股锁定	11.72	27.08	340	3,984.80	9,207.20	-
300953	震裕科技	2021年3月11日	2021年9月22日	新股锁定	28.77	99.85	240	6,904.80	23,964.00	-
300955	嘉亨家化	2021年3月16日	2021年9月24日	新股锁定	16.53	46.07	232	3,834.96	10,688.24	-
300956	英力股份	2021年3月16日	2021年9月27日	新股锁定	12.85	25.8	371	4,767.35	9,571.80	-
300957	贝泰妮	2021年3月18日	2021年9月27日	新股锁定	47.33	251.96	543	25,700.19	136,814.28	-
300958	建工修复	2021年3月18日	2021年9月29日	新股锁定	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00	-
300960	通业科技	2021年3月22日	2021年9月29日	新股锁定	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04	-
300961	深水海纳	2021年3月	2021年9月30日	新股锁定	8.48	22.07	394	3,341.12	8,695.58	-

		月23日	日								
300962	中金辐照	2021年3月29日	2021年10月11日	新股锁定	3.4	16.37	576	1,958.40	9,429.12	-	
300963	中洲特材	2021年3月30日	2021年10月11日	新股锁定	12.13	22.49	283	3,432.79	6,364.67	-	
300966	共同药业	2021年3月31日	2021年10月11日	新股锁定	8.24	31.54	286	2,356.64	9,020.44	-	
300967	晓鸣股份	2021年4月2日	2021年10月13日	新股锁定	4.54	11.54	507	2,301.78	5,850.78	-	
300968	格林精密	2021年4月6日	2021年10月15日	新股锁定	6.87	12.07	1,162	7,982.94	14,025.34	-	
300971	博亚精工	2021年4月7日	2021年10月15日	新股锁定	18.24	28.29	245	4,468.80	6,931.05	-	
300972	万辰生物	2021年4月8日	2021年10月19日	新股锁定	7.19	12.65	430	3,091.70	5,439.50	-	
300973	立高食品	2021年4月8日	2021年10月15日	新股锁定	28.28	115.71	360	10,180.80	41,655.60	-	
300975	商络电子	2021年4月14日	2021年10月21日	新股锁定	5.48	13.03	492	2,696.16	6,410.76	-	
300978	东箭科技	2021年4月15日	2021年10月26日	新股锁定	8.42	13.6	593	4,993.06	8,064.80	-	
300979	华利集团	2021年4月15日	2021年10月26日	新股锁定	33.22	87.5	907	30,130.54	79,362.50	-	

300981	中红医疗	2021年4月19日	2021年10月27日	新股锁定	48.59	90.39	549	26,675.91	49,624.11	-
300982	苏文电能	2021年4月19日	2021年10月27日	新股锁定	15.83	45.29	317	5,018.11	14,356.93	-
300985	致远新能	2021年4月21日	2021年10月29日	新股锁定	24.9	24.81	295	7,345.50	7,318.95	-
300986	志特新材	2021年4月21日	2021年11月1日	新股锁定	14.79	30.57	264	3,904.56	8,070.48	-
300987	川网传媒	2021年4月28日	2021年11月11日	新股锁定	6.79	26.81	301	2,043.79	8,069.81	-
300991	创益通	2021年5月12日	2021年11月22日	新股锁定	13.06	26.51	254	3,317.24	6,733.54	-
300992	泰福泵业	2021年5月17日	2021年11月25日	新股锁定	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00	-
300993	玉马遮阳	2021年5月17日	2021年11月24日	新股锁定	12.1	19.29	410	4,961.00	7,908.90	-
300995	奇德新材	2021年5月17日	2021年11月26日	新股锁定	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	-
300996	普联软件	2021年5月26日	2021年12月3日	新股锁定	20.81	42.23	241	5,015.21	10,177.43	-
300997	欢乐家	2021年5月26日	2021年12月2日	新股锁定	4.94	13.05	928	4,584.32	12,110.40	-
300998	宁波方正	2021年5月	2021年12月2日	新股锁定	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	-

		月25日	日								
301002	崧盛股份	2021年5月27日	2021年12月7日	新股锁定	18.71	57.62	201	3,760.71	11,581.62	-	
301004	嘉益股份	2021年6月18日	2021年12月27日	新股锁定	7.81	21.94	312	2,436.72	6,845.28	-	
301007	德迈仕	2021年6月4日	2021年12月16日	新股锁定	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	-	
301010	晶雪节能	2021年6月9日	2021年12月20日	新股锁定	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	-	
301011	华立科技	2021年6月9日	2021年12月17日	新股锁定	14.2	33.84	175	2,485.00	5,922.00	-	
301012	扬电科技	2021年6月15日	2021年12月22日	新股锁定	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20	-	
301015	百洋医药	2021年6月22日	2021年12月30日	新股锁定	7.64	38.83	462	3,529.68	17,939.46	-	
301016	雷尔伟	2021年6月23日	2021年12月30日	新股锁定	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50	-	
301017	漱玉平民	2021年6月23日	2021年7月5日	新股流通受限	8.86	8.86	4,995	44,255.70	44,255.70	-	
301017	漱玉平民	2021年6月23日	2022年1月5日	新股锁定	8.86	8.86	555	4,917.30	4,917.30	-	
301018	申菱环境	2021年6月28日	2021年7月7日	新股流通受限	8.29	8.29	7,029	58,270.41	58,270.41	-	

301018	申菱环境	2021年6月28日	2022年1月7日	新股锁定	8.29	8.29	782	6,482.78	6,482.78	-
301021	英诺激光	2021年6月28日	2021年7月6日	新股流通受限	9.46	9.46	2,609	24,681.14	24,681.14	-
301021	英诺激光	2021年6月28日	2022年1月6日	新股锁定	9.46	9.46	290	2,743.40	2,743.40	-
605162	新中港	2021年6月29日	2021年7月7日	新股流通受限	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39	-
605287	德才股份	2021年6月28日	2021年7月6日	新股流通受限	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-
688079	美迪凯	2021年2月23日	2021年9月2日	新股锁定	10.19	18.4	10,622	108,238.18	195,444.80	-
688087	英科再生	2021年6月30日	2021年7月9日	新股流通受限	21.96	21.96	2,469	54,219.24	54,219.24	-
688226	威腾电气	2021年6月28日	2021年7月7日	新股流通受限	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	-
688239	航宇科技	2021年6月25日	2021年7月5日	新股流通受限	11.48	11.48	4,926	56,550.48	56,550.48	-
688319	欧林生物	2021年5月31日	2021年12月8日	新股锁定	9.88	27.34	3,412	33,710.56	93,284.08	-
688355	明志科技	2021年4月30日	2021年11月12日	新股锁定	17.65	23.8	2,710	47,831.50	64,498.00	-
688655	迅捷兴	2021年4月	2021年11月11日	新股锁定	7.59	15.77	3,083	23,399.97	48,618.91	-

		月28日	日							
688665	四方光电	2021年2月2日	2021年8月9日	新股锁定	29.53	129.46	1,687	49,817.11	218,399.02	-
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
123117	健帆转债	2021年6月23日	2021年7月12日	新债未上市	100.00	100.00	688	68,800.00	68,800.00	-
127038	国微转债	2021年6月10日	2021年7月14日	新债未上市	100.00	100.00	1,540	154,000.00	154,000.00	-
113049	长汽转债	2021年6月10日	2021年7月8日	新债未上市	100.00	100.00	660	66,000.00	66,000.00	-

注：（1）基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。

其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

（2）根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期为自发行人股票上市之日起6个月。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

本基金为指数增强型股票基金，在实现对沪深300指数有效跟踪的基础上，通过数量化的方法进行积极的组合配置和管理，力争实现稳定的优于标的指数的投资收益，追求基金资产的长期增值。本基金属于高预期风险、高预期收益的证券投资基金品种，其预期风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资、股指期货等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

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

本基金的基金管理人根据自身经营特点设立顺序递进、权责统一、严密有效的四层监控防线。第一层监控防线为一线岗位自控与互控；第二层防线为大业务板块内部各部门和部门之间的自控和互控；第三层监控防线为风险管理部和合规审计部对各岗位、各部门、各项业务全面实施监督反馈；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信用良好的银行，与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

于本报告期末，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券和资产支持证券占基金资产净值的比例较低，因此无重大信用风险。（上年度末：同）。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末	上年度末
--------	-----	------

	2021年6月30日	2020年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	6,004.20	-
合计	6,004.20	-

注：未评级部分为政策性金融债。债券信用评级取自第三方评级机构的评级。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
AAA	875,615.70	-
AAA以下	996,166.24	-
未评级	-	-
合计	1,871,781.94	-

注：债券信用评级取自第三方评级机构的评级。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的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，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期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

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

本基金所持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。

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、存出保证金、债券投资及应收申购款等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	50,214,369.79	-	-	-	50,214,369.79
结算备付金	18,764,670.28	-	-	-	18,764,670.28
存出保证金	90,395.95	-	-	2,789,856.00	2,880,251.95
交易性金融资产	1,877,786.14	-	-	585,720,373.04	587,598,159.18
应收利息	-	-	-	19,759.75	19,759.75
应收申购款	-	-	-	2,099,718.99	2,099,718.99
应收证券清算款	-	-	-	38,452,321.84	38,452,321.84
资产总计	70,947,222.16	-	-	629,082,029.62	700,029,251.78
负债					
应付赎回款	-	-	-	49,377,477.19	49,377,477.19
应付管理人报酬	-	-	-	584,778.22	584,778.22
应付托管费	-	-	-	87,716.72	87,716.72
应付销售服务费	-	-	-	34,802.95	34,802.95
应付交易费用	-	-	-	4,374,336.80	4,374,336.80
应交税费	-	-	-	3.04	3.04
其他负债	-	-	-	129,229.85	129,229.85
负债总计	-	-	-	54,588,344.77	54,588,344.77
利率敏感度缺口	70,947,222.16	-	-	574,493,684.85	645,440,907.01
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	63,329,188.18	-	-	-	63,329,188.18
结算备付金	9,993,852.91	-	-	-	9,993,852.91
存出保证金	154,022.30	-	-	5,630,018.40	5,784,040.70
交易性金融资产	14,498,550.00	-	321,960.80	625,288,560.03	640,109,070.83
应收利息	-	-	-	338,614.75	338,614.75
应收申购款	8,179.10	-	-	1,057,398.61	1,065,577.71
应收证券清算款	-	-	-	620,228.90	620,228.90
资产总计	87,983,792.49	-	321,960.80	632,934,820.69	721,240,573.98
负债					
应付赎回款	-	-	-	3,121,090.49	3,121,090.49
应付管理人报酬	-	-	-	579,929.24	579,929.24
应付托管费	-	-	-	86,989.39	86,989.39
应付证券清算款	-	-	-	1,723,512.76	1,723,512.76
应付销售服务费	-	-	-	37,656.29	37,656.29
应付交易费用	-	-	-	2,266,106.48	2,266,106.48
应交税费	-	-	-	9,367.72	9,367.72

其他负债	-	-	-	209,964.04	209,964.04
负债总计	-	-	-	8,034,616.41	8,034,616.41
利率敏感度缺口	87,983,792.49	-	321,960.80	624,900,204.28	713,205,957.57

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，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，本基金持有交易性债券投资比例较低(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和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，基金管理人主要运用股指期货等空头工具对持有的股票等权益类多头组合进行对冲操作，规避权益类多头组合的市场系统性风险；同时预留必要的现金，以应对保证金的增加要求或投资者的赎回申请。在股票投资方面，主要采用量化行业配置模型和量化本基金主要采用量化行业配置模型和量化Alpha选股模型构建指数增强股票组合，严格控制运作风险，并根据市场变化趋势，定期对模型进行调整，以改进模型的有效性，最大化超额收益。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金的投资组合比例为：本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产的80%，其中投资于沪深300指数成分股及备选成分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，基金保留的现金（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的比例合计不低于基金资产净值的5%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证

券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日		上年度末 2020年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	585,720,373.04	90.75	625,288,560.03	87.67
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	585,720,373.04	90.75	625,288,560.03	87.67

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%	32,558,065.73	35,979,275.68
	2. 业绩比较基准下降5%	-32,558,065.73	-35,979,275.68

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583,973,164.43元，第二层次的余额为人民币3,624,994.75元，无划分为第三层次的余额（于上年度末，属于第一层次的余额为人民币621,210,322.44元，属于第二层次的余额为人民币18,898,748.39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

截至资产负债表日，本基金无需要披露的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	585,720,373.04	83.67
	其中：股票	585,720,373.04	83.67
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,877,786.14	0.27
	其中：债券	1,877,786.14	0.27

	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	68,979,040.07	9.85
8	其他各项资产	43,452,052.53	6.21
9	合计	700,029,251.78	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	11,861,093.00	1.84
C	制造业	299,047,174.98	46.33
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,623,376.00	1.03
E	建筑业	4,518,405.00	0.70
F	批发和零售业	4,080,775.80	0.63
G	交通运输、仓储和邮政业	13,006,452.00	2.02
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,749,310.40	1.36
J	金融业	127,828,851.92	19.80
K	房地产业	7,370,396.00	1.14
L	租赁和商务服务业	13,625,613.00	2.11
M	科学研究和技术服务业	11,731,722.80	1.82
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	15,106,742.70	2.34
R	文化、体育和娱乐业	1,968,820.00	0.31
S	综合	-	-
	合计	525,518,733.60	81.42

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	11,290.28	0.00
B	采矿业	-	-
C	制造业	51,412,858.26	7.97
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,020.39	0.00
E	建筑业	25,371.37	0.00
F	批发和零售业	95,577.58	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	2,430,252.00	0.38
H	住宿和餐饮业	1,685,720.00	0.26

I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,648,263.64	0.26
J	金融业	34,721.10	0.01
K	房地产业	1,476,345.00	0.23
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	803,257.49	0.12
N	水利、环境和公共设施管理业	564,962.33	0.09
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	60,201,639.44	9.33

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	600519	贵州茅台	16,000	32,907,200.00	5.10
2	000858	五粮液	78,261	23,313,169.29	3.61
3	600036	招商银行	425,801	23,074,156.19	3.57
4	601318	中国平安	214,424	13,783,174.72	2.14
5	600030	中信证券	491,200	12,250,528.00	1.90
6	601012	隆基股份	136,200	12,100,008.00	1.87
7	603259	药明康德	74,920	11,731,722.80	1.82
8	300059	东方财富	354,499	11,624,022.21	1.80
9	002415	海康威视	179,600	11,584,200.00	1.79
10	000333	美的集团	155,200	11,076,624.00	1.72
11	603986	兆易创新	57,300	10,766,670.00	1.67
12	600809	山西汾酒	23,700	10,617,600.00	1.65
13	601888	中国中免	34,200	10,263,420.00	1.59
14	000001	平安银行	396,100	8,959,782.00	1.39
15	002179	中航光电	112,900	8,921,358.00	1.38
16	601166	兴业银行	429,300	8,822,115.00	1.37

17	002049	紫光国微	57,200	8,819,668.00	1.37
18	000063	中兴通讯	239,400	7,955,262.00	1.23
19	002594	比亚迪	30,100	7,555,100.00	1.17
20	300124	汇川技术	97,250	7,221,785.00	1.12
21	600309	万华化学	63,700	6,931,834.00	1.07
22	603501	韦尔股份	21,200	6,826,400.00	1.06
23	002821	凯莱英	18,300	6,818,580.00	1.06
24	601211	国泰君安	396,800	6,801,152.00	1.05
25	300014	亿纬锂能	64,600	6,713,878.00	1.04
26	600900	长江电力	320,900	6,623,376.00	1.03
27	300015	爱尔眼科	90,765	6,442,499.70	1.00
28	000725	京东方A	1,029,200	6,422,208.00	1.00
29	002475	立讯精密	135,960	6,254,160.00	0.97
30	600763	通策医疗	14,900	6,123,900.00	0.95
31	600919	江苏银行	849,700	6,032,870.00	0.93
32	600031	三一重工	205,200	5,965,164.00	0.92
33	000776	广发证券	387,200	5,862,208.00	0.91
34	002129	中环股份	150,500	5,809,300.00	0.90
35	300122	智飞生物	30,700	5,732,611.00	0.89
36	603799	华友钴业	49,800	5,687,160.00	0.88
37	002241	歌尔股份	125,100	5,346,774.00	0.83
38	002352	顺丰控股	77,600	5,253,520.00	0.81
39	601899	紫金矿业	531,300	5,148,297.00	0.80
40	600660	福耀玻璃	86,300	4,819,855.00	0.75
41	600887	伊利股份	129,200	4,758,436.00	0.74
42	002311	海大集团	57,900	4,724,640.00	0.73
43	601633	长城汽车	108,300	4,720,797.00	0.73
44	600436	片仔癀	10,300	4,617,490.00	0.72
45	601009	南京银行	438,500	4,613,020.00	0.71
46	601919	中远海控	150,400	4,593,216.00	0.71
47	600048	保利地产	377,900	4,549,916.00	0.70
48	600276	恒瑞医药	66,857	4,544,270.29	0.70
49	601838	成都银行	358,400	4,530,176.00	0.70
50	601668	中国建筑	971,700	4,518,405.00	0.70
51	002460	赣锋锂业	35,500	4,298,695.00	0.67
52	601658	邮储银行	852,900	4,281,558.00	0.66
53	601857	中国石油	808,400	4,276,436.00	0.66
54	688396	华润微	43,670	3,974,843.40	0.62
55	601628	中国人寿	110,000	3,727,900.00	0.58
56	002142	宁波银行	95,500	3,721,635.00	0.58
57	600690	海尔智家	143,400	3,715,494.00	0.58

58	002271	东方雨虹	66,250	3,664,950.00	0.57
59	300274	阳光电源	30,500	3,509,330.00	0.54
60	600999	招商证券	184,490	3,508,999.80	0.54
61	002230	科大讯飞	51,600	3,487,128.00	0.54
62	603659	璞泰来	24,900	3,401,340.00	0.53
63	300529	健帆生物	39,000	3,368,040.00	0.52
64	002027	分众传媒	357,300	3,362,193.00	0.52
65	600104	上汽集团	147,400	3,238,378.00	0.50
66	601006	大秦铁路	480,200	3,159,716.00	0.49
67	688169	石头科技	2,400	3,026,400.00	0.47
68	601377	兴业证券	300,700	2,904,762.00	0.45
69	603195	公牛集团	14,300	2,888,600.00	0.45
70	601155	新城控股	67,800	2,820,480.00	0.44
71	002410	广联达	39,600	2,700,720.00	0.42
72	688111	金山办公	6,488	2,561,462.40	0.40
73	300595	欧普康视	24,540	2,541,117.00	0.39
74	603882	金域医学	15,900	2,540,343.00	0.39
75	601225	陕西煤业	205,600	2,436,360.00	0.38
76	600426	华鲁恒升	76,700	2,373,865.00	0.37
77	603369	今世缘	43,400	2,350,544.00	0.36
78	300033	同花顺	20,700	2,334,546.00	0.36
79	601607	上海医药	109,000	2,303,170.00	0.36
80	000100	TCL科技	272,800	2,086,920.00	0.32
81	600111	北方稀土	96,700	2,001,690.00	0.31
82	300413	芒果超媒	28,700	1,968,820.00	0.31
83	603233	大参林	34,780	1,777,605.80	0.28
84	000338	潍柴动力	94,100	1,681,567.00	0.26
85	000661	长春高新	3,600	1,393,200.00	0.22
86	601336	新华保险	21,700	996,247.00	0.15

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	601636	旗滨集团	295,400	5,482,624.00	0.85
2	300316	晶盛机电	79,300	4,004,650.00	0.62
3	000739	普洛药业	118,100	3,472,140.00	0.54
4	300750	宁德时代	6,000	3,208,800.00	0.50
5	002677	浙江美大	174,400	3,188,032.00	0.49
6	002139	拓邦股份	176,200	3,169,838.00	0.49

7	000932	华菱钢铁	466,900	3,081,540.00	0.48
8	002563	森马服饰	249,200	2,977,940.00	0.46
9	600779	水井坊	21,800	2,754,430.00	0.43
10	002920	德赛西威	22,100	2,432,768.00	0.38
11	001965	招商公路	336,600	2,430,252.00	0.38
12	002833	弘亚数控	60,840	2,357,550.00	0.37
13	300782	卓胜微	4,300	2,311,250.00	0.36
14	002080	中材科技	86,600	2,266,322.00	0.35
15	603605	珀莱雅	11,200	2,203,152.00	0.34
16	000799	酒鬼酒	8,000	2,044,800.00	0.32
17	600754	锦江酒店	29,600	1,685,720.00	0.26
18	600298	安琪酵母	30,200	1,642,276.00	0.25
19	300496	中科创达	10,200	1,602,012.00	0.25
20	002968	新大正	33,900	1,476,345.00	0.23
21	300896	爱美客	1,500	1,183,320.00	0.18
22	688133	泰坦科技	2,527	803,257.49	0.12
23	603180	金牌厨柜	12,040	574,187.60	0.09
24	002706	良信股份	25,220	568,458.80	0.09
25	603568	伟明环保	22,800	520,524.00	0.08
26	601689	拓普集团	12,700	475,361.00	0.07
27	603313	梦百合	13,000	390,650.00	0.06
28	688665	四方光电	1,687	218,399.02	0.03
29	688079	美迪凯	10,622	195,444.80	0.03
30	300957	贝泰妮	543	136,814.28	0.02
31	300919	中伟股份	610	99,430.00	0.02
32	688319	欧林生物	3,412	93,284.08	0.01
33	300979	华利集团	907	79,362.50	0.01
34	301018	申菱环境	7,811	64,753.19	0.01
35	688355	明志科技	2,710	64,498.00	0.01
36	688239	航宇科技	4,926	56,550.48	0.01
37	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.01
38	300981	中红医疗	549	49,624.11	0.01
39	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.01
40	688655	迅捷兴	3,083	48,618.91	0.01
41	300894	火星人	628	42,704.00	0.01
42	300973	立高食品	360	41,655.60	0.01
43	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.01
44	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.00
45	300953	震裕科技	240	23,964.00	0.00
46	001207	联科科技	682	22,581.02	0.00
47	301015	百洋医药	462	17,939.46	0.00
48	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00

49	300925	法本信息	600	15,774.00	0.00
50	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00
51	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.00
52	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
53	300940	南极光	307	13,317.66	0.00
54	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
55	300937	药易购	244	13,105.24	0.00
56	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00
57	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
58	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
59	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.00
60	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
61	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
62	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
63	300996	普联软件	241	10,177.43	0.00
64	300956	英力股份	371	9,571.80	0.00
65	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
66	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
67	301016	雷尔伟	275	9,069.50	0.00
68	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
69	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
70	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
71	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
72	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
73	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
74	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
75	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
76	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
77	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
78	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
79	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
80	300993	玉马遮阳	410	7,908.90	0.00
81	300930	屹通新材	322	7,882.56	0.00
82	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00
83	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
84	301004	嘉益股份	312	6,845.28	0.00
85	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
86	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
87	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
88	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
89	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
90	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00

91	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
92	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
93	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
94	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
95	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
96	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
97	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
98	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
99	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
100	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
101	301010	晶雪节能	218	3,838.98	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000858	五粮液	17,722,588.00	2.48
2	000568	泸州老窖	16,113,506.72	2.26
3	600919	江苏银行	15,385,548.61	2.16
4	600030	中信证券	14,380,741.00	2.02
5	600519	贵州茅台	14,162,044.00	1.99
6	603986	兆易创新	13,155,818.20	1.84
7	600809	山西汾酒	13,053,736.80	1.83
8	601919	中远海控	12,986,537.38	1.82
9	300122	智飞生物	12,607,590.00	1.77
10	300750	宁德时代	12,063,089.45	1.69
11	000776	广发证券	12,021,557.00	1.69
12	600887	伊利股份	11,796,335.67	1.65
13	600048	保利地产	11,651,329.00	1.63
14	601211	国泰君安	11,593,091.00	1.63
15	300015	爱尔眼科	11,015,742.88	1.54
16	002714	牧原股份	10,738,855.68	1.51
17	600926	杭州银行	10,538,031.76	1.48
18	601328	交通银行	10,346,459.00	1.45
19	601336	新华保险	10,294,971.00	1.44
20	601668	中国建筑	10,109,306.00	1.42

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	000568	泸州老窖	26,044,033.32	3.65
2	601328	交通银行	19,264,720.00	2.70
3	601318	中国平安	18,820,376.14	2.64
4	600519	贵州茅台	18,336,844.00	2.57
5	600887	伊利股份	17,028,164.40	2.39
6	000002	万科A	15,429,377.95	2.16
7	601398	工商银行	14,995,696.00	2.10
8	000001	平安银行	14,277,638.42	2.00
9	000858	五粮液	13,192,514.99	1.85
10	600048	保利地产	13,099,225.00	1.84
11	601012	隆基股份	12,693,655.00	1.78
12	000661	长春高新	11,964,185.06	1.68
13	601668	中国建筑	11,860,608.40	1.66
14	300122	智飞生物	11,785,441.68	1.65
15	601919	中远海控	11,562,268.20	1.62
16	000651	格力电器	11,485,190.39	1.61
17	601211	国泰君安	11,446,164.42	1.60
18	600031	三一重工	11,367,099.91	1.59
19	600276	恒瑞医药	11,117,771.91	1.56
20	601336	新华保险	11,054,837.02	1.55

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	1,115,449,199.17
卖出股票收入（成交）总额	1,179,768,600.28

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	6,004.20	0.00

2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	1,871,781.94	0.29
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,877,786.14	0.29

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	110079	杭银转债	7,110	809,615.70	0.13
2	123111	东财转3	5,284	773,366.24	0.12
3	127038	国微转债	1,540	154,000.00	0.02
4	123117	健帆转债	688	68,800.00	0.01
5	113049	长汽转债	660	66,000.00	0.01

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

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
IF2109	IF2109	15	23,248,800.00	-195,265.32	-
公允价值变动总额合计（元）					-195,265.32
股指期货投资本期收益（元）					1,991,542.15
股指期货投资本期公允价值变动（元）					-2,485,225.32

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金主要利用股指期货提高投资效率，以更好地实现本基金的投资目标，降低跟踪误差。此外，在预期大额申购赎回、大额分红等情形发生时，本基金可以通过股指期货进行有效的

现金头寸管理。

本基金投资于股指期货，对基金总体风险的影响很小，并符合既定的投资政策和投资目标。

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

沪深300增强基金截至2021年6月30日持仓前十名证券中的招商银行（600036）的发行人招商银行股份有限公司于2021年5月21日公告，因公司存在以下违规行为：一、为同业投资提供第三方信用担保、为非保本理财产品出具保本承诺，部分未按规定计提风险加权资产；二、违规协助无衍生产品交易业务资格的银行发行结构性衍生产品；三、理财产品之间风险隔离不到位；四、理财资金投资非标准化债权资产认定不准确，实际余额超监管标准；五、同业投资接受第三方金融机构信用担保；六、理财资金池化运作；七、利用理财产品准备金调节收益；八、高净值客户认定不审慎；九、并表管理不到位，通过关联非银机构的内部交易，违规变相降低理财产品销售门槛；十、投资集合资金信托计划的理财产品未执行合格投资者标准；十一、投资集合资金信托计划人数超限；十二、面向不合格个人投资者销售投资高风险资产或权益性资产的理财产品；十三、信贷资产非真实转让；十四、全权委托业务不规范；十五、未按要求向监管机构报告理财投资合作机构，被监管否决后仍未及时停办业务；十六、通过关联机构引入非合格投资者，受让以本行信用卡债权设立的信托次级受益权；十七、“智能投资受托计划业务”通过其他方式规避整改，扩大业务规模，且业务数据和材料缺失；十八、票据转贴现假卖断屡查屡犯；十九、贷款、理财或同业投资资金违规投向土地储备项目；二十、理财资金违规提供棚改项目资本金融资，向地方政府提供融资并要求地方政府提供担保；二十一、同业投资、理财资金等违规投向地价款或四证不全的房地产项目；二十二、理财资金认购商业银行增发的股票；二十三、违规为企业发行短期融资券提供搭桥融资，并用理财产品投资本行主承债券以承接表内类信贷资产；二十四、为定制公募基金提供投资顾问；二十五、为本行承销债券兑付提供资金支持；二十六、协助发行人以非市场化的价格发行债券；二十七、瞒报案件信息

；于2021年5月17日收到中国银行保险监督管理委员会罚款7170万元的处罚。

本基金管理人通过对上述上市公司进行进一步了解和他分析，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九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。

7.12.2

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	2,880,251.95
2	应收证券清算款	38,452,321.84
3	应收股利	-
4	应收利息	19,759.75
5	应收申购款	2,099,718.99
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	43,452,052.53

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

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

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

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，合计数可能不等于分项之和。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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（%）
华宝沪深300增强	135,469	1,954.43	66,779,619.28	25.22	197,984,456.31	74.78
华宝沪深300增强C	11,914	2,400.01	2,320,430.28	8.12	26,273,293.24	91.88
合计	147,383	1,990.45	69,100,049.56	23.55	224,257,749.55	76.45

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	华宝沪深300增强	1,719,596.79	0.6495
	华宝沪深300增强C	55,019.68	0.1924
	合计	1,774,616.47	0.6049

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	华宝沪深300增强	>100
	华宝沪深300增强C	0~10
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	华宝沪深300增强	>100
	华宝沪深300增强C	0~10
	合计	>100

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	3.41	不少于三年
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	3.41	-

注：1、本基金募集期间，本基金管理人运用自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、本基金管理人运用自有资金于2016年12月6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2020年8月21日赎回10,000,450.05份。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华宝沪深300增强	华宝沪深300增强C
基金合同生效日（2016年12月9日）基金份额总额	10,000,450.05	-
本报告期期初 基金份额总额	283,257,214.04	52,651,703.73
本报告期 基金总申购份额	117,495,180.72	45,000,105.92
减：本报告期基金总赎回份额	135,988,319.17	69,058,086.13
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	264,764,075.59	28,593,723.52

§ 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、基金托管人的重大人事变动

2021年5月，中国农业银行总行决定谭敦宇任托管业务部总裁。

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

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	
海通证	2	2,286,186,04	100.00%	2,108,230	100.00%	-

券		6.13		.32		
东兴证 券	2	-	-	-	-	-
国泰君 安	4	-	-	-	-	-
中信建 投	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况况稳定；经营行为规范，最近两年未因重大违规行为受到中国证监会和中国人民银行处罚；内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；具备基金运作所需要的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要，并能为本基金提供全面的信息服务；研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告；适当的地域分散化。

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

2、本基金本报告期新增券商交易单元信息如下：东兴证券

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
海通证券	83,531,179.15	100.00%	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-

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	华宝沪深300指数增强型发起式证券投资基金（A类份额）基金产品资料概要（更新）	2021-3-31	基金管理人网站

2	华宝沪深300指数增强型发起式证券投资基金2020年年度报告	2021-3-31	基金管理人网站
3	华宝沪深300指数增强型发起式证券投资基金2020年第4季度报告	2021-1-22	基金管理人网站
4	华宝沪深300指数增强型发起式证券投资基金2021年第1季度报告	2021-4-22	基金管理人网站
5	华宝沪深300指数增强型发起式证券投资基金基金合同	2021-3-31	基金管理人网站
6	华宝沪深300指数增强型发起式证券投资基金招募说明书（更新）	2021-3-31	基金管理人网站
7	华宝新优选一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金开放日常申购、赎回及转换业务的公告	2021-5-18	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
8	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	2021-1-9	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
9	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	2021-2-26	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
10	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	2021-5-27	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
11	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	2021-5-18	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
12	华宝基金关于旗下部分开放式基金新增中金财富为代销机构的公告	2021-3-31	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
13	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	2021-3-31	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
14	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	2021-6-23	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
15	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	2021-4-15	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
16	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	2021-6-10	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
17	华宝沪深300指数增强型发起式证券投资基金（C类份额）基金产品资料概要（更新）	2021-3-31	基金管理人网站
18	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	2021-3-31	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
19	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	2021-3-31	基金管理人网站, 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国国证券报
20	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	2021-5-13	基金管理人网站, 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国国证券报

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

基金管理人于2021年3月31日发布《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》，具体内容详见公司公告，请投资者予以关注。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

中国证监会批准基金设立的文件；
 华宝沪深300指数增强型发起式证券投资基金基金合同；
 华宝沪深300指数增强型发起式证券投资基金招募说明书；
 华宝沪深300指数增强型发起式证券投资基金托管协议；
 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
 基金管理人报告期内在指定报刊上披露的各种公告；
 基金托管人业务资格批件和营业执照。

12.2 存放地点

以上文件存于基金管理人及基金托管人办公场所备投资者查阅。

12.3 查阅方式

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

华宝基金管理有限公司

2021年8月27日